

# 中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券 投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 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> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>18</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	18
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.....	18
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.....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>19</b>
6.1 审计报告基本信息.....	19
6.2 审计报告的基本内容.....	19
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>22</b>
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>61</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	61
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.....	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	79
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
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.....	81
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.....	81

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 .....	81
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 .....	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12 投资组合报告附注 .....	81
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>83</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	83
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>85</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>86</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	86
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 .....	86
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	86
11.4 基金投资策略的改变 .....	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	86
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 .....	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	86
11.8 其他重大事件 .....	88
<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 .....	90
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>91</b>
13.1 备查文件目录 .....	91
13.2 存放地点 .....	91
13.3 查阅方式 .....	91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金	
基金简称	中航量化阿尔法六个月持有	
基金主代码	011934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 25 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	294,396,802.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
下属分级基金的交易代码:	011934	011935
报告期末下属分级基金的份额总额	77,208,340.07 份	217,188,462.10 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

注册地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院 1 号楼 1 层 101 内 10 层 B1001 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号北京亚洲金融大厦 B 座 1001、1007、1008 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	杨彦伟	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)	北京海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼
注册登记机构	中航基金管理有限公司	北京市朝阳区天辰东路 1 号北京亚洲金融大厦 B 座 1001、1007、1008 单元

### § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年 8 月 25 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
本期已实现收益	-7,461,230.92	-22,323,289.52	-1,964,303.86	-5,421,917.03
本期利润	-12,172,443.18	-35,189,056.36	-886,657.53	-3,085,207.42
加权平均基金份额本期利润	-0.1457	-0.1478	-0.0103	-0.0121
本期加权平均净值利润率	-16.16%	-16.49%	-1.05%	-1.23%
本期基金份额净值增长率	-14.17%	-14.68%	-1.00%	-1.21%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	-11,601,630.77	-34,127,007.90	-1,756,059.79	-5,415,572.35
期末可供分配基金份额利润	-0.1503	-0.1571	-0.0192	-0.0212
期末基金资产净值	65,606,709.30	183,061,454.20	90,726,197.67	252,165,125.80
期末基金份额净值	0.8497	0.8429	0.9900	0.9879
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-15.03%	-15.71%	-1.00%	-1.21%

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

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

④本基金基金合同于 2021 年 8 月 25 日生效，上年度为不完整会计年度。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中航量化阿尔法六个月持有 A

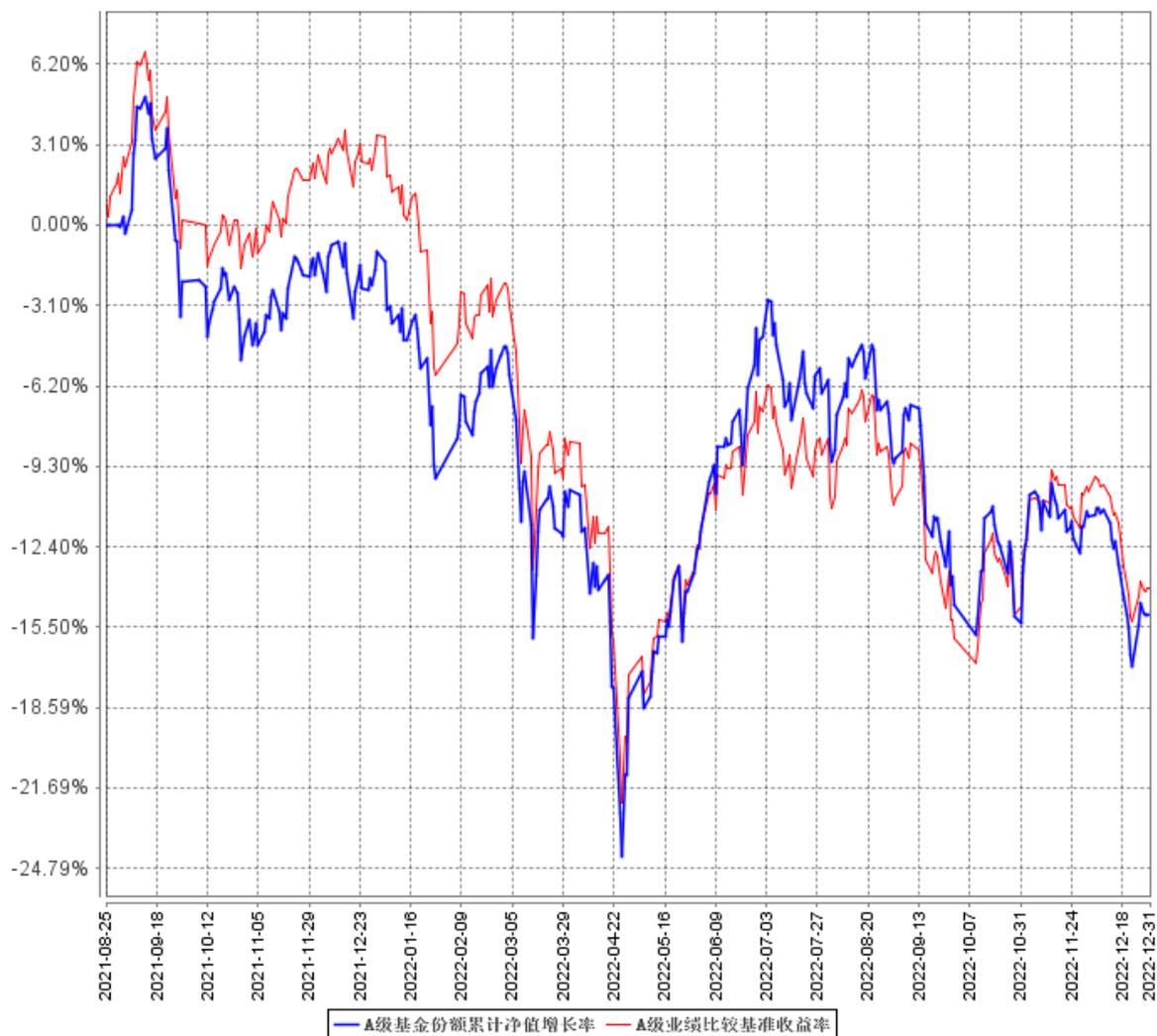
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.47%	0.98%	2.27%	0.87%	-2.74%	0.11%
过去六个月	-11.09%	1.01%	-7.53%	0.93%	-3.56%	0.08%
过去一年	-14.17%	1.27%	-16.90%	1.17%	2.73%	0.10%
自基金合同生效起至今	-15.03%	1.18%	-14.01%	1.08%	-1.02%	0.10%

中航量化阿尔法六个月持有 C

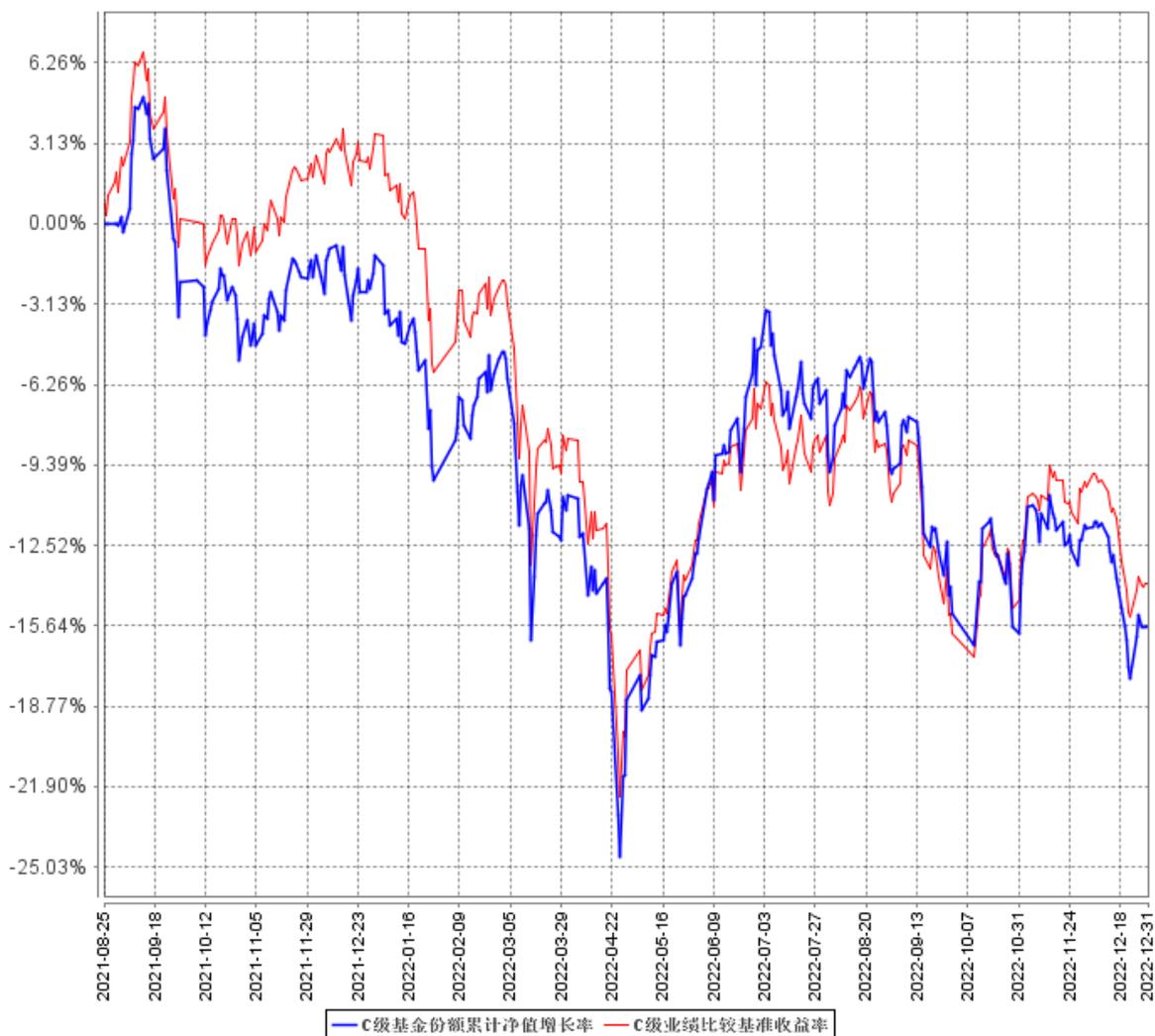
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.61%	0.98%	2.27%	0.87%	-2.88%	0.11%
过去六个月	-11.35%	1.01%	-7.53%	0.93%	-3.82%	0.08%
过去一年	-14.68%	1.27%	-16.90%	1.17%	2.22%	0.10%
自基金合同生效起至今	-15.71%	1.18%	-14.01%	1.08%	-1.70%	0.10%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



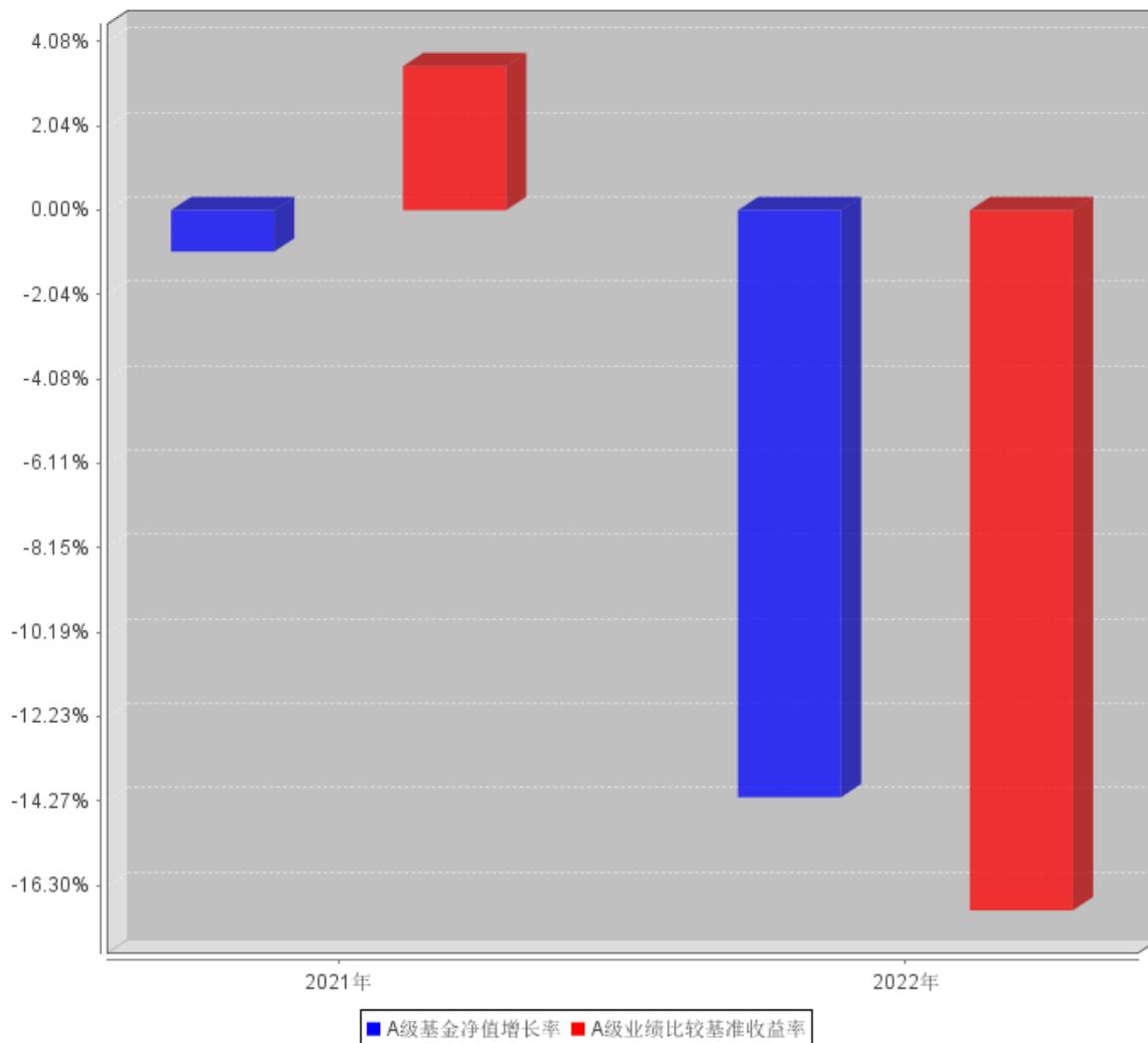
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



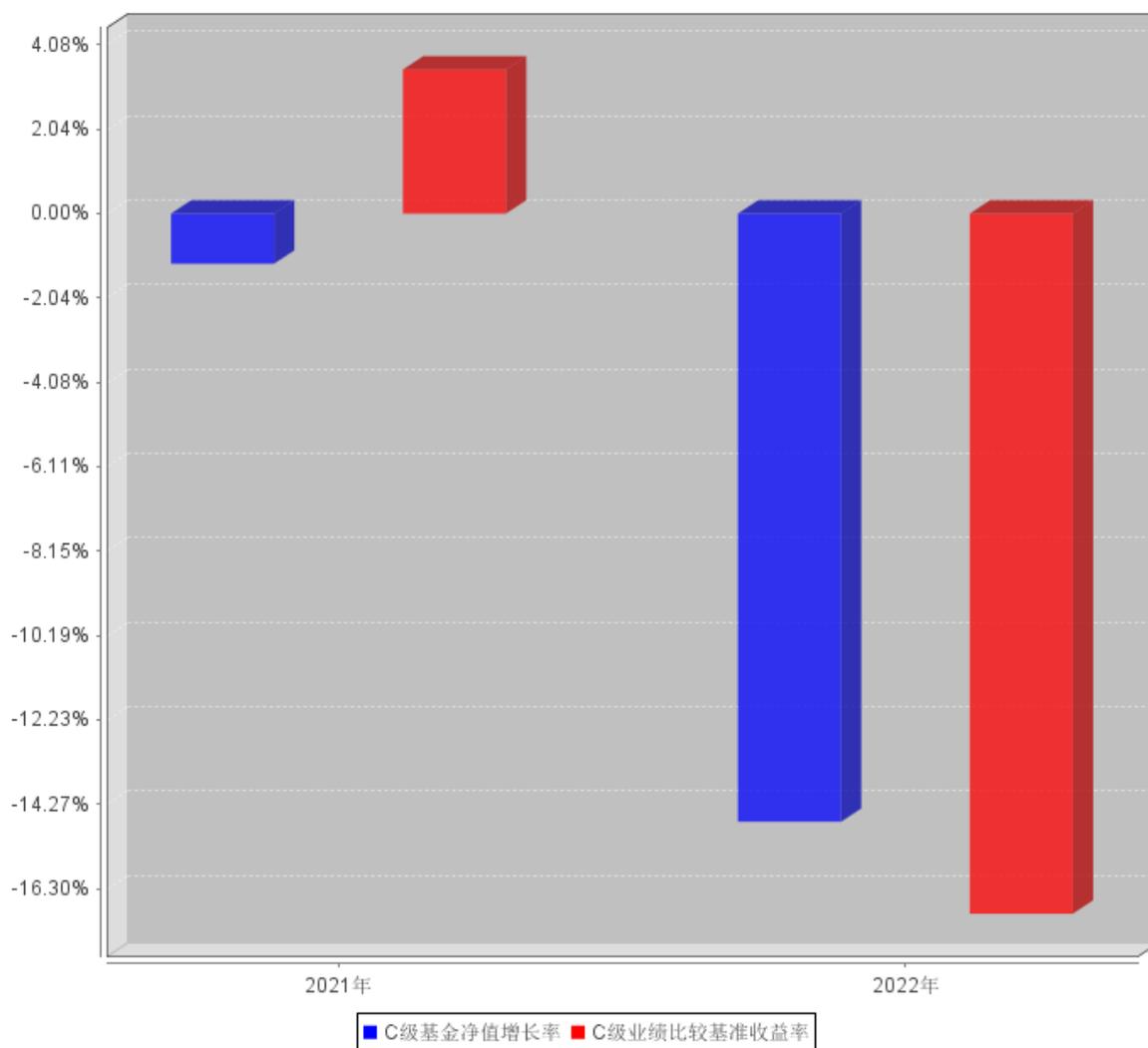
注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关规定。

### 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

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



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



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2021年8月25日）至报告期截止日（2022年12月31日）未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	基金经理	2021 年 8 月 25 日	-	11	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部负责人，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。
杨扬	基金经理	2021 年 9 月 16 日	-	11	硕士研究生，具有 10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于上海东

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

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年，在国内疫情蔓延、全球地缘政治冲突、海外美联储加息等多重因素共振下，A 股市场全年震荡收跌，沪深 300 指数、中证 500 指数、创业板指数下跌幅度分别达-21.63%、-20.31%、-29.37%。

本基金坚持以量化基本面模型为主、以主观调整为辅的投资策略，将投资组合相对于中证 500 指数的行业偏离、风险敞口控制在合理范围内，追求相对中证 500 指数的长期超额收益。分阶段看，本基金上半年超额收益较为稳定，但下半年尤其四季度以来，由于盈利、质量等基本面因子发生较为显著的回撤，同时我们长期看好的部分景气成长型行业亦出现了回调，对基金超额收益造成一定拖累。总体来看，今年本基金超额幅度低于预期，但整体上实现了超越业绩基准的既定目标。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值为 0.8497 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.17%；截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值为 0.8429 元，本报告期基金份额净值增长率为-14.68%；同期业绩比较基准收益率为-16.90%。

## 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 2023 年，我们对市场整体持偏乐观积极的态度。去年四季度以来，压制市场的几大核心因素，包括地产政策、疫情防控、外围加息等因素均出现方向性的改善和持续优化，我们认为今年市场无论是分子端的盈利还是分母端的风险偏好都将显著优于去年。投资策略上，我们仍将综合考虑行业的景气度、公司业绩的确定性及估值的合理性，自下而上精选个股，同时对投资组合整体风险暴露进行密切监控，力争为投资者创造长期稳健的超额收益。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，以维护基金份额持有人利益为宗旨，组织开展内部监察稽核，完善合规与内控机制，积极推动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。本报告期内，本基金管理人开展的主要监察稽核工作如下：

- (1) 积极推动监管新规落实，持续完善公司内控机制。结合新规实施和公司业务发展实际，

不断推动公司制度、业务流程的建立、健全和完善，以适应公司产品与业务创新发展的需要；

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

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

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

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

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

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

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	天职业字[2023]17298 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金全体持有人：
审计意见	<p>我们审计了中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金（以下简称“中航量化阿尔法六个月持有股票基金”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表、2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制。公允反映了中航量化阿尔法六个月持有股票基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中航量化阿尔法六个月持有股票基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	<p>中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金财务报表仅为满足中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会的监管需要之目的而编制。因此，该财务报表可能不适用于其他用途。我们的报告仅用于供中航量化阿尔法六个月持有股票基金管理人报送中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会使用，而不应分发至除中航量化阿尔法六个月持有股票基金持有人、中国证券监督管理委员会及相关派出机构、中国证券投资基金业协会以外的其他机构或人员或为其使用。</p> <p>本段内容不影响已发表的审计意见。</p>
其他信息	<p>中航量化阿尔法六个月持有股票基金管理人中航基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中航量化阿尔法六个月持有股票基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中航量化阿尔法六个月持有股票基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中航量化阿尔法六个月持有股票基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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。</li> <li>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。</li> <li>3. 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</li> <li>4. 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中航量化阿尔法六个月持有股票基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中</li> </ol>

	<p>提请报表使用者注意财务报表中的相关披露：如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致中航量化阿尔法六个月持有股票基金不能持续经营。</p> <p>5. 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	天职国际会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	丁启新   周任阳
会计师事务所的地址	北京市海淀区车公庄西路 19 号外文文化创意园 12 号楼
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	25,035,276.81	34,347,072.29
结算备付金		839,918.61	2,033,382.80
存出保证金		37,070.38	93,769.31
交易性金融资产	7.4.7.2	223,129,751.45	309,585,208.97
其中：股票投资		223,129,751.45	309,585,208.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,420,480.87	975,340.87
应收股利		-	-
应收申购款		2.00	22,709.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	4,540.20
资产总计		250,462,500.12	347,062,024.37
<b>负债和净资产</b>			
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		586,337.60	1,734,838.38
应付赎回款		1,114.22	-

应付管理人报酬		329,359.18	433,734.70
应付托管费		54,893.20	72,289.14
应付销售服务费		97,159.98	127,610.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	725,472.44	1,802,228.41
负债合计		1,794,336.62	4,170,700.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	294,396,802.17	346,894,590.56
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-45,728,638.67	-4,003,267.09
净资产合计		248,668,163.50	342,891,323.47
负债和净资产总计		250,462,500.12	347,062,024.37

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 294,396,802.17 份，其中中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值 0.8497 元，基金份额总额 77,208,340.07 份；中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值 0.8429 元，基金份额总额 217,188,462.10 份；

②本基金基金合同于 2021 年 8 月 25 日生效，上年度为不完整会计年度，下同。

③以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 25 日(基 金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-40,867,041.61	1,636,676.58
1.利息收入		121,716.95	129,460.72
其中：存款利息收入	7.4.7.13	121,716.95	86,248.79
债券利息收入		-	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	43,211.93
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
<b>2.投资收益（损失以“-”填列）</b>		-23,411,779.46	-1,907,140.08
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-27,469,346.64	-2,300,246.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	4,057,567.18	393,106.37
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
<b>3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）</b>	7.4.7.20	-17,576,979.10	3,414,355.94
<b>4.汇兑收益（损失以“-”号填列）</b>		-	-
<b>5.其他收入（损失以“-”号填列）</b>	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		6,494,457.93	5,608,541.53
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,333,747.33	1,766,452.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	722,291.20	294,408.91
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,281,242.33	528,767.85
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	157,177.07	3,018,911.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-47,361,499.54	-3,971,864.95
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-47,361,499.54	-3,971,864.95
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-47,361,499.54	-3,971,864.95

注：以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,497,788.39	-	-41,725,371.58	-94,223,159.97
（一）、综合收益总额	-	-	-47,361,499.54	-47,361,499.54
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-52,497,788.39	-	5,636,127.96	-46,861,660.43
其中：1.基金申购款	1,252,087.38	-	-147,663.13	1,104,424.25
2.基金赎回款	-53,749,875.77	-	5,783,791.09	-47,966,084.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50
项目	上年度可比期间 2021 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	329,173,593.39	-	-	329,173,593.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,720,997.17	-	-4,003,267.09	13,717,730.08
（一）、综合收益总额	-	-	-3,971,864.95	-3,971,864.95
（二）、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）	17,720,997.17	-	-31,402.14	17,689,595.03
其中：1.基金申购款	17,720,997.17	-	-31,402.14	17,689,595.03
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
刘建

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
裴荣荣

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
韩丹

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]857 号文《关于准予中航量化阿尔法六个月持有期

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金

2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期本基金所采用的会计政策与最近一期年度报告不一致，会计估计与最近一期年度报告相一致。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单和衍生工具等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终

止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的，按其规定进行估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由各兑付机构扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资

产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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；处置时其公允价值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按直线法近似计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

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

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

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

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

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

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

4、本基金每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **7.4.4.12 分部报告**

无。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

#### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产科目及账面价值：银行存款金额 34,347,072.29 元、结算备付金金额 2,033,382.80 元、存出保证金金额 93,769.31 元、应收利息金额 4,540.20 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产科目及账面价值调整为：银行存款金额 34,350,559.57 元、结算备付金金额 2,034,389.30 元、存出保证金金额 93,815.73 元、应收利息金额 0.00 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债科目及账面价值：应付交易费用金额 1,665,228.41 元、其他负债金额 137,000.00 元。新金融工具准则下金融负债科目及账面价值调整为：应付交易费用金额 0.00 元、其他负债金额 1,802,228.41 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无需要说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2016】36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税【2016】70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；

2. 基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；

3. 对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税；

4. 存款利息收入不征收增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；

5. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

6. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计

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

7. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	25,035,276.81	34,347,072.29
等于：本金	25,032,651.45	34,347,072.29
加：应计利息	2,625.36	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计：	25,035,276.81	34,347,072.29

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	237,292,374.61	-	223,129,751.45	-14,162,623.16
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券 交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		237,292,374.61	-	223,129,751.45	-14,162,623.16
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		306,170,853.03	-	309,585,208.97	3,414,355.94
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		306,170,853.03	-	309,585,208.97	3,414,355.94

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有期货合约。

#### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有黄金衍生品。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期本基金未计提减值准备。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	4,540.20
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	4,540.20

注：本报告期末本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	578,472.44	1,665,228.41
其中：交易所市场	578,472.44	1,665,228.41

银行间市场	-	-
	-	-
应付利息	-	-
预提费用	147,000.00	137,000.00
合计	725,472.44	1,802,228.41

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费。

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,643,376.51	91,643,376.51
本期申购	590,893.93	590,893.93
本期赎回（以“-”号填列）	-15,025,930.37	-15,025,930.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	77,208,340.07	77,208,340.07

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,251,214.05	255,251,214.05
本期申购	661,193.45	661,193.45
本期赎回（以“-”号填列）	-38,723,945.40	-38,723,945.40
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	217,188,462.10	217,188,462.10

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

**7.4.7.12 未分配利润**

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,756,059.79	838,880.95	-917,178.84
本期利润	-7,461,230.92	-4,711,212.26	-12,172,443.18
本期基金份额交易产生的变动数	997,965.90	490,025.35	1,487,991.25
其中：基金申购款	-36,691.21	-33,960.22	-70,651.43
基金赎回款	1,034,657.11	523,985.57	1,558,642.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,219,324.81	-3,382,305.96	-11,601,630.77

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-5,415,572.35	2,329,484.10	-3,086,088.25
本期利润	-22,323,289.52	-12,865,766.84	-35,189,056.36
本期基金份额交易产生的变动数	3,081,383.59	1,066,753.12	4,148,136.71
其中：基金申购款	-54,877.98	-22,133.72	-77,011.70
基金赎回款	3,136,261.57	1,088,886.84	4,225,148.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-24,657,478.28	-9,469,529.62	-34,127,007.90

**7.4.7.13 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日
活期存款利息收入	96,004.40	72,351.49
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	24,458.57	13,592.75
其他	1,253.98	304.55
合计	121,716.95	86,248.79

注：其他包括基金结算保证金利息收入。

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

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至	2021年8月25日(基金合同生

	2022 年 12 月 31 日	效日)至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-27,469,346.64	-2,300,246.45
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-27,469,346.64	-2,300,246.45

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 25 日(基金 合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,072,239,758.72	988,429,911.24
减：卖出股票成本总额	2,094,259,449.99	990,730,157.69
减：交易费用	5,449,655.37	-
买卖股票差价收入	-27,469,346.64	-2,300,246.45

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

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

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,057,567.18	393,106.37
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,057,567.18	393,106.37

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同 生效日)至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-17,576,979.10	3,414,355.94
——股票投资	-17,576,979.10	3,414,355.94
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价 值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	-17,576,979.10	3,414,355.94

**7.4.7.21 其他收入**

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

**7.4.7.22 信用减值损失**

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

**7.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同 生效日)至2021年12月31日
审计费用	27,000.00	27,000.00
信息披露费	120,000.00	110,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款费	10,177.07	3,006.32
开户费	-	400.00
交易费用	-	2,878,505.48
合计	157,177.07	3,018,911.80

**7.4.7.24 分部报告**

无。

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同生效日)至 2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中航证券有限公司	797,415,772.57	19.59%	761,998,283.28	33.46%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同生效日)至 2021年12月31日	
-------	-----------------------------	--	--	--

	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
中航证券有限公司	-	-	385,000,000.00	100.00%

注：本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中航证券有限公司	583,145.08	19.59%	17,408.62	3.01%
关联方名称	上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中航证券有限公司	557,254.71	33.46%	557,254.71	33.46%

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同生效日) 至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,333,747.33
其中：支付销售机构的客户维护费	2,122,024.11	862,512.19

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 8 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	722,291.20	294,408.91

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

#### 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		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	合计
招商银行股份有限公司	-	1,246,245.92	1,246,245.92
中航基金管理有限公司	-	53.87	53.87
中航证券有限公司	-	31,372.00	31,372.00
合计	-	1,277,671.79	1,277,671.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021 年 8 月 25 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	中航量化阿尔法六 个月持有 A	中航量化阿尔法六 个月持有 C	合计
招商银行股份有限公司	-	512,891.96	512,891.96
中航基金管理有限公司	-	20.84	20.84
中航证券有限公司	-	13,828.77	13,828.77
合计	-	526,741.57	526,741.57

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

销售服务费的计算方法如下：

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 8 月 25 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	25,912,265.80	121,716.95	36,474,224.40	86,248.79

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

**7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

**7.4.11 利润分配情况**

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

**7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688073	毕得医药	2022 年 9 月 27 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	88.00	77.57	1,527	134,376.00	118,449.39	-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	30.99	21.35	5,511	170,785.89	117,659.85	-
688391	钜泉科技	2022 年 9 月 5 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	115.00	95.83	745	85,675.00	71,393.35	-
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	58.00	86.40	249	14,442.00	21,513.60	-
301115	建科股份	2022 年 8 月 23 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	42.05	24.04	345	14,507.25	8,293.80	-
301121	紫建电子	2022 年 8 月 1 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	61.07	49.78	213	13,007.91	10,603.14	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	26.80	24.47	401	10,746.80	9,812.47	-
301139	元道	2022 年 6 月	1-6 个月(含)	网下配售锁定	38.46	25.29	385	14,807.10	9,736.65	-

	通信	月 30 日	月(含)	售锁定						
301152	天力 锂能	2022 年 8 月 19 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	57.00	46.64	226	12,882.00	10,540.64	-
301161	唯万 密封	2022 年 9 月 6 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷 网络	2022 年 11 月 14 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	32.38	31.91	319	10,329.22	10,179.29	-
301171	易点 天下	2022 年 8 月 10 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	18.18	17.72	476	8,653.68	8,434.72	-
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	3.82	6.00	3,435	13,121.70	20,610.00	-
301176	逸豪 新材	2022 年 9 月 21 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	23.88	16.90	422	10,077.36	7,131.80	-
301197	工大 科雅	2022 年 7 月 29 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	25.50	20.07	380	9,690.00	7,626.60	-
301223	中荣 股份	2022 年 10 月 13 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	26.28	18.17	525	13,797.00	9,539.25	-
301227	森鹰 窗业	2022 年 9 月 16 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	38.25	29.48	284	10,863.00	8,372.32	-
301230	泓博 医药	2022 年 10 月 21 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	40.00	49.25	269	10,760.00	13,248.25	-
301231	荣信 文化	2022 年 8 月 31 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	25.49	20.39	275	7,009.75	5,607.25	-
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	41.52	34.28	158	6,560.16	5,416.24	-
301239	普瑞 眼科	2022 年 6 月 22 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	33.65	69.58	364	12,248.60	25,327.12	-
301265	华新 环保	2022 年 12 月 8 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	13.28	11.60	557	7,396.96	6,461.20	-
301267	华夏 眼科	2022 年 10 月 26 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	50.88	68.65	221	11,244.48	15,171.65	-
301269	华大 九天	2022 年 7 月 21 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	32.69	87.88	303	9,905.07	26,627.64	-
301270	汉仪 股份	2022 年 8 月 19 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	25.68	28.38	210	5,392.80	5,959.80	-
301273	瑞晨 环保	2022 年 10 月 11 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	37.89	37.85	277	10,495.53	10,484.45	-
301276	嘉曼	2022 年 9	1-6 个	网下配	40.66	22.61	265	10,774.90	5,991.65	-

	服饰	月 1 日	月(含)	售锁定						
301277	新天 地	2022 年 11 月 9 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	27.00	27.07	379	10,233.00	10,259.53	-
301282	金禄 电子	2022 年 8 月 18 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	30.38	25.24	297	9,022.86	7,496.28	-
301283	聚胶 股份	2022 年 8 月 26 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	52.69	51.38	189	9,958.41	9,710.82	-
301285	鸿日 达	2022 年 9 月 21 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星 医疗	2022 年 11 月 23 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	44.09	35.80	264	11,639.76	9,451.20	-
301296	新巨 丰	2022 年 8 月 26 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	18.19	14.94	681	12,387.39	10,174.14	-
301300	远翔 新材	2022 年 8 月 9 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301306	西测 测试	2022 年 7 月 19 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	43.23	42.17	251	10,850.73	10,584.67	-
301309	万得 凯	2022 年 9 月 8 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	39.00	24.46	178	6,942.00	4,353.88	-
301311	昆船 智能	2022 年 11 月 23 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	13.88	16.56	753	10,451.64	12,469.68	-
301313	凡拓 数创	2022 年 9 月 22 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	25.25	29.46	247	6,236.75	7,276.62	-
301316	慧博 云通	2022 年 9 月 29 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	7.60	17.67	359	2,728.40	6,343.53	-
301318	维海 德	2022 年 8 月 3 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	64.68	41.73	152	9,831.36	6,342.96	-
301319	唯特 偶	2022 年 9 月 22 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	47.75	53.38	115	5,491.25	6,138.70	-
301326	捷邦 科技	2022 年 9 月 9 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	51.72	36.63	227	11,740.44	8,315.01	-
301327	华宝 新能	2022 年 9 月 8 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	237.50	176.98	121	28,737.50	21,414.58	-
301328	维峰 电子	2022 年 8 月 30 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	78.80	76.95	125	9,850.00	9,618.75	-
301330	熵基 科技	2022 年 8 月 10 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	43.32	31.31	423	18,324.36	13,244.13	-
301335	天元 宠物	2022 年 11 月 11 日	1-6 个 月(含)	网下配 售锁定	49.98	34.07	269	13,444.62	9,164.83	-
301338	凯格	2022 年 8	1-6 个	网下配	46.33	49.08	257	11,906.81	12,613.56	-

	精机	月 8 日	月(含)	售锁定							
301339	通行宝	2022年9月2日	1-6个月(含)	网下配售锁定	18.78	15.58	561	10,535.58	8,740.38	-	
301349	信德新材	2022年8月30日	1-6个月(含)	网下配售锁定	138.88	103.44	63	8,749.44	6,516.72	-	
301359	东南电子	2022年11月2日	1-6个月(含)	网下配售锁定	20.84	21.00	328	6,835.52	6,888.00	-	
301361	众智科技	2022年11月8日	1-6个月(含)	网下配售锁定	26.44	21.39	517	13,669.48	11,058.63	-	
301363	美好医疗	2022年9月28日	1-6个月(含)	网下配售锁定	30.66	38.22	324	9,933.84	12,383.28	-	
301365	矩阵股份	2022年11月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	34.72	23.88	362	12,568.64	8,644.56	-	
301366	一博科技	2022年9月19日	1-6个月(含)	网下配售锁定	65.35	45.34	180	11,763.00	8,161.20	-	
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	1-6个月(含)	网下配售锁定	119.88	202.63	89	10,669.32	18,034.07	-	
301368	丰立智能	2022年12月7日	1-6个月(含)	网下配售锁定	22.33	18.81	337	7,525.21	6,338.97	-	
301379	天山电子	2022年10月19日	1-6个月(含)	网下配售锁定	31.51	24.64	438	13,801.38	10,792.32	-	
301388	欣灵电气	2022年10月26日	1-6个月(含)	网下配售锁定	25.88	22.29	292	7,556.96	6,508.68	-	
301389	隆扬电子	2022年10月18日	1-6个月(含)	网下配售锁定	22.50	17.20	562	12,645.00	9,666.40	-	
301391	卡莱特	2022年11月24日	1-6个月(含)	网下配售锁定	96.00	81.67	129	12,384.00	10,535.43	-	
301396	宏景科技	2022年11月4日	1-6个月(含)	网下配售锁定	40.13	32.69	328	13,162.64	10,722.32	-	
301398	星源卓镁	2022年12月8日	1-6个月(含)	网下配售锁定	34.40	29.36	255	8,772.00	7,486.80	-	

## 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

300850	新强联	2022 年 12 月 30 日	临时 停牌	53.28	2023 年 1 月 10 日	59.32	1,020	90,902.81	54,345.60	-
--------	-----	------------------------	----------	-------	-----------------------	-------	-------	-----------	-----------	---

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

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

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

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

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

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

的形成。

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

#### **7.4.13.2 信用风险**

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 BBB 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券(上年度末：无)。

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

##### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的债券。

##### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

##### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的债券。

##### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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

#### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
----------------------------	--------	--------	-------------	-------	-------	-----	----

资产							
银行存款	25,035,276.81	-	-	-	-	-	25,035,276.81
结算备付金	839,918.61	-	-	-	-	-	839,918.61
存出保证金	37,070.38	-	-	-	-	-	37,070.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-223,129,751.45	223,129,751.45
应收清算款	-	-	-	-	-	1,420,480.87	1,420,480.87
应收申购款	-	-	-	-	-	2.00	2.00
资产总计	25,912,265.80	-	-	-	-	-224,550,234.32	250,462,500.12
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	586,337.60	586,337.60
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,114.22	1,114.22
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	329,359.18	329,359.18
应付托管费	-	-	-	-	-	54,893.20	54,893.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	97,159.98	97,159.98
其他负债	-	-	-	-	-	725,472.44	725,472.44
负债总计	-	-	-	-	-	1,794,336.62	1,794,336.62
利率敏感度缺口	25,912,265.80	-	-	-	-	-222,755,897.70	248,668,163.50
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	34,347,072.29	-	-	-	-	-	34,347,072.29
结算备付金	2,033,382.80	-	-	-	-	-	2,033,382.80
存出保证金	93,769.31	-	-	-	-	-	93,769.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-309,585,208.97	309,585,208.97
应收证券清算款	-	-	-	-	-	975,340.87	975,340.87
其他资产	-	-	-	-	-	4,540.20	4,540.20
应收申购款	-	-	-	-	-	22,709.93	22,709.93
资产总计	36,474,224.40	-	-	-	-	-310,587,799.97	347,062,024.37
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,734,838.38	1,734,838.38
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	433,734.70	433,734.70
应付托管费	-	-	-	-	-	72,289.14	72,289.14
应付销售服务费	-	-	-	-	-	127,610.27	127,610.27
其他负债	-	-	-	-	-	1,802,228.41	1,802,228.41
负债总计	-	-	-	-	-	4,170,700.90	4,170,700.90
利率敏感度缺口	36,474,224.40	-	-	-	-	-306,417,099.07	342,891,323.47

注：以上比较信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的格式要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”项目的“本

期末”余额合并列示于 2022 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	223,129,751.45	89.73	309,585,208.97	90.29
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	223,129,751.45	89.73	309,585,208.97	90.29

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

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	13,232,059.62	18,286,523.43
	业绩比较基准下降 5%	-13,232,059.62	-18,286,523.43

## 7.4.14 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	222,221,274.05	308,384,198.00
第二层次	-	1,201,010.97
第三层次	908,477.40	-
合计	223,129,751.45	309,585,208.97

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

#### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			合计
	交易性金融资产			
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	-	-	-
当期购买	-	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	2,892,083.59	-	2,892,083.59
转出第三层次	-	1,869,851.13	-	1,869,851.13
当期利得或损失总额	-	-113,755.06	-	-113,755.06
其中：计入损益的利得或损失	-	-113,755.06	-	-113,755.06
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-	-

期末余额	-	908,477.40	-	908,477.40
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-113,755.06	-	-113,755.06
项目	上年度可比期间 2021年8月25日(基金合同生效日)至2021年12月31日			
	交易性金融资产			合计
	债券投资	股票投资	基金投资	
期初余额	-	-	-	-
当期购买	-	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-	-
转入第三层次	-	-	-	-
转出第三层次	-	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失(若有)	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-	-

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本基金转入/转出第三层次的交易性金融资产均为限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

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

-	-	-	-	-	-
---	---	---	---	---	---

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	223,129,751.45	89.09
	其中：股票	223,129,751.45	89.09
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	25,875,195.42	10.33
8	其他各项资产	1,457,553.25	0.58
9	合计	250,462,500.12	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,310,635.00	1.73
B	采矿业	7,650,012.00	3.08
C	制造业	150,394,498.43	60.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,874,597.00	1.96
E	建筑业	3,199,282.80	1.29
F	批发和零售业	2,919,863.00	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	3,431,469.00	1.38
H	住宿和餐饮业	307,520.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,805,720.18	3.54
J	金融业	20,604,391.31	8.29
K	房地产业	5,394,149.40	2.17
L	租赁和商务服务业	943,315.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	5,119,403.15	2.06

N	水利、环境和公共设施管理业	1,730,539.80	0.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,451,331.13	0.58
R	文化、体育和娱乐业	1,371,972.25	0.55
S	综合	621,052.00	0.25
	合计	223,129,751.45	89.73

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002850	科达利	18,400	2,186,104.00	0.88
2	300568	星源材质	96,400	2,049,464.00	0.82
3	002497	雅化集团	83,400	1,939,050.00	0.78
4	002192	融捷股份	19,700	1,928,630.00	0.78
5	300073	当升科技	34,000	1,917,600.00	0.77
6	688390	固德威	5,905	1,907,846.45	0.77
7	688063	派能科技	5,820	1,837,083.00	0.74
8	601012	隆基绿能	40,940	1,730,124.40	0.70
9	000878	云南铜业	143,400	1,684,950.00	0.68
10	300390	天华超净	30,000	1,676,400.00	0.67
11	688122	西部超导	16,897	1,599,976.93	0.64
12	002738	中矿资源	23,620	1,574,509.20	0.63
13	603613	国联股份	17,525	1,549,911.00	0.62
14	600160	巨化股份	99,500	1,543,245.00	0.62
15	601231	环旭电子	94,300	1,530,489.00	0.62
16	300373	扬杰科技	28,500	1,499,100.00	0.60
17	600563	法拉电子	9,300	1,486,884.00	0.60
18	002966	苏州银行	190,840	1,484,735.20	0.60
19	603127	昭衍新药	25,060	1,463,754.60	0.59
20	603260	合盛硅业	17,500	1,451,450.00	0.58
21	601666	平煤股份	131,900	1,425,839.00	0.57
22	002508	老板电器	49,800	1,382,448.00	0.56
23	300832	新产业	27,400	1,373,836.00	0.55
24	600499	科达制造	94,600	1,344,266.00	0.54

25	000498	山东路桥	195,400	1,342,398.00	0.54
26	000937	冀中能源	208,200	1,324,152.00	0.53
27	300363	博腾股份	32,400	1,323,540.00	0.53
28	002831	裕同科技	39,000	1,289,730.00	0.52
29	600580	卧龙电驱	102,900	1,282,134.00	0.52
30	600352	浙江龙盛	128,100	1,268,190.00	0.51
31	300003	乐普医疗	54,900	1,261,053.00	0.51
32	600566	济川药业	46,100	1,254,842.00	0.50
33	600988	赤峰黄金	69,100	1,247,255.00	0.50
34	002299	圣农发展	52,500	1,243,725.00	0.50
35	603876	鼎胜新材	30,300	1,243,512.00	0.50
36	300115	长盈精密	119,600	1,235,468.00	0.50
37	002124	天邦食品	202,200	1,235,442.00	0.50
38	300861	美畅股份	25,000	1,229,000.00	0.49
39	300724	捷佳伟创	10,600	1,208,612.00	0.49
40	300699	光威复材	16,300	1,177,675.00	0.47
41	002625	光启技术	68,700	1,169,274.00	0.47
42	002271	东方雨虹	34,100	1,144,737.00	0.46
43	600399	抚顺特钢	78,100	1,117,611.00	0.45
44	600008	首创环保	394,400	1,116,152.00	0.45
45	000733	振华科技	9,600	1,096,608.00	0.44
46	605128	上海沿浦	20,300	1,089,704.00	0.44
47	600895	张江高科	91,300	1,035,342.00	0.42
48	600438	通威股份	26,600	1,026,228.00	0.41
49	600597	光明乳业	94,900	1,021,124.00	0.41
50	603605	珀莱雅	6,060	1,014,928.80	0.41
51	688301	奕瑞科技	2,200	1,007,336.00	0.41
52	002048	宁波华翔	72,400	1,006,360.00	0.40
53	600030	中信证券	50,400	1,003,464.00	0.40
54	603267	鸿远电子	9,900	1,001,484.00	0.40
55	002080	中材科技	46,600	998,638.00	0.40
56	600901	江苏租赁	179,800	985,304.00	0.40
57	603737	三棵树	8,600	978,938.00	0.39
58	002812	恩捷股份	7,200	945,288.00	0.38
59	002430	杭氧股份	24,000	944,640.00	0.38
60	600021	上海电力	93,500	935,935.00	0.38
61	002074	国轩高科	32,400	934,092.00	0.38
62	688777	中控技术	10,273	933,096.59	0.38
63	600873	梅花生物	91,100	927,398.00	0.37

64	002384	东山精密	37,400	924,902.00	0.37
65	002714	牧原股份	18,900	921,375.00	0.37
66	000970	中科三环	67,500	920,700.00	0.37
67	603259	药明康德	11,300	915,300.00	0.37
68	300034	钢研高纳	19,700	903,048.00	0.36
69	300777	中简科技	18,200	894,530.00	0.36
70	300775	三角防务	23,100	877,800.00	0.35
71	603444	吉比特	2,800	875,952.00	0.35
72	600456	宝钛股份	21,200	866,232.00	0.35
73	002595	豪迈科技	37,200	861,180.00	0.35
74	300009	安科生物	91,200	853,632.00	0.34
75	002422	科伦药业	32,000	851,520.00	0.34
76	600096	云天化	40,300	847,912.00	0.34
77	300015	爱尔眼科	27,048	840,381.36	0.34
78	002304	洋河股份	5,200	834,600.00	0.34
79	000333	美的集团	16,100	833,980.00	0.34
80	603056	德邦股份	39,900	831,117.00	0.33
81	600809	山西汾酒	2,900	826,471.00	0.33
82	002945	华林证券	62,600	825,068.00	0.33
83	600820	隧道股份	156,100	822,647.00	0.33
84	600690	海尔智家	33,600	821,856.00	0.33
85	300760	迈瑞医疗	2,600	821,522.00	0.33
86	300136	信维通信	49,500	817,245.00	0.33
87	300696	爱乐达	30,240	802,267.20	0.32
88	300308	中际旭创	29,200	789,276.00	0.32
89	002985	北摩高科	17,458	787,355.80	0.32
90	600376	首开股份	137,600	782,944.00	0.31
91	688385	复旦微电	11,141	777,753.21	0.31
92	601869	长飞光纤	23,400	763,542.00	0.31
93	688239	航宇科技	9,828	763,537.32	0.31
94	000987	越秀资本	125,089	749,283.11	0.30
95	300750	宁德时代	1,900	747,498.00	0.30
96	002273	水晶光电	63,300	746,307.00	0.30
97	300012	华测检测	33,400	744,820.00	0.30
98	600521	华海药业	33,700	736,682.00	0.30
99	600378	昊华科技	17,100	733,761.00	0.30
100	603927	中科软	24,700	731,367.00	0.29
101	605123	派克新材	5,500	730,950.00	0.29
102	603678	火炬电子	17,800	728,732.00	0.29

103	300014	亿纬锂能	8,200	720,780.00	0.29
104	000728	国元证券	113,000	715,290.00	0.29
105	600377	宁沪高速	86,000	706,920.00	0.28
106	603355	莱克电气	25,200	706,608.00	0.28
107	600893	航发动力	16,300	689,164.00	0.28
108	300726	宏达电子	15,400	679,756.00	0.27
109	600926	杭州银行	51,500	673,620.00	0.27
110	601658	邮储银行	145,600	672,672.00	0.27
111	601881	中国银河	72,400	672,596.00	0.27
112	000001	平安银行	51,000	671,160.00	0.27
113	601166	兴业银行	38,100	670,179.00	0.27
114	603688	石英股份	5,100	669,732.00	0.27
115	002142	宁波银行	20,600	668,470.00	0.27
116	601009	南京银行	64,100	667,922.00	0.27
117	002807	江阴银行	168,100	667,357.00	0.27
118	600919	江苏银行	91,100	664,119.00	0.27
119	600908	无锡银行	125,800	662,966.00	0.27
120	600383	金地集团	63,500	649,605.00	0.26
121	000002	万科 A	35,400	644,280.00	0.26
122	688005	容百科技	9,291	638,756.25	0.26
123	600549	厦门钨业	32,543	636,215.65	0.26
124	002557	洽洽食品	12,500	625,000.00	0.25
125	601108	财通证券	87,300	621,576.00	0.25
126	600282	南钢股份	197,100	620,865.00	0.25
127	000932	华菱钢铁	131,600	618,520.00	0.25
128	002572	索菲亚	33,800	613,808.00	0.25
129	600704	物产中大	124,800	600,288.00	0.24
130	601211	国泰君安	44,100	599,319.00	0.24
131	601688	华泰证券	47,000	598,780.00	0.24
132	002507	涪陵榨菜	23,200	597,864.00	0.24
133	601577	长沙银行	87,700	592,852.00	0.24
134	300593	新雷能	13,800	586,224.00	0.24
135	688819	天能股份	15,890	583,798.60	0.23
136	603596	伯特利	7,300	582,540.00	0.23
137	603786	科博达	8,800	579,304.00	0.23
138	600863	内蒙华电	165,000	575,850.00	0.23
139	300070	碧水源	121,600	575,168.00	0.23
140	002030	达安基因	36,800	572,608.00	0.23
141	002468	申通快递	55,400	572,282.00	0.23

142	600435	北方导航	49,200	570,720.00	0.23
143	300244	迪安诊断	22,700	570,451.00	0.23
144	002244	滨江集团	64,600	570,418.00	0.23
145	688599	天合光能	8,946	570,396.96	0.23
146	002895	川恒股份	21,500	560,505.00	0.23
147	000893	亚钾国际	20,600	559,908.00	0.23
148	600048	保利发展	36,900	558,297.00	0.22
149	000792	盐湖股份	24,300	551,367.00	0.22
150	600131	国网信通	35,900	537,064.00	0.22
151	601555	东吴证券	81,900	534,807.00	0.22
152	002129	TCL 中环	14,000	527,240.00	0.21
153	603868	飞科电器	7,700	518,441.00	0.21
154	000513	丽珠集团	15,900	516,432.00	0.21
155	300604	长川科技	11,400	508,212.00	0.20
156	603456	九洲药业	11,900	504,917.00	0.20
157	603345	安井食品	3,100	501,828.00	0.20
158	300017	网宿科技	89,300	498,294.00	0.20
159	002459	晶澳科技	8,260	496,343.40	0.20
160	002867	周大生	35,300	495,259.00	0.20
161	000563	陕国投 A	161,300	488,739.00	0.20
162	600150	中国船舶	21,900	487,932.00	0.20
163	601989	中国重工	139,600	487,204.00	0.20
164	600927	永安期货	30,200	486,824.00	0.20
165	600699	均胜电子	34,500	484,725.00	0.19
166	002353	杰瑞股份	17,300	482,843.00	0.19
167	688567	孚能科技	17,752	479,836.56	0.19
168	000726	鲁泰 A	64,700	477,486.00	0.19
169	600968	海油发展	164,800	474,624.00	0.19
170	000415	渤海租赁	214,500	474,045.00	0.19
171	600885	宏发股份	14,004	467,873.64	0.19
172	000009	中国宝安	37,800	457,002.00	0.18
173	603858	步长制药	21,600	453,816.00	0.18
174	002368	太极股份	16,100	452,893.00	0.18
175	300207	欣旺达	21,100	446,265.00	0.18
176	600879	航天电子	60,000	408,000.00	0.16
177	600507	方大特钢	66,100	397,922.00	0.16
178	603658	安图生物	6,400	395,840.00	0.16
179	603315	福鞍股份	23,100	395,010.00	0.16
180	601098	中南传媒	39,300	392,214.00	0.16

181	600481	双良节能	30,300	392,082.00	0.16
182	002438	江苏神通	35,800	391,294.00	0.16
183	002141	贤丰控股	97,100	390,342.00	0.16
184	600037	歌华有线	47,900	389,906.00	0.16
185	603357	设计总院	42,800	388,624.00	0.16
186	600629	华建集团	88,400	388,076.00	0.16
187	600373	中文传媒	40,500	387,585.00	0.16
188	603018	华设集团	51,082	387,201.56	0.16
189	603612	索通发展	14,831	385,902.62	0.16
190	300787	海能实业	14,200	385,814.00	0.16
191	603095	越剑智能	17,400	385,584.00	0.16
192	300880	迦南智能	26,620	385,191.40	0.15
193	300035	中科电气	18,700	384,846.00	0.15
194	301004	嘉益股份	12,900	384,162.00	0.15
195	300514	友讯达	37,400	383,350.00	0.15
196	603995	甬金股份	13,719	381,799.77	0.15
197	000408	藏格矿业	14,700	381,759.00	0.15
198	002705	新宝股份	22,900	381,285.00	0.15
199	688196	卓越新能	6,570	381,191.40	0.15
200	002478	常宝股份	67,700	381,151.00	0.15
201	300639	凯普生物	22,600	380,810.00	0.15
202	300274	阳光电源	3,400	380,120.00	0.15
203	600958	东方证券	42,300	378,162.00	0.15
204	600884	杉杉股份	20,765	377,923.00	0.15
205	002756	永兴材料	4,100	377,897.00	0.15
206	002460	赣锋锂业	5,420	376,744.20	0.15
207	300890	翔丰华	9,300	376,650.00	0.15
208	300827	上能电气	6,400	376,576.00	0.15
209	603659	璞泰来	7,200	373,608.00	0.15
210	688772	珠海冠宇	19,500	363,480.00	0.15
211	601298	青岛港	63,200	354,552.00	0.14
212	600208	新湖中宝	138,000	350,520.00	0.14
213	601985	中国核电	58,300	349,800.00	0.14
214	000155	川能动力	19,500	347,880.00	0.14
215	601187	厦门银行	60,300	345,519.00	0.14
216	000807	云铝股份	29,600	329,152.00	0.13
217	301029	怡合达	5,000	328,700.00	0.13
218	300842	帝科股份	6,200	318,618.00	0.13
219	600710	苏美达	53,200	312,816.00	0.13

220	000729	燕京啤酒	29,300	311,166.00	0.13
221	600790	轻纺城	66,600	309,690.00	0.12
222	300037	新宙邦	7,080	307,767.60	0.12
223	600258	首旅酒店	12,400	307,520.00	0.12
224	600971	恒源煤电	42,600	305,016.00	0.12
225	600905	三峡能源	53,100	300,015.00	0.12
226	688116	天奈科技	3,800	293,132.00	0.12
227	601788	光大证券	19,500	289,965.00	0.12
228	601066	中信建投	12,200	289,750.00	0.12
229	600755	厦门国贸	40,200	287,028.00	0.12
230	603185	上机数控	2,680	283,678.00	0.11
231	601901	方正证券	44,400	283,272.00	0.11
232	600060	海信视像	20,900	282,986.00	0.11
233	300395	菲利华	4,950	272,250.00	0.11
234	300888	稳健医疗	3,800	271,700.00	0.11
235	600177	雅戈尔	41,700	263,961.00	0.11
236	688006	杭可科技	5,966	261,131.82	0.11
237	600981	汇鸿集团	89,600	258,944.00	0.10
238	601990	南京证券	32,100	254,553.00	0.10
239	300316	晶盛机电	4,000	254,240.00	0.10
240	600133	东湖高新	45,900	252,450.00	0.10
241	600881	亚泰集团	105,000	252,000.00	0.10
242	603113	金能科技	27,700	251,239.00	0.10
243	601615	明阳智能	9,800	247,548.00	0.10
244	000066	中国长城	23,700	241,740.00	0.10
245	601000	唐山港	87,700	240,298.00	0.10
246	600064	南京高科	36,340	240,207.40	0.10
247	000598	兴蓉环境	48,600	237,654.00	0.10
248	601156	东航物流	15,400	235,004.00	0.09
249	600732	爱旭股份	6,200	234,484.00	0.09
250	002624	完美世界	18,300	232,776.00	0.09
251	601518	吉林高速	78,800	229,308.00	0.09
252	688002	睿创微纳	6,050	224,999.50	0.09
253	000779	甘咨询	22,900	224,878.00	0.09
254	603009	北特科技	37,600	224,848.00	0.09
255	300232	洲明科技	40,800	223,992.00	0.09
256	600101	明星电力	26,300	223,550.00	0.09
257	603939	益丰药房	3,500	223,440.00	0.09
258	300531	优博讯	17,500	223,125.00	0.09

259	600731	湖南海利	29,900	223,054.00	0.09
260	603797	联泰环保	40,400	223,008.00	0.09
261	002268	卫士通	7,300	222,869.00	0.09
262	002938	鹏鼎控股	8,100	222,264.00	0.09
263	000014	沙河股份	21,800	222,142.00	0.09
264	300939	秋田微	8,200	221,728.00	0.09
265	300499	高澜股份	22,300	221,439.00	0.09
266	002955	鸿合科技	9,400	221,370.00	0.09
267	600330	天通股份	21,000	221,340.00	0.09
268	300902	国安达	8,000	221,280.00	0.09
269	603227	雪峰科技	26,600	220,514.00	0.09
270	300990	同飞股份	2,400	220,512.00	0.09
271	300357	我武生物	4,000	220,400.00	0.09
272	300230	永利股份	58,300	220,374.00	0.09
273	002250	联化科技	14,200	220,100.00	0.09
274	002318	久立特材	13,200	219,648.00	0.09
275	603806	福斯特	3,300	219,252.00	0.09
276	300951	博硕科技	4,600	218,960.00	0.09
277	002025	航天电器	3,300	218,625.00	0.09
278	300438	鹏辉能源	2,800	218,372.00	0.09
279	002960	青鸟消防	7,800	218,322.00	0.09
280	600909	华安证券	45,200	207,468.00	0.08
281	000738	航发控制	8,000	205,120.00	0.08
282	600482	中国动力	13,200	201,828.00	0.08
283	000519	中兵红箭	10,200	200,328.00	0.08
284	600785	新华百货	10,600	196,524.00	0.08
285	003816	中国广核	73,000	196,370.00	0.08
286	603589	口子窖	3,400	196,078.00	0.08
287	601995	中金公司	5,100	194,463.00	0.08
288	600143	金发科技	19,900	192,831.00	0.08
289	688200	华峰测控	688	190,211.36	0.08
290	002202	金风科技	17,100	188,100.00	0.08
291	300682	朗新科技	8,500	186,830.00	0.08
292	601878	浙商证券	18,800	186,684.00	0.08
293	601877	正泰电器	6,700	185,590.00	0.07
294	600906	财达证券	24,500	185,465.00	0.07
295	002465	海格通信	22,600	183,512.00	0.07
296	688766	普冉股份	1,200	182,340.00	0.07
297	600329	达仁堂	6,100	177,510.00	0.07

298	002414	高德红外	16,080	176,880.00	0.07
299	688053	思科瑞	2,797	172,183.32	0.07
300	688601	力芯微	3,040	171,425.60	0.07
301	300763	锦浪科技	950	171,047.50	0.07
302	600098	广州发展	30,800	170,940.00	0.07
303	002603	以岭药业	5,700	170,772.00	0.07
303	600206	有研新材	13,300	170,772.00	0.07
304	603199	九华旅游	6,000	170,580.00	0.07
305	600491	龙元建设	27,100	170,459.00	0.07
306	600449	宁夏建材	14,300	169,741.00	0.07
307	603003	龙宇燃油	23,000	169,740.00	0.07
308	688262	国芯科技	4,058	169,664.98	0.07
309	688589	力合微	4,987	168,660.34	0.07
310	688071	华依科技	2,979	168,343.29	0.07
311	603738	泰晶科技	8,300	168,324.00	0.07
312	002119	康强电子	14,700	168,021.00	0.07
313	300761	立华股份	4,900	167,825.00	0.07
314	600780	通宝能源	26,100	167,562.00	0.07
315	300523	辰安科技	8,000	166,960.00	0.07
316	000570	苏常柴 A	35,000	166,950.00	0.07
317	605151	西上海	8,800	166,760.00	0.07
318	600626	申达股份	46,300	166,680.00	0.07
319	002291	遥望科技	12,800	166,400.00	0.07
319	002772	众兴菌业	20,000	166,400.00	0.07
320	603086	先达股份	12,700	166,243.00	0.07
321	300830	金现代	21,400	166,064.00	0.07
322	300511	雪榕生物	25,700	165,765.00	0.07
323	688679	通源环境	15,306	165,457.86	0.07
324	603230	内蒙新华	15,000	165,450.00	0.07
325	600228	返利科技	23,100	165,396.00	0.07
326	603968	醋化股份	7,600	165,148.00	0.07
327	300889	爱克股份	12,900	165,120.00	0.07
328	600551	时代出版	16,200	164,916.00	0.07
329	603421	鼎信通讯	19,700	164,889.00	0.07
330	688585	上纬新材	20,581	164,853.81	0.07
331	603909	建发合诚	15,400	164,780.00	0.07
332	603586	金麒麟	12,500	164,750.00	0.07
333	600356	恒丰纸业	22,500	164,700.00	0.07
334	003043	华亚智能	2,700	164,673.00	0.07

335	603609	禾丰股份	13,900	164,576.00	0.07
336	688228	开普云	5,207	164,541.20	0.07
337	002169	智光电气	21,500	164,475.00	0.07
338	002736	国信证券	18,500	164,280.00	0.07
339	600256	广汇能源	18,200	164,164.00	0.07
340	300673	佩蒂股份	9,300	164,145.00	0.07
341	600805	悦达投资	38,600	164,050.00	0.07
342	688123	聚辰股份	1,620	163,944.00	0.07
343	300882	万胜智能	10,900	163,936.00	0.07
344	002947	恒铭达	8,300	163,925.00	0.07
345	600525	长园集团	35,000	163,800.00	0.07
345	603600	永艺股份	16,800	163,800.00	0.07
346	000700	模塑科技	35,300	163,792.00	0.07
347	300970	华绿生物	9,200	163,760.00	0.07
348	300972	万辰生物	13,600	163,744.00	0.07
349	002887	绿茵生态	19,300	163,664.00	0.07
350	300807	天迈科技	8,000	163,520.00	0.07
351	301216	万凯新材	5,700	163,476.00	0.07
352	688597	煜邦电力	10,860	163,334.40	0.07
353	002233	塔牌集团	23,000	163,300.00	0.07
354	002952	亚世光电	10,900	163,282.00	0.07
355	603031	安孚科技	3,500	163,275.00	0.07
356	300389	艾比森	18,700	163,251.00	0.07
357	603585	苏利股份	9,200	163,116.00	0.07
358	600681	百川能源	38,200	163,114.00	0.07
359	600777	新潮能源	74,800	163,064.00	0.07
360	603898	好莱客	14,400	163,008.00	0.07
361	688518	联赢激光	5,580	162,991.80	0.07
362	603083	剑桥科技	14,500	162,980.00	0.07
363	003036	泰坦股份	13,800	162,978.00	0.07
364	002976	瑞玛精密	7,200	162,936.00	0.07
365	603136	天目湖	6,000	162,900.00	0.07
366	600345	长江通信	10,500	162,855.00	0.07
367	605218	伟时电子	11,800	162,840.00	0.07
368	300864	南大环境	8,800	162,800.00	0.07
369	603800	道森股份	6,100	162,748.00	0.07
370	600469	风神股份	34,700	162,743.00	0.07
371	002225	濮耐股份	42,200	162,470.00	0.07
372	603519	立霸股份	14,700	162,435.00	0.07

373	600833	第一医药	14,400	162,432.00	0.07
374	300546	雄帝科技	7,600	162,336.00	0.07
375	688229	博睿数据	4,765	162,248.25	0.07
376	688517	金冠电气	14,114	162,169.86	0.07
377	605177	东亚药业	8,100	162,162.00	0.07
378	600173	卧龙地产	31,300	162,134.00	0.07
379	603059	倍加洁	8,500	162,095.00	0.07
380	603906	龙蟠科技	7,000	162,050.00	0.07
381	688616	西力科技	15,476	161,878.96	0.07
382	300615	欣天科技	14,400	161,856.00	0.07
383	002360	同德化工	23,000	161,690.00	0.07
384	688335	复洁环保	7,763	161,548.03	0.06
385	002674	兴业科技	14,900	161,069.00	0.06
386	300851	交大思诺	7,400	160,950.00	0.06
387	603890	春秋电子	17,600	160,864.00	0.06
388	301042	安联锐视	5,000	160,550.00	0.06
389	605196	华通线缆	23,000	160,540.00	0.06
390	688078	龙软科技	5,006	160,041.82	0.06
391	002152	广电运通	16,100	160,034.00	0.06
392	688011	新光光电	7,422	160,018.32	0.06
393	002258	利尔化学	8,900	159,844.00	0.06
394	300058	蓝色光标	31,600	159,580.00	0.06
395	301092	争光股份	5,900	158,946.00	0.06
396	688068	热景生物	2,600	158,340.00	0.06
397	002466	天齐锂业	2,000	157,980.00	0.06
398	002240	盛新锂能	4,200	157,458.00	0.06
399	603399	吉翔股份	11,300	155,940.00	0.06
400	688155	先惠技术	2,980	155,824.20	0.06
401	600118	中国卫星	7,200	155,160.00	0.06
402	002739	万达电影	11,000	154,000.00	0.06
403	688707	振华新材	3,400	152,830.00	0.06
404	002389	航天彩虹	7,300	150,161.00	0.06
405	688680	海优新材	809	149,907.70	0.06
406	002673	西部证券	24,600	149,814.00	0.06
407	601908	京运通	22,700	149,139.00	0.06
408	688560	明冠新材	3,200	148,160.00	0.06
409	002623	亚玛顿	4,900	147,686.00	0.06
410	600061	国投资本	23,100	147,609.00	0.06
411	000547	航天发展	15,700	147,423.00	0.06

412	688223	晶科能源	10,000	146,500.00	0.06
413	300118	东方日升	5,900	146,438.00	0.06
414	600271	航天信息	13,600	141,576.00	0.06
415	603712	七一二	3,800	132,696.00	0.05
416	601696	中银证券	12,400	131,068.00	0.05
417	601969	海南矿业	17,500	129,675.00	0.05
418	601198	东兴证券	15,800	121,976.00	0.05
419	601128	常熟银行	16,100	121,555.00	0.05
420	000887	中鼎股份	8,300	120,101.00	0.05
421	601665	齐鲁银行	28,800	120,096.00	0.05
422	688073	毕得医药	1,527	118,449.39	0.05
423	688322	奥比中光	5,511	117,659.85	0.05
424	600298	安琪酵母	2,500	113,050.00	0.05
425	002385	大北农	12,700	113,030.00	0.05
426	002690	美亚光电	4,700	112,330.00	0.05
427	002294	信立泰	3,400	111,690.00	0.04
428	600871	石化油服	56,400	111,672.00	0.04
429	300024	机器人	12,400	111,352.00	0.04
430	603228	景旺电子	5,500	111,320.00	0.04
431	600398	海澜之家	21,000	111,300.00	0.04
432	600369	西南证券	29,600	111,000.00	0.04
433	002372	伟星新材	5,200	110,968.00	0.04
434	601997	贵阳银行	20,200	110,898.00	0.04
435	003035	南网能源	19,500	110,565.00	0.04
436	688779	长远锂科	7,540	110,008.60	0.04
437	600348	华阳股份	7,700	109,725.00	0.04
438	603883	老百姓	2,700	109,269.00	0.04
439	002653	海思科	4,900	109,025.00	0.04
440	600685	中船防务	5,000	103,800.00	0.04
441	600562	国睿科技	6,100	103,395.00	0.04
442	601865	福莱特	3,100	103,261.00	0.04
443	300144	宋城演艺	7,000	102,200.00	0.04
444	601456	国联证券	8,700	97,875.00	0.04
445	002544	普天科技	5,800	97,382.00	0.04
446	002056	横店东磁	5,000	93,700.00	0.04
447	000906	浙商中拓	10,100	91,001.00	0.04
448	601668	中国建筑	16,600	90,138.00	0.04
449	600575	淮河能源	37,300	89,893.00	0.04
450	000900	现代投资	21,500	89,870.00	0.04

451	000600	建投能源	17,100	89,775.00	0.04
452	600510	黑牡丹	13,600	89,760.00	0.04
453	601186	中国铁建	11,600	89,668.00	0.04
454	600248	陕西建工	21,300	89,460.00	0.04
455	601992	金隅集团	35,200	89,408.00	0.04
456	601916	浙商银行	30,400	89,376.00	0.04
457	601818	光大银行	29,100	89,337.00	0.04
458	600496	精工钢构	22,600	89,270.00	0.04
459	002091	江苏国泰	10,500	89,250.00	0.04
460	600308	华泰股份	17,600	89,232.00	0.04
461	002061	浙江交科	16,800	89,040.00	0.04
462	600606	绿地控股	29,860	88,982.80	0.04
463	600028	中国石化	20,400	88,944.00	0.04
464	600362	江西铜业	5,100	88,893.00	0.04
465	000521	长虹美菱	21,100	88,831.00	0.04
466	600502	安徽建工	18,500	88,800.00	0.04
467	601898	中煤能源	10,300	88,786.00	0.04
468	600835	上海机电	7,900	88,638.00	0.04
469	600742	一汽富维	10,600	88,616.00	0.04
470	000910	大亚圣象	10,400	88,608.00	0.04
471	600528	中铁工业	11,600	88,508.00	0.04
472	000560	我爱我家	35,400	88,500.00	0.04
473	601857	中国石油	17,800	88,466.00	0.04
474	600894	广日股份	13,700	88,365.00	0.04
475	000950	重药控股	17,300	87,884.00	0.04
476	688598	金博股份	400	87,792.00	0.04
477	002487	大金重工	2,100	86,877.00	0.03
478	300910	瑞丰新材	700	86,317.00	0.03
479	600967	内蒙一机	10,400	85,904.00	0.03
480	000028	国药一致	2,600	85,514.00	0.03
481	688329	艾隆科技	2,239	85,328.29	0.03
482	300242	佳云科技	25,000	85,000.00	0.03
483	603099	长白山	7,700	83,622.00	0.03
484	300839	博汇股份	4,500	83,475.00	0.03
485	601375	中原证券	22,900	83,356.00	0.03
486	003011	海象新材	3,900	83,343.00	0.03
487	605296	神农集团	3,300	82,599.00	0.03
488	600202	哈空调	16,400	82,492.00	0.03
489	605599	菜百股份	8,100	82,458.00	0.03

490	300694	鑫湖股份	8,700	82,302.00	0.03
491	601326	秦港股份	29,900	82,225.00	0.03
492	600178	东安动力	13,600	82,144.00	0.03
493	603022	新通联	9,200	81,972.00	0.03
494	300407	凯发电气	11,400	81,852.00	0.03
495	002432	九安医疗	1,600	81,776.00	0.03
496	000680	山推股份	19,800	81,774.00	0.03
497	688559	海目星	1,409	81,496.56	0.03
498	300644	南京聚隆	5,900	81,479.00	0.03
499	000553	安道麦 A	9,000	81,450.00	0.03
500	002871	伟隆股份	6,200	81,406.00	0.03
501	300810	中科海讯	4,700	81,404.00	0.03
502	300913	兆龙互连	5,000	81,250.00	0.03
503	300717	华信新材	5,800	81,200.00	0.03
504	300968	格林精密	10,100	81,002.00	0.03
505	300371	汇中股份	7,200	81,000.00	0.03
505	600210	紫江企业	16,200	81,000.00	0.03
506	301090	华润材料	8,050	80,983.00	0.03
507	300570	太辰光	5,600	80,976.00	0.03
508	002442	龙星化工	16,000	80,960.00	0.03
509	301158	德石股份	5,100	80,835.00	0.03
510	300176	派生科技	13,500	80,730.00	0.03
511	605588	冠石科技	2,800	80,640.00	0.03
512	300907	康平科技	4,500	80,460.00	0.03
513	300963	中洲特材	5,300	80,454.00	0.03
514	600764	中国海防	3,500	80,360.00	0.03
515	603040	新坐标	4,700	80,276.00	0.03
516	002176	江特电机	4,500	78,525.00	0.03
517	601611	中国核建	9,900	75,240.00	0.03
518	002423	中粮资本	10,300	73,748.00	0.03
519	301311	昆船智能	4,126	72,272.97	0.03
520	688391	钜泉科技	745	71,393.35	0.03
521	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.03
522	300762	上海瀚讯	4,700	61,946.00	0.02
523	601698	中国卫通	5,200	59,384.00	0.02
524	688516	奥特维	290	58,290.00	0.02
525	300850	新强联	1,020	54,345.60	0.02
526	301290	东星医疗	1,432	53,169.44	0.02
527	300123	亚光科技	8,800	52,008.00	0.02

528	300900	广联航空	1,800	51,714.00	0.02
529	002935	天奥电子	1,970	51,200.30	0.02
530	600990	四创电子	1,590	47,382.00	0.02
531	601606	长城军工	4,500	46,800.00	0.02
532	300629	新劲刚	1,580	40,384.80	0.02
533	002338	奥普光电	1,800	40,122.00	0.02
534	300772	运达股份	2,660	39,554.20	0.02
535	301265	华新环保	3,063	37,059.46	0.01
536	600184	光电股份	3,200	35,840.00	0.01
537	301155	海力风电	400	34,940.00	0.01
538	000561	烽火电子	3,800	34,504.00	0.01
539	300581	晨曦航空	1,900	33,288.00	0.01
540	300527	中船应急	4,800	31,824.00	0.01
541	300424	航新科技	2,400	28,320.00	0.01
542	002933	新兴装备	900	28,179.00	0.01
543	301269	华大九天	303	26,627.64	0.01
544	301239	普瑞眼科	364	25,327.12	0.01
545	003009	中天火箭	600	23,670.00	0.01
546	300722	新余国科	910	23,268.70	0.01
547	301095	广立微	249	21,513.60	0.01
548	301327	华宝新能	121	21,414.58	0.01
549	301175	中科环保	3,435	20,610.00	0.01
550	300875	捷强装备	600	18,144.00	0.01
551	301367	怡和嘉业	89	18,034.07	0.01
552	301267	华夏眼科	221	15,171.65	0.01
553	688399	硕世生物	162	14,209.02	0.01
554	301230	泓博医药	269	13,248.25	0.01
555	301330	熵基科技	423	13,244.13	0.01
556	688298	东方生物	168	12,954.48	0.01
557	301338	凯格精机	257	12,613.56	0.01
558	301363	美好医疗	324	12,383.28	0.00
559	688489	三未信安	120	12,159.60	0.00
560	688060	云涌科技	191	11,173.50	0.00
561	301361	众智科技	517	11,058.63	0.00
562	301379	天山电子	438	10,792.32	0.00
563	301396	宏景科技	328	10,722.32	0.00
564	301121	紫建电子	213	10,603.14	0.00
565	301306	西测测试	251	10,584.67	0.00
566	301152	天力锂能	226	10,540.64	0.00

567	301391	卡莱特	129	10,535.43	0.00
568	301273	瑞晨环保	277	10,484.45	0.00
569	301277	新天地	379	10,259.53	0.00
570	301165	锐捷网络	319	10,179.29	0.00
571	301296	新巨丰	681	10,174.14	0.00
572	301132	满坤科技	401	9,812.47	0.00
573	301139	元道通信	385	9,736.65	0.00
574	301283	聚胶股份	189	9,710.82	0.00
575	301389	隆扬电子	562	9,666.40	0.00
576	301328	维峰电子	125	9,618.75	0.00
577	301223	中荣股份	525	9,539.25	0.00
578	301335	天元宠物	269	9,164.83	0.00
579	301339	通行宝	561	8,740.38	0.00
580	301365	矩阵股份	362	8,644.56	0.00
581	688668	鼎通科技	130	8,580.00	0.00
582	301171	易点天下	476	8,434.72	0.00
583	301227	森鹰窗业	284	8,372.32	0.00
584	301326	捷邦科技	227	8,315.01	0.00
585	301115	建科股份	345	8,293.80	0.00
586	301366	一博科技	180	8,161.20	0.00
587	301197	工大科雅	380	7,626.60	0.00
588	688188	柏楚电子	35	7,597.80	0.00
589	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
590	301282	金禄电子	297	7,496.28	0.00
591	301398	星源卓镁	255	7,486.80	0.00
592	301313	凡拓数创	247	7,276.62	0.00
593	688377	迪威尔	165	7,256.70	0.00
594	301176	逸豪新材	422	7,131.80	0.00
595	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
596	301359	东南电子	328	6,888.00	0.00
597	301349	信德新材	63	6,516.72	0.00
598	301388	欣灵电气	292	6,508.68	0.00
599	688508	芯朋微	100	6,481.00	0.00
600	301316	慧博云通	359	6,343.53	0.00
601	301318	维海德	152	6,342.96	0.00
602	301368	丰立智能	337	6,338.97	0.00
603	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
604	301319	唯特偶	115	6,138.70	0.00
605	688215	瑞晟智能	198	6,088.50	0.00

606	301276	嘉曼服饰	265	5,991.65	0.00
607	301270	汉仪股份	210	5,959.80	0.00
608	688217	睿昂基因	167	5,903.45	0.00
609	301231	荣信文化	275	5,607.25	0.00
610	301233	盛帮股份	158	5,416.24	0.00
611	688611	杭州柯林	102	4,422.72	0.00
612	301309	万得凯	178	4,353.88	0.00
613	688677	海泰新光	32	3,616.00	0.00
614	688278	特宝生物	90	3,503.70	0.00
615	688358	祥生医疗	88	3,027.20	0.00
616	688030	山石网科	154	2,996.84	0.00
617	688090	瑞松科技	115	2,806.00	0.00
618	688039	当虹科技	71	2,673.86	0.00
619	688069	德林海	100	2,580.00	0.00
620	688338	赛科希德	73	2,408.27	0.00
621	688618	三旺通信	30	2,397.00	0.00
622	688138	清溢光电	130	2,366.00	0.00
623	688058	宝兰德	57	2,329.02	0.00
624	688225	亚信安全	114	1,927.74	0.00
625	688219	会通股份	194	1,631.54	0.00
626	688159	有方科技	104	1,513.20	0.00
627	688260	昀冢科技	100	1,391.00	0.00
628	688369	致远互联	15	1,032.75	0.00
629	688330	宏力达	16	1,018.88	0.00
630	688004	博汇科技	38	787.36	0.00
631	688096	京源环保	48	579.36	0.00
632	688557	兰剑智能	17	575.45	0.00
633	688500	慧辰股份	23	545.10	0.00
634	688378	奥来德	10	505.00	0.00
635	688600	皖仪科技	18	449.64	0.00
636	688010	福光股份	18	351.00	0.00
637	688468	科美诊断	37	350.39	0.00
638	688633	星球石墨	6	268.20	0.00
639	688312	燕麦科技	15	232.65	0.00
640	688317	之江生物	5	167.00	0.00
641	688081	兴图新科	9	149.04	0.00
642	688183	生益电子	16	148.96	0.00
643	688097	博众精工	5	143.00	0.00
644	688150	莱特光电	6	116.10	0.00

645	688178	万德斯	6	104.64	0.00
646	688350	富淼科技	6	98.64	0.00
647	688099	晶晨股份	1	70.51	0.00
648	688088	虹软科技	3	67.53	0.00
649	688590	新致软件	7	67.06	0.00
650	688191	智洋创新	4	50.72	0.00
651	688466	金科环境	3	45.30	0.00
652	688360	德马科技	1	24.59	0.00
653	688321	微芯生物	1	21.98	0.00
654	688106	金宏气体	1	18.76	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000877	天山股份	10,933,962.00	3.19
2	300418	昆仑万维	10,888,452.79	3.18
3	600256	广汇能源	9,244,174.00	2.70
4	002271	东方雨虹	9,137,888.00	2.66
5	000937	冀中能源	7,667,396.00	2.24
6	688005	容百科技	7,523,208.53	2.19
7	600111	北方稀土	7,427,433.98	2.17
8	002508	老板电器	7,382,615.38	2.15
9	000970	中科三环	7,324,459.37	2.14
10	600392	盛和资源	7,163,050.00	2.09
11	002756	永兴材料	7,049,395.40	2.06
12	000983	山西焦煤	6,925,795.00	2.02
13	603486	科沃斯	6,882,501.00	2.01
14	002738	中矿资源	6,849,312.40	2.00
15	600160	巨化股份	6,742,825.00	1.97
16	600563	法拉电子	6,168,350.00	1.80
17	300037	新宙邦	6,002,480.20	1.75
18	002497	雅化集团	5,944,025.00	1.73
19	300363	博腾股份	5,874,800.25	1.71
20	600673	东阳光	5,783,679.00	1.69

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

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600256	广汇能源	12,763,295.49	3.72
2	300418	昆仑万维	11,989,882.00	3.50
3	000877	天山股份	11,036,227.96	3.22
4	000983	山西焦煤	8,780,902.90	2.56
5	000937	冀中能源	8,775,012.00	2.56
6	300750	宁德时代	8,461,479.00	2.47
7	300037	新宙邦	8,433,547.24	2.46
8	000970	中科三环	7,975,019.20	2.33
9	600141	兴发集团	7,831,536.00	2.28
10	600392	盛和资源	7,717,025.00	2.25
11	688005	容百科技	7,709,972.87	2.25
12	603077	和邦生物	7,647,523.00	2.23
13	601012	隆基绿能	7,560,069.40	2.20
14	000988	华工科技	7,392,927.00	2.16
15	000733	振华科技	7,185,157.00	2.10
16	601615	明阳智能	7,182,159.00	2.09
17	002271	东方雨虹	7,093,141.25	2.07
18	600884	杉杉股份	6,733,619.42	1.96
19	000519	中兵红箭	6,665,060.00	1.94
20	600111	北方稀土	6,587,649.97	1.92

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

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,025,380,971.57
卖出股票收入（成交）总额	2,072,239,758.72

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

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

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

考虑相关交易费用。

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

本报告期末本基金未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

本报告期内，本基金未投资于股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

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

本报告期内，本基金未投资于国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未投资于国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

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

无。

**8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定股票库之内的股票。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	37,070.38
2	应收清算款	1,420,480.87
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,457,553.25

**8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本报告期末本基金未持有债券。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限股票。

**8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中航量化阿尔法六个月持有 A	806	95,791.99	1,422.51	0.00%	77,206,917.56	100.00%
中航量化阿尔法六个月持有 C	1,548	140,302.62	-	-	217,188,462.10	100.00%
合计	2,354	125,062.36	1,422.51	0.00%	294,395,379.66	100.00%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	598,033.82	0.77%
	中航量化阿尔法六个月持有 C	1,900,020.00	0.87%
	合计	2,498,053.82	0.85%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

	中航量化阿尔法六个月持有 C	>100
	合计	>100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航量化阿尔法六 个月持有 A	中航量化阿尔法六 个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 25 日）基金 份额总额	74,904,100.76	254,269,492.63
本报告期期初基金份额总额	91,643,376.51	255,251,214.05
本报告期基金总申购份额	590,893.93	661,193.45
减:本报告期基金总赎回份额	15,025,930.37	38,723,945.40
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	77,208,340.07	217,188,462.10

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 基金管理人：本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。
2. 基金托管人托管部门：自 2022 年 07 月 15 日起，孙乐女士担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

无。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未更换会计师事务所，本年度应支付给天职会计师事务所（特殊普通合伙）报酬为 27,000.00 元；截至 2022 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供 2 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券股份有限公司	2	1,032,198,821.84	25.36%	754,836.66	25.36%	-
东方财富证券股份有限公司	1	935,437,400.78	22.98%	684,100.33	22.98%	-

中航证券有限公司	2	797,415,772.57	19.59%	583,145.08	19.59%	-
广发证券股份有限公司	2	769,171,728.43	18.90%	562,483.83	18.90%	-
国盛证券有限责任公司	2	536,014,393.97	13.17%	391,994.59	13.17%	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

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

2：交易单元的选择标准和程序

(1) 实力雄厚，信誉良好；

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

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

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

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

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

3：本报告期内本基金新增租用 4 个交易单元，注销 2 个交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

限公司						
广发证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 14 日
2	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 21 日
3	中航基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 28 日
4	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 28 日
5	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 16 日
6	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 18 日
7	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2021 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 30 日
8	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 21 日
9	中航基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 11 日
10	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 30 日
11	中航量化阿尔法六个月持有	管理人网站、中国证监会基金	2022 年 7 月 20 日

	期股票型证券投资基金 2022 年第 2 季度报告	电子披露网站	
12	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金更新的招募说明书（2022 年第 1 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 8 月 24 日
13	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 8 月 24 日
14	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2022 年中期报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 8 月 30 日
15	中航基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“中航基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 9 月 6 日
16	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 25 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 存放地点

中航基金管理有限公司,地址:北京市朝阳区天辰东路1号北京亚洲金融大厦B座1001、1007、1008单元

### 13.3 查阅方式

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

中航基金管理有限公司

2023年3月30日