

创金合信量化核心混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：创金合信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 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、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。本中期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 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|----|
| §1 重要提示及目录..... | 1 |
| 1.1 重要提示..... | 1 |
| 1.2 目录..... | 2 |
| §2 基金简介..... | 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..... | 4 |
| 2.4 信息披露方式..... | 5 |
| 2.5 其他相关资料..... | 5 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现..... | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| §4 管理人报告..... | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明..... | 8 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 9 |
| 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..... | 9 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 9 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 10 |
| 4.8 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..... | 10 |
| §5 托管人报告..... | 10 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明..... | 10 |
| 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..... | 10 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 10 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计）..... | 11 |
| 6.1 资产负债表..... | 11 |
| 6.2 利润表..... | 12 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 13 |
| 6.4 报表附注..... | 15 |
| §7 投资组合报告..... | 35 |
| 7.1 报告期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 35 |
| 7.3 报告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..... | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 58 |
| 7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 63 |
| 7.6 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债券投资明细..... | 63 |
| 7.7 报告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..... | 64 |
| 7.8 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..... | 64 |
| 7.9 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权证投资明细..... | 64 |

| | |
|---|----|
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 64 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 64 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 64 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 65 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 65 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 65 |
| 8.3 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..... | 66 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 66 |
| §10 重大事件揭示..... | 66 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 66 |
| 10.2 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..... | 66 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 67 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 67 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 67 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 67 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 67 |
| 10.8 其他重大事件..... | 70 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 70 |
| 11.1 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..... | 70 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 71 |
| §12 备查文件目录..... | 71 |
| 12.1 备查文件目录..... | 71 |
| 12.2 存放地点..... | 71 |
| 12.3 查阅方式..... | 72 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---------------------|-------------------|-----------------|
| 基金名称 | 创金合信量化核心混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 创金合信量化核心混合 | |
| 基金主代码 | 004359 | |
| 交易代码 | 004359 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2017 年 3 月 27 日 | |
| 基金管理人 | 创金合信基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 35,785,372.76 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 创金合信量化核心混合 A | 创金合信量化核心混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004359 | 004360 |
| 报告期末下属分级基金的份 额总额 | 17,759,270.01 份 | 18,026,102.75 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在控制风险的同时，追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将采取定量与定性相结合的方法，运用“自上而下”的资产配置逻辑，形成对大类资产预期收益及风险的判断，进而确定资产配置的具体比例。其中，本基金在进行资产配置决策时将主要考虑宏观经济、政策预期、产业经济、市场情绪、投资者行为等因素。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×80%+中债综合财富（总值）指数收益率×20% |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，长期来看，其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 |

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 | 创金合信基金管理有限 公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 奚胜田 |
| | 联系电话 | 0755-82820166 |
| | 电子邮箱 | xishengtian@cjhxfund.c om |
| 客户服务电话 | 400-868-0666 | 95588 |
| 传真 | 0755-25832571 | 010-66105798 |
| 注册地址 | 深圳市前海深港合作区 前湾一路 1 号 A 栋 201 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |

| | | |
|-------|---|-------------------|
| | 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司） | |
| 办公地址 | 深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | 518052 | 100140 |
| 法定代表人 | 钱龙海 | 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 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | www.cjhxfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------|--|
| 注册登记机构 | 创金合信基金管理有限公司 | 深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

1、创金合信量化核心混合 A

| | |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 160,988.04 |
| 本期利润 | 188,177.24 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0120 |
| 本期加权平均净值利润率 | 0.74% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.29% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 10,194,089.11 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.5740 |
| 期末基金资产净值 | 27,953,359.12 |
| 期末基金份额净值 | 1.5740 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 65.43% |

2、创金合信量化核心混合 C

| | |
|---------------|---------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 95,766.47 |
| 本期利润 | 957,767.15 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1134 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.43% |
| 本期基金份额净值增长率 | 0.90% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 8,823,724.16 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.4895 |
| 期末基金资产净值 | 26,849,826.91 |
| 期末基金份额净值 | 1.4895 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 56.65% |

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

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

3. 期末可供分配利润是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

创金合信量化核心混合 A

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.88% | 0.78% | 1.02% | 0.70% | 0.86% | 0.08% |
| 过去三个月 | -2.57% | 0.74% | -3.79% | 0.66% | 1.22% | 0.08% |
| 过去六个月 | 1.29% | 0.75% | -0.02% | 0.67% | 1.31% | 0.08% |
| 过去一年 | -12.09% | 0.95% | -10.74% | 0.79% | -1.35% | 0.16% |
| 过去三年 | 18.07% | 1.18% | -3.23% | 0.96% | 21.30% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 65.43% | 1.10% | 16.08% | 0.96% | 49.35% | 0.14% |

创金合信量化核心混合 C

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

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一个月 | 1.83% | 0.77% | 1.02% | 0.70% | 0.81% | 0.07% |
| 过去三个月 | -2.76% | 0.74% | -3.79% | 0.66% | 1.03% | 0.08% |
| 过去六个月 | 0.90% | 0.75% | -0.02% | 0.67% | 0.92% | 0.08% |
| 过去一年 | -12.81% | 0.95% | -10.74% | 0.79% | -2.07% | 0.16% |
| 过去三年 | 15.22% | 1.18% | -3.23% | 0.96% | 18.45% | 0.22% |
| 自基金合同生效起至今 | 56.65% | 1.10% | 16.08% | 0.96% | 40.57% | 0.14% |

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

创金合信量化核心混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年03月27日-2023年06月30日)



创金合信量化核心混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年03月27日-2023年06月30日)



§ 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

创金合信基金管理有限公司于 2014 年 7 月 3 日获得中国证监会批复，2014 年 7 月 9 日正式注册设立，注册地为深圳市。公司注册资本 26,096 万元人民币。目前公司股东为第一创业证券股份有限公司，出资比例 51.072961%；深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙），出资比例 23.287094%；深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.47195%；深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.160791%；深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.490956%；深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙），出资比例 3.969957%；深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.910331%；深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙），出资比例 4.63596%。

公司始终坚持“客户利益至上”，致力于为客户实现长期稳定的投资回报，做客户投资理财的亲密伙伴。

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 | | |
| 马超 | 本基金基金经理 | 2021 年 12 月 1 日 | - | 5 | 马超先生，中国国籍，中国人民大学硕士。2017 年 6 月加入创金合信基金管理有限公司，历任量化指数与国际部（原名量化投资部国际投资部）量化分析师、投资经理，2018 年 6 月加入珠海宽德投资管理有限公司，任投资部投资经理，2021 年 10 月加入创金合信基金管理有限公司，现任量化指数与国际部总监助理、基金经理。 |

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，离任日期、后任基金经理的任职日期指公司作出决定的日期；

2、证券从业年限的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、本基金基金合同和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，未发

现损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律、法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见(2011年修订)》，通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程、强化事后监控及分析手段等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合，切实防范利益输送。本报告期，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股市场经历了一季度的上涨和二季度的调整，上半年主流宽基指数中，沪深300下跌0.75%、中证500上涨2.29%、中证1000上涨5.10%、创业板指下跌5.61%。上半年，美联储的加息预期反复扰动，全球地缘局势亦有反复，国内经济持续回升，经济增长展现了极强的韧性，基本面长期向好。

本基金以客观数据与量化统计建模结果为依据，综合公司基本面、估值便宜程度、价量指标、事件机会等自下而上对股票做出综合评价，同时结合风险模型与最优化方法自上而下控制组合整体的收益风险配比，持股分散，力争能够获得长期的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末创金合信量化核心混合A基金份额净值为1.5740元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.29%，同期业绩比较基准收益率为-0.02%；截至本报告期末创金合信量化核心混合C基金份额净值为1.4895元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.90%，同期业绩比较基准收益率为-0.02%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美联储的加息或进入尾声，但仍需警惕潜在的经济与通胀数据扰动带来的预期变化。同时，亦需持续关注国际地缘局势的边际变化。从国内来看，中国经济的韧性很强，基本面长期向好，流动性合理充裕，中国股票市场的长期基本面很扎实。行业配置上，均衡的配置相对集中配置性价比更高，其中基本面有支撑且前期调整较多的新能源、医药，以及中长期持续向好的科技行业值得关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配，符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本财务报告批准报出日，本基金已出现连续六十个工作日基金资产净值低于五千万万元的情形，根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，本基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对创金合信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------|---------------------|-----------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 2,113,109.41 | 519,432.14 |
| 结算备付金 | | 472,117.74 | 1,183,336.07 |
| 存出保证金 | | 24,398.18 | 13,193.83 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 53,184,624.64 | 42,144,952.25 |
| 其中：股票投资 | | 50,655,379.37 | 39,991,571.82 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 2,529,245.27 | 2,153,380.43 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | 307,291.59 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 24,471.06 | 12,962.20 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 55,818,721.03 | 44,181,168.08 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 599,789.04 | 1,400,631.90 |
| 应付清算款 | | 194,133.02 | 347,189.53 |

| | | | |
|----------|---------|---------------|---------------|
| 应付赎回款 | | 82,322.03 | 7,731.85 |
| 应付管理人报酬 | | 50,282.34 | 50,348.10 |
| 应付托管费 | | 8,380.37 | 8,391.34 |
| 应付销售服务费 | | 9,676.22 | 12,271.13 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | 121.35 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 70,951.98 | 88,267.45 |
| 负债合计 | | 1,015,535.00 | 1,914,952.65 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 35,785,372.76 | 27,912,284.29 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 19,017,813.27 | 14,353,931.14 |
| 净资产合计 | | 54,803,186.03 | 42,266,215.43 |
| 负债和净资产总计 | | 55,818,721.03 | 44,181,168.08 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，创金合信量化核心混合 A 份额净值 1.5740 元，基金份额总额 17,759,270.01 份；创金合信量化核心混合 C 份额净值 1.4895 元，基金份额总额 18,026,102.75 份；总份额合计 35,785,372.76 份。

6.2 利润表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|---------------------------------------|---|
| 一、营业总收入 | | 1,611,767.16 | 853,251.16 |
| 1.利息收入 | | 9,181.96 | 2,949.99 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 7,924.70 | 2,949.99 |
| 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 | | 1,257.26 | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 646,966.90 | 370,523.40 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 303,914.12 | 237,108.86 |
| 基金投资收益 | | - | - |

| | | | |
|-------------------------------|------------|--------------|------------|
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 21,216.81 | 22,464.64 |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | 32,492.97 | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 289,343.00 | 110,949.90 |
| 以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 889,189.88 | 479,229.81 |
| 4.汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-” 号填列） | 6.4.7.17 | 66,428.42 | 547.96 |
| 减：二、营业总支出 | | 465,822.77 | 236,086.73 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 285,357.24 | 145,810.35 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 47,559.55 | 24,301.81 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 51,022.07 | 24,398.22 |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 11,709.46 | 2,726.56 |
| 其中：卖出回购金融资产 支出 | | 11,709.46 | 2,726.56 |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7.税金及附加 | | 139.16 | - |
| 8.其他费用 | 6.4.7.19 | 70,035.29 | 38,849.79 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | 1,145,944.39 | 617,164.43 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | 1,145,944.39 | 617,164.43 |
| 五、其他综合收益的税后 净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 1,145,944.39 | 617,164.43 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：创金合信量化核心混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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） | 27,912,284.29 | - | 14,353,931.14 | 42,266,215.43 |
| 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） | 27,912,284.29 | - | 14,353,931.14 | 42,266,215.43 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 7,873,088.47 | - | 4,663,882.13 | 12,536,970.60 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 1,145,944.39 | 1,145,944.39 |
| （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） | 7,873,088.47 | - | 3,517,937.74 | 11,391,026.21 |
| 其中：1.基金申购款 | 29,262,778.00 | - | 15,566,446.28 | 44,829,224.28 |
| 2.基金赎回款 | -21,389,689.53 | - | -12,048,508.54 | -33,438,198.07 |
| （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） | 35,785,372.76 | - | 19,017,813.27 | 54,803,186.03 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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） | 12,001,566.52 | - | 8,562,904.22 | 20,564,470.74 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净 | 12,001,566.52 | - | 8,562,904.22 | 20,564,470.74 |

| | | | | |
|--|---------------|---|--------------|---------------|
| 资产（基金净值） | | | | |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 210,048.34 | - | 774,412.63 | 984,460.97 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 617,164.43 | 617,164.43 |
| （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） | 210,048.34 | - | 157,248.20 | 367,296.54 |
| 其中：1.基金申购款 | 1,368,270.02 | - | 844,308.01 | 2,212,578.03 |
| 2.基金赎回款 | -1,158,221.68 | - | -687,059.81 | -1,845,281.49 |
| （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） | 12,211,614.86 | - | 9,337,316.85 | 21,548,931.71 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____苏彦祝____ ____奚胜田____ ____吉祥____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

创金合信量化核心混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]5号《关于准予创金合信量化核心混合型证券投资基金注册的批复》核准,由创金合信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币801,695,744.90元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第116号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《创金合信量化核心混合型证券

投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 801,997,731.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 301,986.89 份基金份额。本基金的基金管理人为创金合信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）。

根据《创金合信量化核心混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与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/申购费用的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、金融衍生品（包括权证、股指期货、股票期权等）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相关规定）。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中债综合财富（总值）指数收益率×20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)

的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------|
| 活期存款 | 2,113,109.41 |
| 等于：本金 | 2,112,817.73 |
| 加：应计利息 | 291.68 |
| 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 | 2,113,109.41 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------|
|----|---------------------|

| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
|---------------|---------------|--------------|---------------|-------------|
| 股票 | 50,884,268.50 | - | 50,655,379.37 | -228,889.13 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 2,498,188.00 | 2,529,245.27 | 4,222.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | 2,498,188.00 | 2,529,245.27 | 4,222.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 53,382,456.50 | 26,835.27 | 53,184,624.64 | -224,667.13 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 107.81 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 10,222.88 |
| 其中：交易所市场 | 10,222.88 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 60,621.29 |
| 合计 | 70,951.98 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 创金合信量化核心混合 A | | |
|---------------|------------------------------------|---------------|
| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 13,649,124.70 | 13,649,124.70 |
| 本期申购 | 7,937,612.98 | 7,937,612.98 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,827,467.67 | -3,827,467.67 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 17,759,270.01 | 17,759,270.01 |

| 创金合信量化核心混合 C | | |
|---------------|------------------------------------|----------------|
| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 14,263,159.59 | 14,263,159.59 |
| 本期申购 | 21,325,165.02 | 21,325,165.02 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -17,562,221.86 | -17,562,221.86 |
| 基金份额折算变动份额 | - | - |
| 本期末 | 18,026,102.75 | 18,026,102.75 |

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 创金合信量化核心混合 A | | | |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 14,315,754.91 | -6,754,458.39 | 7,561,296.52 |
| 本期利润 | 160,988.04 | 27,189.20 | 188,177.24 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 4,523,041.65 | -2,078,426.30 | 2,444,615.35 |
| 其中：基金申购款 | 8,747,778.93 | -3,969,236.05 | 4,778,542.88 |
| 基金赎回款 | -4,224,737.28 | 1,890,809.75 | -2,333,927.53 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 18,999,784.60 | -8,805,695.49 | 10,194,089.11 |

| 创金合信量化核心混合 C | | | |
|----------------|----------------|----------------|---------------|
| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
| 上年度末 | 13,593,284.76 | -6,800,650.14 | 6,792,634.62 |
| 本期利润 | 95,766.47 | 862,000.68 | 957,767.15 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 3,745,532.11 | -2,672,209.72 | 1,073,322.39 |
| 其中：基金申购款 | 21,126,292.62 | -10,338,389.22 | 10,787,903.40 |
| 基金赎回款 | -17,380,760.51 | 7,666,179.50 | -9,714,581.01 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 17,434,583.34 | -8,610,859.18 | 8,823,724.16 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 2,316.65 |
| 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 | 5,427.51 |
| 其他 | 180.54 |
| 合计 | 7,924.70 |

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------|------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 303,914.12 |
| 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 | 303,914.12 |

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 350,530,209.19 |
| 减：卖出股票成本总额 | 349,801,020.93 |
| 减：交易费用 | 425,274.14 |
| 买卖股票差价收入 | 303,914.12 |

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------------------------|------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 16,584.46 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 4,632.35 |
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 21,216.81 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------------------|
|----|------------------------------------|

| | |
|------------------------|--------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,788,729.34 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,752,600.88 |
| 减：应计利息总额 | 31,494.63 |
| 减：交易费用 | 1.48 |
| 买卖债券差价收入 | 4,632.35 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------|--|
| 期货投资 | 32,492.97 |

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 289,343.00 |
| 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 | 289,343.00 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 889,189.88 |
| ——股票投资 | 882,809.00 |
| ——债券投资 | 6,380.88 |
| ——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 | 889,189.88 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 66,358.85 |
| 转换费收入 | 69.57 |
| 合计 | 66,428.42 |

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|---------|------------------------------------|
| 审计费用 | 17,356.09 |
| 信息披露费 | 33,965.20 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 114.00 |
| 账户维护费 | 18,000.00 |
| 查询服务费 | 600.00 |
| 合计 | 70,035.29 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期不存在重大关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

| | |
|--------------------|---------------------|
| 创金合信基金管理有限公司 | 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 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 深圳市金合信投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合中投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合华投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合振投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合兴投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合同投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |
| 深圳市金合荣投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人的股东 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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 |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | 163,194,108.89 | 50.50% |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|--------------|------------------------------------|--------------|---|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | 1,586,120.80 | 76.69% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|--------------|------------------------------------|----------------|---|----------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | 6,500,000.00 | 51.38% |

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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 |
| 第一创业证券股份有限公司 | - | - | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 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 |
| 第一创业证券股份有限公司 | 3,440.66 | 12.43% | 1,305.22 | 31.67% |

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 285,357.24 | 145,810.35 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 99,975.52 | 64,805.77 |

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 47,559.55 | 24,301.81 |

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|---|--------------|-----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 创金合信量化核心混合 A | 创金合信量化核心混合 C | 合计 |
| 创金合信直销 | - | 1,750.05 | 1,750.05 |
| 中国工商银行 | - | 14,898.11 | 14,898.11 |
| 合计 | - | 16,648.16 | 16,648.16 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 创金合信量化核心混合 A | 创金合信量化核心混合 C | 合计 |
| 创金合信直销 | - | - | - |
| 中国工商银行 | - | 12,049.36 | 12,049.36 |
| 合计 | - | 12,049.36 | 12,049.36 |

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给创金合信基金管理有限公司，再由创金合信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费=前一日 C 类基金份额基金资产净值×0.8%/当年天数。

6.4.10.3 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无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 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

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---------------------|------------------------------------|--------------|
| | 创金合信量化核心混合 A | 创金合信量化核心混合 C |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期内申购/买入总份额 | 6,215,964.19 | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 6,215,964.19 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 35.00% | - |

| 项目 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------------|---|--------------|
| | 创金合信量化核心混合 A | 创金合信量化核心混合 C |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期内申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期内因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | - |

6.4.10.5.2 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无除管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|--------------|------------------------------------|----------|---|----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 2,113,109.41 | 2,316.65 | 308,226.99 | 1,103.48 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 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均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 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作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

| 6.4.12.1.1 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 |
| 601916 | 浙商银行 | 2023 年 6 月 27 日 | 1 个月内（含） | 配股未上市 | 2.02 | 2.64 | 53,670 | 108,413.40 | 141,688.80 | - |
| 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券 | | | | | | | | | | |
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：张） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 127087 | 星帅转 2 | 2023 年 6 月 14 日 | 1-6 个月（含） | 新债未上市 | 100.00 | 100.01 | 11 | 1,100.00 | 1,100.12 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期 2023 年 6 月 30 日止基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 599,789.04 元，于 2023 年 7 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风控与审计委员会为核心的、由督察长、风险控制办公会、合规与风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所（场内）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，违约风险很小；在银行间同业市场或其他场外市场进行交易前均对交易对手和债券资质进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 2,324,116.22 | 1,951,710.46 |
| 合计 | 2,324,116.22 | 1,951,710.46 |

未评级债券包括国债、政策性金融债、超短期融资券以及无第三方评级机构短期债项评级的其他债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|---------------------|-----------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | 1,100.12 | - |
| 未评级 | 204,028.93 | 201,669.97 |
| 合计 | 205,129.05 | 201,669.97 |

未评级债券包括国债、政策性金融债以及无第三方评级机构债项评级的其他债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 600,087.13 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流

通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|--------------|-------|----------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 2,113,109.41 | - | - | - | 2,113,109.41 |
| 结算备付金 | 472,117.74 | - | - | - | 472,117.74 |
| 存出保证金 | 24,398.18 | - | - | - | 24,398.18 |
| 交易性金融资产 | 2,528,145.15 | - | 1,100.12 | 50,655,379.37 | 53,184,624.64 |
| 应收申购款 | - | - | - | 24,471.06 | 24,471.06 |
| 资产总计 | 5,137,770.48 | - | 1,100.12 | 50,679,850.43 | 55,818,721.03 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 599,789.04 | - | - | - | 599,789.04 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 82,322.03 | 82,322.03 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 50,282.34 | 50,282.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | 8,380.37 | 8,380.37 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 9,676.22 | 9,676.22 |
| 应付清算款 | - | - | - | 194,133.02 | 194,133.02 |
| 其他负债 | - | - | - | 70,951.98 | 70,951.98 |
| 负债总计 | 599,789.04 | - | - | 415,745.96 | 1,015,535.00 |
| 利率敏感度缺口 | 4,537,981.44 | - | 1,100.12 | 50,264,104.47 | 54,803,186.03 |
| 上年度末 2022 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 | 519,432.14 | - | - | - | 519,432.14 |
| 结算备付金 | 1,183,336.07 | - | - | - | 1,183,336.07 |
| 存出保证金 | 13,193.83 | - | - | - | 13,193.83 |
| 交易性金融资产 | 2,153,380.43 | - | - | 39,991,571.82 | 42,144,952.25 |
| 应收申购款 | - | - | - | 12,962.20 | 12,962.20 |
| 应收清算款 | - | - | - | 307,291.59 | 307,291.59 |
| 资产总计 | 3,869,342.47 | - | - | 40,311,825.61 | 44,181,168.08 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 1,400,631.90 | - | - | - | 1,400,631.90 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 7,731.85 | 7,731.85 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 50,348.10 | 50,348.10 |
| 应付托管费 | - | - | - | 8,391.34 | 8,391.34 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 12,271.13 | 12,271.13 |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 应交税费 | - | - | - | 121.35 | 121.35 |
| 应付清算款 | - | - | - | 347,189.53 | 347,189.53 |
| 其他负债 | - | - | - | 88,267.45 | 88,267.45 |
| 负债总计 | 1,400,631.90 | - | - | 514,320.75 | 1,914,952.65 |
| 利率敏感度缺口 | 2,468,710.57 | - | - | 39,797,504.86 | 42,266,215.43 |

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|-----------------|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 1.市场利率平行上升25个基点 | -2,588.19 | -1,262.24 |
| 2.市场利率平行下降25个基点 | 2,598.03 | 1,266.91 | |

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无外汇风险的敏感性分析。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
|----|---------------------|-------|-----------------------|-------|
| | 公允价值 | 占基金资产 | 公允价值 | 占基金资产 |
| | | | | |

| | | 净值比例 (%) | | 净值比例 (%) |
|-------------------|---------------|-------------|---------------|----------|
| 交易性金融资产- 股票投资 | 50,655,379.37 | 92.43 | 39,991,571.82 | 94.62 |
| 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 | 50,655,379.37 | 92.43 | 39,991,571.82 | 94.62 |

6.4.13.4.3.2 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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 1.业绩比较基准上升 5% | 2,412,209.17 | 2,070,763.59 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -2,412,209.17 | -2,070,763.59 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------|
| 第一层次 | 50,655,379.37 |
| 第二层次 | 2,529,245.27 |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 53,184,624.64 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 50,655,379.37 | 90.75 |
| | 其中：股票 | 50,655,379.37 | 90.75 |
| 2 | 固定收益投资 | 2,529,245.27 | 4.53 |
| | 其中：债券 | 2,529,245.27 | 4.53 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,585,227.15 | 4.63 |
| 7 | 其他资产 | 48,869.24 | 0.09 |
| 8 | 合计 | 55,818,721.03 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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 | 190,701.00 | 0.35 |
| B | 采矿业 | 1,211,002.00 | 2.21 |
| C | 制造业 | 29,868,863.67 | 54.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,522,347.00 | 2.78 |
| E | 建筑业 | 1,328,270.00 | 2.42 |
| F | 批发和零售业 | 1,659,332.00 | 3.03 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,241,114.00 | 2.26 |
| H | 住宿和餐饮业 | 36,350.00 | 0.07 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,229,167.60 | 7.72 |
| J | 金融业 | 5,776,398.80 | 10.54 |
| K | 房地产业 | 894,930.00 | 1.63 |
| L | 租赁和商务服务业 | 705,815.00 | 1.29 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 497,822.80 | 0.91 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 566,508.00 | 1.03 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 586,852.50 | 1.07 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 286,727.00 | 0.52 |
| S | 综合 | 53,178.00 | 0.10 |
| | 合计 | 50,655,379.37 | 92.43 |

7.2.2 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投资股票。

7.3 报告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 | 603688 | 石英股份 | 6,700 | 762,728.00 | 1.39 |
| 2 | 688599 | 天合光能 | 17,900 | 762,719.00 | 1.39 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 16,300 | 756,320.00 | 1.38 |
| 4 | 601669 | 中国电建 | 119,900 | 688,226.00 | 1.26 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 400 | 676,400.00 | 1.23 |
| 6 | 300185 | 通裕重工 | 216,900 | 605,151.00 | 1.10 |
| 7 | 002056 | 横店东磁 | 32,400 | 590,004.00 | 1.08 |
| 8 | 600887 | 伊利股份 | 20,200 | 572,064.00 | 1.04 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|------------|------|
| 9 | 000997 | 新大陆 | 30,000 | 567,000.00 | 1.03 |
| 10 | 600728 | 佳都科技 | 81,400 | 564,102.00 | 1.03 |
| 11 | 601169 | 北京银行 | 119,800 | 554,674.00 | 1.01 |
| 12 | 603567 | 珍宝岛 | 36,500 | 546,040.00 | 1.00 |
| 13 | 600900 | 长江电力 | 24,200 | 533,852.00 | 0.97 |
| 14 | 000538 | 云南白药 | 9,600 | 503,808.00 | 0.92 |
| 15 | 002990 | 盛视科技 | 13,300 | 489,440.00 | 0.89 |
| 16 | 300014 | 亿纬锂能 | 7,900 | 477,950.00 | 0.87 |
| 17 | 002335 | 科华数据 | 12,700 | 456,565.00 | 0.83 |
| 18 | 000596 | 古井贡酒 | 1,800 | 445,284.00 | 0.81 |
| 19 | 688711 | 宏微科技 | 7,600 | 443,384.00 | 0.81 |
| 20 | 601336 | 新华保险 | 11,800 | 433,886.00 | 0.79 |
| 21 | 301039 | 中集车辆 | 29,734 | 393,380.82 | 0.72 |
| 22 | 601966 | 玲珑轮胎 | 17,500 | 388,850.00 | 0.71 |
| 23 | 688639 | 华恒生物 | 4,200 | 380,016.00 | 0.69 |
| 24 | 000581 | 威孚高科 | 23,400 | 368,550.00 | 0.67 |
| 25 | 000333 | 美的集团 | 6,200 | 365,304.00 | 0.67 |
| 26 | 000858 | 五粮液 | 2,200 | 359,854.00 | 0.66 |
| 27 | 300130 | 新国都 | 12,700 | 359,791.00 | 0.66 |
| 28 | 600208 | 新潮中宝 | 141,100 | 349,928.00 | 0.64 |
| 29 | 300750 | 宁德时代 | 1,480 | 338,609.20 | 0.62 |
| 30 | 600050 | 中国联通 | 69,800 | 335,040.00 | 0.61 |
| 31 | 601600 | 中国铝业 | 59,200 | 325,008.00 | 0.59 |
| 32 | 601766 | 中国中车 | 49,700 | 323,050.00 | 0.59 |
| 33 | 600095 | 湘财股份 | 41,300 | 322,140.00 | 0.59 |
| 34 | 300896 | 爱美客 | 700 | 311,465.00 | 0.57 |
| 35 | 601319 | 中国人保 | 50,800 | 296,672.00 | 0.54 |
| 36 | 000591 | 太阳能 | 42,100 | 285,438.00 | 0.52 |
| 37 | 002142 | 宁波银行 | 11,200 | 283,360.00 | 0.52 |
| 38 | 002746 | 仙坛股份 | 35,100 | 276,588.00 | 0.50 |
| 39 | 601311 | 骆驼股份 | 29,700 | 275,616.00 | 0.50 |
| 40 | 002641 | 公元股份 | 48,400 | 272,976.00 | 0.50 |
| 41 | 300775 | 三角防务 | 8,000 | 270,240.00 | 0.49 |
| 42 | 300015 | 爱尔眼科 | 14,510 | 269,160.50 | 0.49 |
| 43 | 601012 | 隆基绿能 | 8,800 | 252,296.00 | 0.46 |
| 44 | 601619 | 嘉泽新能 | 53,800 | 244,790.00 | 0.45 |
| 45 | 300232 | 洲明科技 | 26,400 | 241,296.00 | 0.44 |
| 46 | 002737 | 葵花药业 | 9,900 | 240,966.00 | 0.44 |
| 47 | 688029 | 南微医学 | 2,900 | 236,524.00 | 0.43 |
| 48 | 600031 | 三一重工 | 14,000 | 232,820.00 | 0.42 |
| 49 | 300041 | 回天新材 | 19,600 | 231,280.00 | 0.42 |
| 50 | 000623 | 吉林敖东 | 14,400 | 230,976.00 | 0.42 |
| 51 | 300842 | 帝科股份 | 2,500 | 228,600.00 | 0.42 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|--------|------------|------|
| 52 | 002027 | 分众传媒 | 33,400 | 227,454.00 | 0.42 |
| 53 | 605300 | 佳禾食品 | 10,300 | 223,922.00 | 0.41 |
| 54 | 601728 | 中国电信 | 39,500 | 222,385.00 | 0.41 |
| 55 | 600809 | 山西汾酒 | 1,200 | 222,084.00 | 0.41 |
| 56 | 601816 | 京沪高铁 | 42,100 | 221,446.00 | 0.40 |
| 57 | 601628 | 中国人寿 | 6,300 | 220,248.00 | 0.40 |
| 58 | 600862 | 中航高科 | 8,700 | 220,197.00 | 0.40 |
| 59 | 002170 | 芭田股份 | 31,900 | 219,153.00 | 0.40 |
| 60 | 300702 | 天宇股份 | 9,000 | 218,430.00 | 0.40 |
| 61 | 601818 | 光大银行 | 71,000 | 217,970.00 | 0.40 |
| 62 | 601995 | 中金公司 | 6,000 | 213,120.00 | 0.39 |
| 63 | 002060 | 粤水电 | 31,500 | 207,270.00 | 0.38 |
| 64 | 601939 | 建设银行 | 33,100 | 207,206.00 | 0.38 |
| 65 | 000301 | 东方盛虹 | 17,300 | 204,486.00 | 0.37 |
| 66 | 600489 | 中金黄金 | 19,600 | 202,468.00 | 0.37 |
| 67 | 603309 | 维力医疗 | 13,000 | 201,110.00 | 0.37 |
| 68 | 301239 | 普瑞眼科 | 2,000 | 196,160.00 | 0.36 |
| 69 | 600918 | 中泰证券 | 28,100 | 194,171.00 | 0.35 |
| 70 | 600028 | 中国石化 | 30,500 | 193,980.00 | 0.35 |
| 71 | 300840 | 酷特智能 | 15,400 | 193,732.00 | 0.35 |
| 72 | 002612 | 朗姿股份 | 8,100 | 192,618.00 | 0.35 |
| 73 | 002459 | 晶澳科技 | 4,600 | 191,820.00 | 0.35 |
| 74 | 603799 | 华友钴业 | 4,100 | 188,231.00 | 0.34 |
| 75 | 601888 | 中国中免 | 1,700 | 187,901.00 | 0.34 |
| 76 | 601916 | 浙商银行 | 68,370 | 180,496.80 | 0.33 |
| 77 | 688186 | 广大特材 | 5,500 | 178,915.00 | 0.33 |
| 78 | 601958 | 金钼股份 | 15,800 | 176,170.00 | 0.32 |
| 79 | 600035 | 楚天高速 | 41,000 | 167,280.00 | 0.31 |
| 80 | 603323 | 苏农银行 | 39,300 | 165,453.00 | 0.30 |
| 81 | 601077 | 渝农商行 | 45,700 | 164,063.00 | 0.30 |
| 82 | 300316 | 晶盛机电 | 2,300 | 163,070.00 | 0.30 |
| 83 | 600036 | 招商银行 | 4,700 | 153,972.00 | 0.28 |
| 84 | 601601 | 中国太保 | 5,800 | 150,684.00 | 0.27 |
| 85 | 300857 | 协创数据 | 5,700 | 149,796.00 | 0.27 |
| 86 | 601111 | 中国国航 | 17,800 | 146,672.00 | 0.27 |
| 87 | 688006 | 杭可科技 | 4,800 | 146,256.00 | 0.27 |
| 88 | 002971 | 和远气体 | 5,700 | 146,205.00 | 0.27 |
| 89 | 002035 | 华帝股份 | 20,300 | 144,130.00 | 0.26 |
| 90 | 603690 | 至纯科技 | 4,040 | 140,753.60 | 0.26 |
| 91 | 002419 | 天虹股份 | 24,000 | 140,400.00 | 0.26 |
| 92 | 688318 | 财富趋势 | 1,400 | 139,958.00 | 0.26 |
| 93 | 300454 | 深信服 | 1,200 | 135,900.00 | 0.25 |
| 94 | 002129 | TCL 中环 | 4,050 | 134,460.00 | 0.25 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 95 | 300759 | 康龙化成 | 3,500 | 133,980.00 | 0.24 |
| 96 | 603071 | 物产环能 | 7,900 | 131,061.00 | 0.24 |
| 97 | 300031 | 宝通科技 | 5,300 | 131,016.00 | 0.24 |
| 98 | 002352 | 顺丰控股 | 2,900 | 130,761.00 | 0.24 |
| 99 | 600938 | 中国海油 | 7,200 | 130,464.00 | 0.24 |
| 100 | 002609 | 捷顺科技 | 11,100 | 129,426.00 | 0.24 |
| 101 | 600301 | 华锡有色 | 7,200 | 129,240.00 | 0.24 |
| 102 | 688299 | 长阳科技 | 7,900 | 123,793.00 | 0.23 |
| 103 | 002025 | 航天电器 | 1,900 | 121,220.00 | 0.22 |
| 104 | 688179 | 阿拉丁 | 4,000 | 119,440.00 | 0.22 |
| 105 | 600919 | 江苏银行 | 16,100 | 118,335.00 | 0.22 |
| 106 | 603983 | 丸美股份 | 3,600 | 116,460.00 | 0.21 |
| 107 | 002010 | 传化智联 | 21,800 | 115,976.00 | 0.21 |
| 108 | 000862 | 银星能源 | 15,100 | 115,666.00 | 0.21 |
| 109 | 600729 | 重庆百货 | 3,600 | 113,184.00 | 0.21 |
| 110 | 600019 | 宝钢股份 | 19,800 | 111,276.00 | 0.20 |
| 111 | 300263 | 隆华科技 | 12,900 | 107,328.00 | 0.20 |
| 112 | 600989 | 宝丰能源 | 8,500 | 107,185.00 | 0.20 |
| 113 | 000738 | 航发控制 | 4,300 | 104,920.00 | 0.19 |
| 114 | 600688 | 上海石化 | 33,400 | 103,874.00 | 0.19 |
| 115 | 601137 | 博威合金 | 6,600 | 102,696.00 | 0.19 |
| 116 | 000725 | 京东方 A | 25,000 | 102,250.00 | 0.19 |
| 117 | 301089 | 拓新药业 | 1,600 | 99,104.00 | 0.18 |
| 118 | 600985 | 淮北矿业 | 8,600 | 99,072.00 | 0.18 |
| 119 | 688173 | 希荻微 | 4,300 | 98,384.00 | 0.18 |
| 120 | 002454 | 松芝股份 | 11,400 | 96,558.00 | 0.18 |
| 121 | 002273 | 水晶光电 | 7,800 | 93,132.00 | 0.17 |
| 122 | 600570 | 恒生电子 | 2,100 | 93,009.00 | 0.17 |
| 123 | 600089 | 特变电工 | 4,100 | 91,389.00 | 0.17 |
| 124 | 000829 | 天音控股 | 10,100 | 91,304.00 | 0.17 |
| 125 | 603993 | 洛阳钼业 | 16,900 | 90,077.00 | 0.16 |
| 126 | 688223 | 晶科能源 | 6,300 | 88,578.00 | 0.16 |
| 127 | 600517 | 国网英大 | 15,300 | 87,210.00 | 0.16 |
| 128 | 603027 | 千禾味业 | 4,100 | 86,592.00 | 0.16 |
| 129 | 603195 | 公牛集团 | 900 | 86,454.00 | 0.16 |
| 130 | 601688 | 华泰证券 | 6,200 | 85,374.00 | 0.16 |
| 131 | 600372 | 中航电子 | 5,400 | 81,972.00 | 0.15 |
| 132 | 300839 | 博汇股份 | 6,000 | 79,740.00 | 0.15 |
| 133 | 600480 | 凌云股份 | 10,100 | 79,386.00 | 0.14 |
| 134 | 300231 | 银信科技 | 8,800 | 78,408.00 | 0.14 |
| 135 | 002594 | 比亚迪 | 300 | 77,481.00 | 0.14 |
| 136 | 600637 | 东方明珠 | 9,700 | 75,854.00 | 0.14 |
| 137 | 601515 | 东风股份 | 17,100 | 74,898.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 138 | 600597 | 光明乳业 | 7,200 | 74,880.00 | 0.14 |
| 139 | 300308 | 中际旭创 | 500 | 73,725.00 | 0.13 |
| 140 | 002381 | 双箭股份 | 9,200 | 71,024.00 | 0.13 |
| 141 | 002203 | 海亮股份 | 5,900 | 70,859.00 | 0.13 |
| 142 | 300622 | 博士眼镜 | 3,000 | 70,800.00 | 0.13 |
| 143 | 000927 | 中国铁物 | 25,300 | 70,334.00 | 0.13 |
| 144 | 603136 | 天目湖 | 2,700 | 69,660.00 | 0.13 |
| 145 | 600704 | 物产中大 | 14,100 | 69,654.00 | 0.13 |
| 146 | 301267 | 华夏眼科 | 1,100 | 67,045.00 | 0.12 |
| 147 | 688390 | 固德威 | 400 | 66,744.00 | 0.12 |
| 148 | 002266 | 浙富控股 | 16,100 | 66,493.00 | 0.12 |
| 149 | 601166 | 兴业银行 | 4,200 | 65,730.00 | 0.12 |
| 150 | 002131 | 利欧股份 | 28,500 | 65,550.00 | 0.12 |
| 151 | 000932 | 华菱钢铁 | 13,400 | 63,918.00 | 0.12 |
| 152 | 600516 | 方大炭素 | 10,200 | 63,240.00 | 0.12 |
| 153 | 600153 | 建发股份 | 5,700 | 62,187.00 | 0.11 |
| 154 | 600309 | 万华化学 | 700 | 61,488.00 | 0.11 |
| 155 | 601997 | 贵阳银行 | 11,900 | 61,404.00 | 0.11 |
| 156 | 688560 | 明冠新材 | 2,200 | 61,138.00 | 0.11 |
| 157 | 688060 | 云涌科技 | 1,100 | 60,610.00 | 0.11 |
| 158 | 601186 | 中国铁建 | 6,100 | 60,085.00 | 0.11 |
| 159 | 601717 | 郑煤机 | 4,800 | 59,760.00 | 0.11 |
| 160 | 000967 | 盈峰环境 | 11,700 | 59,085.00 | 0.11 |
| 161 | 601500 | 通用股份 | 14,400 | 58,896.00 | 0.11 |
| 162 | 605166 | 聚合顺 | 6,300 | 58,716.00 | 0.11 |
| 163 | 600390 | 五矿资本 | 10,800 | 58,104.00 | 0.11 |
| 164 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,200 | 57,480.00 | 0.10 |
| 165 | 600057 | 厦门象屿 | 6,600 | 57,420.00 | 0.10 |
| 166 | 605287 | 德才股份 | 2,400 | 56,880.00 | 0.10 |
| 167 | 600755 | 厦门国贸 | 7,300 | 56,502.00 | 0.10 |
| 168 | 300444 | 双杰电气 | 7,300 | 56,210.00 | 0.10 |
| 169 | 000951 | 中国重汽 | 3,300 | 55,605.00 | 0.10 |
| 170 | 002749 | 国光股份 | 4,900 | 55,517.00 | 0.10 |
| 171 | 300236 | 上海新阳 | 1,400 | 55,510.00 | 0.10 |
| 172 | 600662 | 外服控股 | 9,700 | 55,484.00 | 0.10 |
| 173 | 601992 | 金隅集团 | 25,400 | 55,372.00 | 0.10 |
| 174 | 000709 | 河钢股份 | 24,500 | 55,370.00 | 0.10 |
| 175 | 000528 | 柳工 | 7,000 | 55,300.00 | 0.10 |
| 176 | 603218 | 日月股份 | 2,900 | 55,071.00 | 0.10 |
| 177 | 601908 | 京运通 | 9,100 | 55,055.00 | 0.10 |
| 178 | 000825 | 太钢不锈 | 14,200 | 54,954.00 | 0.10 |
| 179 | 601618 | 中国中冶 | 13,800 | 54,786.00 | 0.10 |
| 180 | 600297 | 广汇汽车 | 26,200 | 54,496.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 181 | 600064 | 南京高科 | 8,200 | 54,202.00 | 0.10 |
| 182 | 002202 | 金风科技 | 5,100 | 54,162.00 | 0.10 |
| 183 | 603041 | 美思德 | 4,500 | 54,090.00 | 0.10 |
| 184 | 002004 | 华邦健康 | 10,800 | 54,000.00 | 0.10 |
| 185 | 603358 | 华达科技 | 2,800 | 53,368.00 | 0.10 |
| 186 | 002745 | 木林森 | 5,800 | 53,360.00 | 0.10 |
| 187 | 600362 | 江西铜业 | 2,800 | 53,144.00 | 0.10 |
| 188 | 002416 | 爱施德 | 7,200 | 53,136.00 | 0.10 |
| 189 | 600782 | 新钢股份 | 14,300 | 53,053.00 | 0.10 |
| 190 | 300855 | 图南股份 | 1,500 | 52,980.00 | 0.10 |
| 191 | 000803 | 山高环能 | 5,100 | 52,683.00 | 0.10 |
| 192 | 300017 | 网宿科技 | 7,400 | 52,614.00 | 0.10 |
| 193 | 000898 | 鞍钢股份 | 18,900 | 52,542.00 | 0.10 |
| 194 | 002559 | 亚威股份 | 5,900 | 52,392.00 | 0.10 |
| 195 | 600740 | 山西焦化 | 10,200 | 52,326.00 | 0.10 |
| 196 | 600531 | 豫光金铅 | 8,300 | 52,290.00 | 0.10 |
| 197 | 600502 | 安徽建工 | 9,900 | 52,272.00 | 0.10 |
| 198 | 002048 | 宁波华翔 | 3,900 | 52,260.00 | 0.10 |
| 199 | 000685 | 中山公用 | 6,900 | 52,233.00 | 0.10 |
| 200 | 002446 | 盛路通信 | 5,500 | 51,975.00 | 0.09 |
| 201 | 600811 | 东方集团 | 23,200 | 51,968.00 | 0.09 |
| 202 | 000069 | 华侨城 A | 11,800 | 51,920.00 | 0.09 |
| 203 | 000030 | 富奥股份 | 10,300 | 51,912.00 | 0.09 |
| 204 | 002215 | 诺普信 | 6,900 | 51,819.00 | 0.09 |
| 205 | 601828 | 美凯龙 | 10,800 | 51,732.00 | 0.09 |
| 206 | 000625 | 长安汽车 | 4,000 | 51,720.00 | 0.09 |
| 207 | 600971 | 恒源煤电 | 6,600 | 51,414.00 | 0.09 |
| 208 | 000990 | 诚志股份 | 6,700 | 51,054.00 | 0.09 |
| 209 | 688009 | 中国通号 | 8,800 | 51,040.00 | 0.09 |
| 210 | 000783 | 长江证券 | 8,800 | 51,040.00 | 0.09 |
| 211 | 001696 | 宗申动力 | 7,200 | 50,976.00 | 0.09 |
| 212 | 002402 | 和而泰 | 3,000 | 50,940.00 | 0.09 |
| 213 | 002556 | 辉隆股份 | 7,000 | 50,820.00 | 0.09 |
| 214 | 000048 | 京基智农 | 2,600 | 50,752.00 | 0.09 |
| 215 | 600682 | 南京新百 | 6,300 | 50,463.00 | 0.09 |
| 216 | 603020 | 爱普股份 | 5,500 | 50,380.00 | 0.09 |
| 217 | 300279 | 和晶科技 | 9,000 | 50,310.00 | 0.09 |
| 218 | 600346 | 恒力石化 | 3,500 | 50,155.00 | 0.09 |
| 219 | 002573 | 清新环境 | 9,100 | 50,141.00 | 0.09 |
| 220 | 688538 | 和辉光电 | 19,700 | 50,038.00 | 0.09 |
| 221 | 600606 | 绿地控股 | 18,000 | 49,500.00 | 0.09 |
| 222 | 600030 | 中信证券 | 2,500 | 49,450.00 | 0.09 |
| 223 | 300970 | 华绿生物 | 2,100 | 49,056.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 224 | 000570 | 苏常柴 A | 8,800 | 49,016.00 | 0.09 |
| 225 | 600643 | 爱建集团 | 9,800 | 49,000.00 | 0.09 |
| 226 | 600308 | 华泰股份 | 13,160 | 48,955.20 | 0.09 |
| 227 | 002012 | 凯恩股份 | 7,500 | 48,825.00 | 0.09 |
| 228 | 003003 | 天元股份 | 4,600 | 48,668.00 | 0.09 |
| 229 | 002772 | 众兴菌业 | 4,300 | 48,590.00 | 0.09 |
| 230 | 000521 | 长虹美菱 | 6,300 | 48,132.00 | 0.09 |
| 231 | 300925 | 法本信息 | 3,400 | 48,042.00 | 0.09 |
| 232 | 300319 | 麦捷科技 | 5,600 | 47,936.00 | 0.09 |
| 233 | 000885 | 城发环境 | 3,600 | 47,916.00 | 0.09 |
| 234 | 300973 | 立高食品 | 700 | 47,894.00 | 0.09 |
| 235 | 603855 | 华荣股份 | 1,800 | 47,880.00 | 0.09 |
| 236 | 300511 | 雪榕生物 | 6,300 | 47,880.00 | 0.09 |
| 237 | 301220 | 亚香股份 | 1,400 | 47,754.00 | 0.09 |
| 238 | 300884 | 狄耐克 | 3,600 | 47,664.00 | 0.09 |
| 239 | 603719 | 良品铺子 | 1,900 | 47,519.00 | 0.09 |
| 240 | 002531 | 天顺风能 | 3,100 | 47,213.00 | 0.09 |
| 241 | 300349 | 金卡智能 | 3,400 | 47,192.00 | 0.09 |
| 242 | 301258 | 富士莱 | 1,200 | 47,184.00 | 0.09 |
| 243 | 603507 | 振江股份 | 1,300 | 47,138.00 | 0.09 |
| 244 | 603367 | 辰欣药业 | 3,100 | 47,058.00 | 0.09 |
| 245 | 002029 | 七匹狼 | 7,400 | 46,990.00 | 0.09 |
| 246 | 301256 | 华融化学 | 5,300 | 46,958.00 | 0.09 |
| 247 | 002154 | 报喜鸟 | 8,500 | 46,920.00 | 0.09 |
| 248 | 002394 | 联发股份 | 5,500 | 46,805.00 | 0.09 |
| 249 | 300274 | 阳光电源 | 400 | 46,652.00 | 0.09 |
| 250 | 601899 | 紫金矿业 | 4,100 | 46,617.00 | 0.09 |
| 251 | 600020 | 中原高速 | 12,700 | 46,609.00 | 0.09 |
| 252 | 300194 | 福安药业 | 12,000 | 46,560.00 | 0.08 |
| 253 | 000949 | 新乡化纤 | 14,500 | 46,545.00 | 0.08 |
| 254 | 603518 | 锦泓集团 | 4,100 | 46,535.00 | 0.08 |
| 255 | 603366 | 日出东方 | 8,000 | 46,480.00 | 0.08 |
| 256 | 000589 | 贵州轮胎 | 8,300 | 46,480.00 | 0.08 |
| 257 | 000759 | 中百集团 | 10,300 | 46,453.00 | 0.08 |
| 258 | 000507 | 珠海港 | 8,400 | 46,452.00 | 0.08 |
| 259 | 002133 | 广宇集团 | 13,700 | 46,443.00 | 0.08 |
| 260 | 002296 | 辉煌科技 | 5,400 | 46,440.00 | 0.08 |
| 261 | 600315 | 上海家化 | 1,600 | 46,416.00 | 0.08 |
| 262 | 000926 | 福星股份 | 11,100 | 46,398.00 | 0.08 |
| 263 | 000417 | 合肥百货 | 9,900 | 46,332.00 | 0.08 |
| 264 | 601028 | 玉龙股份 | 4,300 | 46,225.00 | 0.08 |
| 265 | 600748 | 上实发展 | 11,700 | 46,215.00 | 0.08 |
| 266 | 603768 | 常青股份 | 2,600 | 46,202.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 267 | 603856 | 东宏股份 | 3,500 | 46,165.00 | 0.08 |
| 268 | 002998 | 优彩资源 | 6,500 | 46,150.00 | 0.08 |
| 269 | 300871 | 回盛生物 | 2,800 | 46,144.00 | 0.08 |
| 270 | 300399 | 天利科技 | 3,500 | 46,025.00 | 0.08 |
| 271 | 002991 | 甘源食品 | 600 | 46,020.00 | 0.08 |
| 272 | 600229 | 城市传媒 | 5,400 | 46,008.00 | 0.08 |
| 273 | 002817 | 黄山胶囊 | 5,300 | 46,004.00 | 0.08 |
| 274 | 002392 | 北京利尔 | 12,700 | 45,974.00 | 0.08 |
| 275 | 603519 | 立霸股份 | 3,100 | 45,942.00 | 0.08 |
| 276 | 000900 | 现代投资 | 11,400 | 45,942.00 | 0.08 |
| 277 | 600603 | 广汇物流 | 6,600 | 45,936.00 | 0.08 |
| 278 | 300539 | 横河精密 | 3,100 | 45,911.00 | 0.08 |
| 279 | 000705 | 浙江震元 | 5,700 | 45,885.00 | 0.08 |
| 280 | 600269 | 赣粤高速 | 12,500 | 45,875.00 | 0.08 |
| 281 | 600537 | 亿晶光电 | 6,000 | 45,840.00 | 0.08 |
| 282 | 600512 | 腾达建设 | 17,100 | 45,828.00 | 0.08 |
| 283 | 002566 | 益盛药业 | 5,500 | 45,760.00 | 0.08 |
| 284 | 300259 | 新天科技 | 11,400 | 45,714.00 | 0.08 |
| 285 | 600368 | 五洲交通 | 12,550 | 45,682.00 | 0.08 |
| 286 | 000906 | 浙商中拓 | 5,100 | 45,492.00 | 0.08 |
| 287 | 600551 | 时代出版 | 4,100 | 45,305.00 | 0.08 |
| 288 | 000937 | 冀中能源 | 7,100 | 45,298.00 | 0.08 |
| 289 | 603066 | 音飞储存 | 3,800 | 45,258.00 | 0.08 |
| 290 | 603950 | 长源东谷 | 3,000 | 44,880.00 | 0.08 |
| 291 | 603639 | 海利尔 | 2,500 | 44,800.00 | 0.08 |
| 292 | 603878 | 武进不锈 | 5,300 | 44,785.00 | 0.08 |
| 293 | 688227 | 品高股份 | 1,800 | 44,694.00 | 0.08 |
| 294 | 000060 | 中金岭南 | 9,400 | 44,650.00 | 0.08 |
| 295 | 603109 | 神驰机电 | 2,500 | 44,625.00 | 0.08 |
| 296 | 301052 | 果麦文化 | 900 | 44,388.00 | 0.08 |
| 297 | 300860 | 锋尚文化 | 800 | 44,352.00 | 0.08 |
| 298 | 301208 | 中亦科技 | 800 | 44,264.00 | 0.08 |
| 299 | 600067 | 冠城大通 | 16,700 | 44,255.00 | 0.08 |
| 300 | 688399 | 硕世生物 | 800 | 44,160.00 | 0.08 |
| 301 | 002893 | 京能热力 | 4,100 | 44,157.00 | 0.08 |
| 302 | 002448 | 中原内配 | 6,300 | 44,100.00 | 0.08 |
| 303 | 300963 | 中洲特材 | 3,100 | 43,989.00 | 0.08 |
| 304 | 002606 | 大连电瓷 | 4,800 | 43,920.00 | 0.08 |
| 305 | 002956 | 西麦食品 | 2,800 | 43,764.00 | 0.08 |
| 306 | 688510 | 航亚科技 | 2,200 | 43,758.00 | 0.08 |
| 307 | 600961 | 株冶集团 | 5,400 | 43,686.00 | 0.08 |
| 308 | 000338 | 潍柴动力 | 3,500 | 43,610.00 | 0.08 |
| 309 | 000055 | 方大集团 | 8,800 | 43,560.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 310 | 300872 | 天阳科技 | 2,800 | 43,512.00 | 0.08 |
| 311 | 600628 | 新世界 | 6,000 | 43,380.00 | 0.08 |
| 312 | 600629 | 华建集团 | 6,200 | 43,276.00 | 0.08 |
| 313 | 688718 | 唯赛勃 | 2,500 | 43,275.00 | 0.08 |
| 314 | 688288 | 鸿泉物联 | 1,700 | 43,214.00 | 0.08 |
| 315 | 603102 | 百合股份 | 1,000 | 43,190.00 | 0.08 |
| 316 | 301076 | 新瀚新材 | 2,200 | 43,164.00 | 0.08 |
| 317 | 300059 | 东方财富 | 3,020 | 42,884.00 | 0.08 |
| 318 | 688356 | 键凯科技 | 400 | 42,620.00 | 0.08 |
| 319 | 600916 | 中国黄金 | 3,600 | 42,516.00 | 0.08 |
| 320 | 300332 | 天壕环境 | 3,700 | 42,439.00 | 0.08 |
| 321 | 600837 | 海通证券 | 4,600 | 42,412.00 | 0.08 |
| 322 | 300109 | 新开源 | 1,700 | 42,279.00 | 0.08 |
| 323 | 301103 | 何氏眼科 | 1,000 | 41,960.00 | 0.08 |
| 324 | 000568 | 泸州老窖 | 200 | 41,914.00 | 0.08 |
| 325 | 002233 | 塔牌集团 | 5,400 | 41,688.00 | 0.08 |
| 326 | 688158 | 优刻得 | 2,200 | 41,536.00 | 0.08 |
| 327 | 688296 | 和达科技 | 2,300 | 41,055.00 | 0.07 |
| 328 | 002489 | 浙江永强 | 10,100 | 40,905.00 | 0.07 |
| 329 | 600292 | 远达环保 | 7,000 | 40,810.00 | 0.07 |
| 330 | 300384 | 三联虹普 | 2,400 | 40,776.00 | 0.07 |
| 331 | 000563 | 陕国投 A | 13,200 | 40,260.00 | 0.07 |
| 332 | 000651 | 格力电器 | 1,100 | 40,161.00 | 0.07 |
| 333 | 300999 | 金龙鱼 | 1,000 | 39,990.00 | 0.07 |
| 334 | 300219 | 鸿利智汇 | 5,400 | 39,690.00 | 0.07 |
| 335 | 603588 | 高能环境 | 4,200 | 39,354.00 | 0.07 |
| 336 | 600488 | 津药药业 | 7,000 | 39,340.00 | 0.07 |
| 337 | 000650 | 仁和药业 | 6,400 | 39,296.00 | 0.07 |
| 338 | 601686 | 友发集团 | 5,700 | 38,988.00 | 0.07 |
| 339 | 002475 | 立讯精密 | 1,200 | 38,940.00 | 0.07 |
| 340 | 600415 | 小商品城 | 4,500 | 38,385.00 | 0.07 |
| 341 | 600585 | 海螺水泥 | 1,600 | 37,984.00 | 0.07 |
| 342 | 601328 | 交通银行 | 6,500 | 37,700.00 | 0.07 |
| 343 | 603508 | 思维列控 | 2,200 | 37,510.00 | 0.07 |
| 344 | 300491 | 通合科技 | 1,300 | 37,310.00 | 0.07 |
| 345 | 002373 | 千方科技 | 2,700 | 36,828.00 | 0.07 |
| 346 | 600026 | 中远海能 | 2,900 | 36,656.00 | 0.07 |
| 347 | 002415 | 海康威视 | 1,100 | 36,421.00 | 0.07 |
| 348 | 301073 | 君亭酒店 | 1,000 | 36,350.00 | 0.07 |
| 349 | 605377 | 华旺科技 | 2,000 | 36,100.00 | 0.07 |
| 350 | 002283 | 天润工业 | 5,600 | 35,952.00 | 0.07 |
| 351 | 688002 | 睿创微纳 | 800 | 35,840.00 | 0.07 |
| 352 | 603967 | 中创物流 | 3,900 | 35,646.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 353 | 301078 | 孩子王 | 3,100 | 35,433.00 | 0.06 |
| 354 | 300164 | 通源石油 | 8,100 | 35,316.00 | 0.06 |
| 355 | 601003 | 柳钢股份 | 8,700 | 35,148.00 | 0.06 |
| 356 | 603587 | 地素时尚 | 2,400 | 35,136.00 | 0.06 |
| 357 | 600400 | 红豆股份 | 10,700 | 35,096.00 | 0.06 |
| 358 | 600588 | 用友网络 | 1,700 | 34,850.00 | 0.06 |
| 359 | 002900 | 哈三联 | 2,600 | 34,762.00 | 0.06 |
| 360 | 002449 | 国星光电 | 3,900 | 34,671.00 | 0.06 |
| 361 | 300513 | 恒实科技 | 2,500 | 34,625.00 | 0.06 |
| 362 | 600008 | 首创环保 | 12,000 | 34,560.00 | 0.06 |
| 363 | 600016 | 民生银行 | 9,200 | 34,500.00 | 0.06 |
| 364 | 300387 | 富邦股份 | 4,700 | 34,216.00 | 0.06 |
| 365 | 600370 | 三房巷 | 12,700 | 34,036.00 | 0.06 |
| 366 | 600694 | 大商股份 | 1,900 | 33,687.00 | 0.06 |
| 367 | 002483 | 润邦股份 | 5,800 | 33,640.00 | 0.06 |
| 368 | 600875 | 东方电气 | 1,800 | 33,570.00 | 0.06 |
| 369 | 603683 | 晶华新材 | 2,900 | 33,553.00 | 0.06 |
| 370 | 002120 | 韵达股份 | 3,500 | 33,460.00 | 0.06 |
| 371 | 002743 | 富煌钢构 | 5,800 | 33,350.00 | 0.06 |
| 372 | 600011 | 华能国际 | 3,600 | 33,336.00 | 0.06 |
| 373 | 601668 | 中国建筑 | 5,800 | 33,292.00 | 0.06 |
| 374 | 603661 | 恒林股份 | 1,000 | 33,160.00 | 0.06 |
| 375 | 300827 | 上能电气 | 911 | 32,841.55 | 0.06 |
| 376 | 300502 | 新易盛 | 480 | 32,625.60 | 0.06 |
| 377 | 300796 | 贝斯美 | 2,700 | 32,481.00 | 0.06 |
| 378 | 600716 | 凤凰股份 | 8,500 | 32,130.00 | 0.06 |
| 379 | 002695 | 煌上煌 | 3,000 | 32,070.00 | 0.06 |
| 380 | 603161 | 科华控股 | 2,200 | 32,054.00 | 0.06 |
| 381 | 000063 | 中兴通讯 | 700 | 31,878.00 | 0.06 |
| 382 | 000100 | TCL 科技 | 7,990 | 31,480.60 | 0.06 |
| 383 | 603060 | 国检集团 | 2,980 | 31,170.80 | 0.06 |
| 384 | 300493 | 润欣科技 | 3,400 | 31,008.00 | 0.06 |
| 385 | 600901 | 江苏金租 | 7,500 | 30,975.00 | 0.06 |
| 386 | 600496 | 精工钢构 | 8,300 | 30,959.00 | 0.06 |
| 387 | 000619 | 海螺新材 | 5,000 | 30,500.00 | 0.06 |
| 388 | 600180 | 瑞茂通 | 5,100 | 30,498.00 | 0.06 |
| 389 | 300039 | 上海凯宝 | 4,400 | 30,360.00 | 0.06 |
| 390 | 600323 | 瀚蓝环境 | 1,600 | 30,288.00 | 0.06 |
| 391 | 003017 | 大洋生物 | 900 | 30,285.00 | 0.06 |
| 392 | 000402 | 金融街 | 6,700 | 30,284.00 | 0.06 |
| 393 | 002382 | 蓝帆医疗 | 4,200 | 30,156.00 | 0.06 |
| 394 | 600864 | 哈投股份 | 5,900 | 30,149.00 | 0.06 |
| 395 | 300195 | 长荣股份 | 4,800 | 30,144.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 396 | 002277 | 友阿股份 | 9,500 | 30,020.00 | 0.05 |
| 397 | 300760 | 迈瑞医疗 | 100 | 29,980.00 | 0.05 |
| 398 | 600352 | 浙江龙盛 | 3,200 | 29,920.00 | 0.05 |
| 399 | 600639 | 浦东金桥 | 2,400 | 29,784.00 | 0.05 |
| 400 | 002135 | 东南网架 | 4,600 | 29,716.00 | 0.05 |
| 401 | 605177 | 东亚药业 | 1,200 | 29,568.00 | 0.05 |
| 402 | 603365 | 水星家纺 | 2,100 | 29,526.00 | 0.05 |
| 403 | 300878 | 维康药业 | 1,300 | 29,510.00 | 0.05 |
| 404 | 002683 | 广东宏大 | 1,000 | 29,440.00 | 0.05 |
| 405 | 600745 | 闻泰科技 | 600 | 29,340.00 | 0.05 |
| 406 | 688187 | 时代电气 | 700 | 29,302.00 | 0.05 |
| 407 | 000517 | 荣安地产 | 9,600 | 29,280.00 | 0.05 |
| 408 | 688503 | 聚和材料 | 300 | 29,250.00 | 0.05 |
| 409 | 600261 | 阳光照明 | 8,000 | 29,200.00 | 0.05 |
| 410 | 600510 | 黑牡丹 | 4,800 | 29,136.00 | 0.05 |
| 411 | 605222 | 起帆电缆 | 1,400 | 28,924.00 | 0.05 |
| 412 | 300129 | 泰胜风能 | 3,000 | 28,770.00 | 0.05 |
| 413 | 603833 | 欧派家居 | 300 | 28,740.00 | 0.05 |
| 414 | 600436 | 片仔癀 | 100 | 28,636.00 | 0.05 |
| 415 | 300729 | 乐歌股份 | 1,600 | 28,544.00 | 0.05 |
| 416 | 000690 | 宝新能源 | 4,000 | 28,080.00 | 0.05 |
| 417 | 000630 | 铜陵有色 | 9,600 | 27,744.00 | 0.05 |
| 418 | 688152 | 麒麟信安 | 300 | 27,684.00 | 0.05 |
| 419 | 300653 | 正海生物 | 800 | 27,512.00 | 0.05 |
| 420 | 000919 | 金陵药业 | 3,500 | 27,370.00 | 0.05 |
| 421 | 002588 | 史丹利 | 4,500 | 27,360.00 | 0.05 |
| 422 | 603357 | 设计总院 | 2,600 | 27,300.00 | 0.05 |
| 423 | 002230 | 科大讯飞 | 400 | 27,184.00 | 0.05 |
| 424 | 300190 | 维尔利 | 6,800 | 27,132.00 | 0.05 |
| 425 | 002546 | 新联电子 | 4,400 | 27,060.00 | 0.05 |
| 426 | 300611 | 美力科技 | 2,800 | 26,992.00 | 0.05 |
| 427 | 601010 | 文峰股份 | 11,000 | 26,950.00 | 0.05 |
| 428 | 000731 | 四川美丰 | 3,300 | 26,895.00 | 0.05 |
| 429 | 003023 | 彩虹集团 | 1,300 | 26,663.00 | 0.05 |
| 430 | 600757 | 长江传媒 | 3,100 | 26,660.00 | 0.05 |
| 431 | 000530 | 冰山冷热 | 4,800 | 26,592.00 | 0.05 |
| 432 | 600061 | 国投资本 | 3,700 | 26,344.00 | 0.05 |
| 433 | 301006 | 迈拓股份 | 1,000 | 26,150.00 | 0.05 |
| 434 | 300304 | 云意电气 | 4,700 | 26,038.00 | 0.05 |
| 435 | 300124 | 汇川技术 | 400 | 25,684.00 | 0.05 |
| 436 | 002860 | 星帅尔 | 1,900 | 25,612.00 | 0.05 |
| 437 | 688133 | 泰坦科技 | 300 | 25,557.00 | 0.05 |
| 438 | 600526 | 菲达环保 | 5,300 | 25,546.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 439 | 600104 | 上汽集团 | 1,800 | 25,506.00 | 0.05 |
| 440 | 000728 | 国元证券 | 3,900 | 25,428.00 | 0.05 |
| 441 | 002714 | 牧原股份 | 600 | 25,290.00 | 0.05 |
| 442 | 300239 | 东宝生物 | 4,100 | 25,256.00 | 0.05 |
| 443 | 002275 | 桂林三金 | 1,400 | 25,214.00 | 0.05 |
| 444 | 688386 | 泛亚微透 | 600 | 25,200.00 | 0.05 |
| 445 | 301333 | 诺思格 | 500 | 25,150.00 | 0.05 |
| 446 | 600320 | 振华重工 | 6,700 | 24,991.00 | 0.05 |
| 447 | 300290 | 荣科科技 | 5,200 | 24,960.00 | 0.05 |
| 448 | 603259 | 药明康德 | 400 | 24,924.00 | 0.05 |
| 449 | 300272 | 开能健康 | 4,700 | 24,910.00 | 0.05 |
| 450 | 300462 | 华铭智能 | 2,100 | 24,654.00 | 0.04 |
| 451 | 600271 | 航天信息 | 1,800 | 24,642.00 | 0.04 |
| 452 | 000617 | 中油资本 | 3,400 | 24,582.00 | 0.04 |
| 453 | 000544 | 中原环保 | 3,400 | 24,412.00 | 0.04 |
| 454 | 601229 | 上海银行 | 4,200 | 24,150.00 | 0.04 |
| 455 | 605388 | 均瑶健康 | 1,900 | 24,149.00 | 0.04 |
| 456 | 300504 | 天邑股份 | 1,200 | 24,084.00 | 0.04 |
| 457 | 688038 | 中科通达 | 1,600 | 23,936.00 | 0.04 |
| 458 | 600000 | 浦发银行 | 3,300 | 23,892.00 | 0.04 |
| 459 | 601211 | 国泰君安 | 1,700 | 23,783.00 | 0.04 |
| 460 | 605122 | 四方新材 | 1,600 | 23,744.00 | 0.04 |
| 461 | 301148 | 嘉戎技术 | 1,100 | 23,518.00 | 0.04 |
| 462 | 002144 | 宏达高科 | 2,100 | 23,499.00 | 0.04 |
| 463 | 601288 | 农业银行 | 6,600 | 23,298.00 | 0.04 |
| 464 | 603095 | 越剑智能 | 1,500 | 23,175.00 | 0.04 |
| 465 | 600150 | 中国船舶 | 700 | 23,037.00 | 0.04 |
| 466 | 301276 | 嘉曼服饰 | 900 | 22,950.00 | 0.04 |
| 467 | 002334 | 英威腾 | 1,800 | 22,932.00 | 0.04 |
| 468 | 600909 | 华安证券 | 4,900 | 22,883.00 | 0.04 |
| 469 | 600191 | 华资实业 | 4,000 | 22,880.00 | 0.04 |
| 470 | 300296 | 利亚德 | 3,500 | 22,855.00 | 0.04 |
| 471 | 300908 | 仲景食品 | 500 | 22,675.00 | 0.04 |
| 472 | 300385 | 雪浪环境 | 3,700 | 22,644.00 | 0.04 |
| 473 | 603605 | 珀莱雅 | 200 | 22,480.00 | 0.04 |
| 474 | 000001 | 平安银行 | 2,000 | 22,460.00 | 0.04 |
| 475 | 301009 | 可靠股份 | 1,900 | 22,097.00 | 0.04 |
| 476 | 000776 | 广发证券 | 1,500 | 22,065.00 | 0.04 |
| 477 | 688669 | 聚石化学 | 1,200 | 21,756.00 | 0.04 |
| 478 | 605189 | 富春染织 | 1,300 | 21,333.00 | 0.04 |
| 479 | 300779 | 惠城环保 | 400 | 21,316.00 | 0.04 |
| 480 | 000688 | 国城矿业 | 1,400 | 21,238.00 | 0.04 |
| 481 | 603488 | 展鹏科技 | 2,600 | 20,878.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 482 | 002997 | 瑞鹄模具 | 700 | 20,811.00 | 0.04 |
| 483 | 600668 | 尖峰集团 | 1,800 | 20,736.00 | 0.04 |
| 484 | 600438 | 通威股份 | 600 | 20,586.00 | 0.04 |
| 485 | 600848 | 上海临港 | 1,700 | 20,315.00 | 0.04 |
| 486 | 688981 | 中芯国际 | 400 | 20,208.00 | 0.04 |
| 487 | 600120 | 浙江东方 | 5,200 | 19,916.00 | 0.04 |
| 488 | 000554 | 泰山石油 | 3,500 | 19,705.00 | 0.04 |
| 489 | 603396 | 金辰股份 | 300 | 19,680.00 | 0.04 |
| 490 | 688080 | 映翰通 | 400 | 19,560.00 | 0.04 |
| 491 | 603100 | 川仪股份 | 500 | 19,430.00 | 0.04 |
| 492 | 601825 | 沪农商行 | 3,500 | 19,075.00 | 0.03 |
| 493 | 000559 | 万向钱潮 | 3,500 | 19,075.00 | 0.03 |
| 494 | 600717 | 天津港 | 4,300 | 19,049.00 | 0.03 |
| 495 | 000988 | 华工科技 | 500 | 19,005.00 | 0.03 |
| 496 | 600635 | 大众公用 | 5,700 | 18,924.00 | 0.03 |
| 497 | 600690 | 海尔智家 | 800 | 18,784.00 | 0.03 |
| 498 | 600941 | 中国移动 | 200 | 18,660.00 | 0.03 |
| 499 | 002110 | 三钢闽光 | 4,400 | 18,568.00 | 0.03 |
| 500 | 601088 | 中国神华 | 600 | 18,450.00 | 0.03 |
| 501 | 600176 | 中国巨石 | 1,300 | 18,408.00 | 0.03 |
| 502 | 300498 | 温氏股份 | 1,000 | 18,350.00 | 0.03 |
| 503 | 000002 | 万科 A | 1,300 | 18,226.00 | 0.03 |
| 504 | 688777 | 中控技术 | 290 | 18,206.20 | 0.03 |
| 505 | 688021 | 奥福环保 | 700 | 18,144.00 | 0.03 |
| 506 | 002384 | 东山精密 | 700 | 18,130.00 | 0.03 |
| 507 | 603897 | 长城科技 | 900 | 18,054.00 | 0.03 |
| 508 | 002340 | 格林美 | 2,600 | 17,966.00 | 0.03 |
| 509 | 002421 | 达实智能 | 5,100 | 17,952.00 | 0.03 |
| 510 | 605081 | 太和水 | 1,200 | 17,868.00 | 0.03 |
| 511 | 603899 | 晨光股份 | 400 | 17,856.00 | 0.03 |
| 512 | 002422 | 科伦药业 | 600 | 17,808.00 | 0.03 |
| 513 | 601138 | 工业富联 | 700 | 17,640.00 | 0.03 |
| 514 | 601101 | 昊华能源 | 3,000 | 17,460.00 | 0.03 |
| 515 | 300235 | 方直科技 | 1,400 | 17,430.00 | 0.03 |
| 516 | 300295 | 三六五网 | 1,400 | 17,318.00 | 0.03 |
| 517 | 600373 | 中文传媒 | 1,300 | 17,316.00 | 0.03 |
| 518 | 002345 | 潮宏基 | 2,200 | 17,292.00 | 0.03 |
| 519 | 600742 | 一汽富维 | 2,100 | 17,199.00 | 0.03 |
| 520 | 688335 | 复洁环保 | 700 | 17,178.00 | 0.03 |
| 521 | 000062 | 深圳华强 | 1,500 | 17,130.00 | 0.03 |
| 522 | 600760 | 中航沈飞 | 380 | 17,100.00 | 0.03 |
| 523 | 002344 | 海宁皮城 | 3,600 | 17,028.00 | 0.03 |
| 524 | 300940 | 南极光 | 1,000 | 17,010.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 525 | 600170 | 上海建工 | 6,300 | 16,947.00 | 0.03 |
| 526 | 600048 | 保利发展 | 1,300 | 16,939.00 | 0.03 |
| 527 | 000026 | 飞亚达 | 1,400 | 16,884.00 | 0.03 |
| 528 | 002968 | 新大正 | 1,100 | 16,621.00 | 0.03 |
| 529 | 300419 | 浩丰科技 | 2,600 | 16,276.00 | 0.03 |
| 530 | 603197 | 保隆科技 | 300 | 16,275.00 | 0.03 |
| 531 | 600419 | 天润乳业 | 1,000 | 16,220.00 | 0.03 |
| 532 | 600406 | 国电南瑞 | 700 | 16,170.00 | 0.03 |
| 533 | 003016 | 欣贺股份 | 1,600 | 16,160.00 | 0.03 |
| 534 | 688681 | 科汇股份 | 1,000 | 16,160.00 | 0.03 |
| 535 | 603189 | 网达软件 | 1,100 | 16,159.00 | 0.03 |
| 536 | 300418 | 昆仑万维 | 400 | 16,112.00 | 0.03 |
| 537 | 600905 | 三峡能源 | 3,000 | 16,110.00 | 0.03 |
| 538 | 301043 | 绿岛风 | 500 | 15,985.00 | 0.03 |
| 539 | 300020 | 银江技术 | 1,700 | 15,725.00 | 0.03 |
| 540 | 002062 | 宏润建设 | 2,900 | 15,689.00 | 0.03 |
| 541 | 600708 | 光明地产 | 7,300 | 15,622.00 | 0.03 |
| 542 | 300012 | 华测检测 | 800 | 15,600.00 | 0.03 |
| 543 | 000912 | 泸天化 | 3,400 | 15,572.00 | 0.03 |
| 544 | 603035 | 常熟汽饰 | 800 | 15,544.00 | 0.03 |
| 545 | 002330 | 得利斯 | 2,700 | 15,525.00 | 0.03 |
| 546 | 300945 | 曼卡龙 | 1,000 | 15,520.00 | 0.03 |
| 547 | 301065 | 本立科技 | 750 | 15,517.50 | 0.03 |
| 548 | 600977 | 中国电影 | 1,100 | 15,455.00 | 0.03 |
| 549 | 601107 | 四川成渝 | 3,700 | 15,059.00 | 0.03 |
| 550 | 600820 | 隧道股份 | 2,500 | 15,025.00 | 0.03 |
| 551 | 601857 | 中国石油 | 2,000 | 14,940.00 | 0.03 |
| 552 | 000888 | 峨眉山 A | 1,300 | 14,898.00 | 0.03 |
| 553 | 603345 | 安井食品 | 100 | 14,680.00 | 0.03 |
| 554 | 603499 | 翔港科技 | 1,500 | 14,310.00 | 0.03 |
| 555 | 600157 | 永泰能源 | 10,000 | 14,200.00 | 0.03 |
| 556 | 603568 | 伟明环保 | 800 | 14,008.00 | 0.03 |
| 557 | 600051 | 宁波联合 | 1,900 | 13,832.00 | 0.03 |
| 558 | 603199 | 九华旅游 | 400 | 13,820.00 | 0.03 |
| 559 | 601988 | 中国银行 | 3,500 | 13,685.00 | 0.02 |
| 560 | 600883 | 博闻科技 | 1,800 | 13,662.00 | 0.02 |
| 561 | 688178 | 万德斯 | 700 | 13,573.00 | 0.02 |
| 562 | 600576 | 祥源文旅 | 1,700 | 13,549.00 | 0.02 |
| 563 | 600079 | 人福医药 | 500 | 13,470.00 | 0.02 |
| 564 | 300756 | 金马游乐 | 700 | 13,384.00 | 0.02 |
| 565 | 300727 | 润禾材料 | 500 | 13,200.00 | 0.02 |
| 566 | 601919 | 中远海控 | 1,400 | 13,160.00 | 0.02 |
| 567 | 002304 | 洋河股份 | 100 | 13,135.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 568 | 601106 | 中国一重 | 3,900 | 13,104.00 | 0.02 |
| 569 | 600109 | 国金证券 | 1,500 | 13,005.00 | 0.02 |
| 570 | 688357 | 建龙微纳 | 200 | 12,938.00 | 0.02 |
| 571 | 300289 | 利德曼 | 2,300 | 12,880.00 | 0.02 |
| 572 | 600986 | 浙文互联 | 2,000 | 12,800.00 | 0.02 |
| 573 | 300133 | 华策影视 | 1,800 | 12,762.00 | 0.02 |
| 574 | 002649 | 博彦科技 | 900 | 12,717.00 | 0.02 |
| 575 | 601611 | 中国核建 | 1,500 | 12,675.00 | 0.02 |
| 576 | 600231 | 凌钢股份 | 5,600 | 12,432.00 | 0.02 |
| 577 | 300457 | 赢合科技 | 700 | 12,362.00 | 0.02 |
| 578 | 300243 | 瑞丰高材 | 1,400 | 12,320.00 | 0.02 |
| 579 | 002460 | 赣锋锂业 | 200 | 12,192.00 | 0.02 |
| 580 | 601390 | 中国中铁 | 1,600 | 12,128.00 | 0.02 |
| 581 | 300642 | 透景生命 | 600 | 12,102.00 | 0.02 |
| 582 | 300762 | 上海瀚讯 | 1,000 | 11,770.00 | 0.02 |
| 583 | 600487 | 亨通光电 | 800 | 11,728.00 | 0.02 |
| 584 | 688508 | 芯朋微 | 200 | 11,598.00 | 0.02 |
| 585 | 688677 | 海泰新光 | 200 | 11,348.00 | 0.02 |
| 586 | 300003 | 乐普医疗 | 500 | 11,305.00 | 0.02 |
| 587 | 603288 | 海天味业 | 240 | 11,244.00 | 0.02 |
| 588 | 002114 | 罗平锌电 | 1,700 | 11,237.00 | 0.02 |
| 589 | 300724 | 捷佳伟创 | 100 | 11,235.00 | 0.02 |
| 590 | 601225 | 陕西煤业 | 600 | 10,914.00 | 0.02 |
| 591 | 300388 | 节能国祯 | 1,600 | 10,736.00 | 0.02 |
| 592 | 300394 | 天孚通信 | 100 | 10,683.00 | 0.02 |
| 593 | 300443 | 金雷股份 | 300 | 10,635.00 | 0.02 |
| 594 | 603986 | 兆易创新 | 100 | 10,625.00 | 0.02 |
| 595 | 600765 | 中航重机 | 400 | 10,604.00 | 0.02 |
| 596 | 300631 | 久吾高科 | 300 | 10,494.00 | 0.02 |
| 597 | 002405 | 四维图新 | 900 | 10,422.00 | 0.02 |
| 598 | 601555 | 东吴证券 | 1,500 | 10,410.00 | 0.02 |
| 599 | 300037 | 新宙邦 | 200 | 10,378.00 | 0.02 |
| 600 | 002611 | 东方精工 | 1,800 | 10,332.00 | 0.02 |
| 601 | 300920 | 润阳科技 | 600 | 10,326.00 | 0.02 |
| 602 | 601058 | 赛轮轮胎 | 900 | 10,251.00 | 0.02 |
| 603 | 000828 | 东莞控股 | 1,100 | 10,065.00 | 0.02 |
| 604 | 000672 | 上峰水泥 | 1,100 | 10,043.00 | 0.02 |
| 605 | 600497 | 驰宏锌锗 | 2,000 | 10,040.00 | 0.02 |
| 606 | 002739 | 万达电影 | 800 | 10,032.00 | 0.02 |
| 607 | 300183 | 东软载波 | 600 | 9,906.00 | 0.02 |
| 608 | 002664 | 信质集团 | 700 | 9,856.00 | 0.02 |
| 609 | 603501 | 韦尔股份 | 100 | 9,804.00 | 0.02 |
| 610 | 300002 | 神州泰岳 | 700 | 9,800.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 611 | 603010 | 万盛股份 | 900 | 9,783.00 | 0.02 |
| 612 | 601658 | 邮储银行 | 2,000 | 9,780.00 | 0.02 |
| 613 | 300326 | 凯利泰 | 1,500 | 9,750.00 | 0.02 |
| 614 | 603466 | 风语筑 | 700 | 9,730.00 | 0.02 |
| 615 | 605318 | 法狮龙 | 700 | 9,702.00 | 0.02 |
| 616 | 000066 | 中国长城 | 700 | 9,681.00 | 0.02 |
| 617 | 300383 | 光环新网 | 900 | 9,675.00 | 0.02 |
| 618 | 002812 | 恩捷股份 | 100 | 9,635.00 | 0.02 |
| 619 | 605009 | 豪悦护理 | 200 | 9,600.00 | 0.02 |
| 620 | 600839 | 四川长虹 | 1,900 | 9,595.00 | 0.02 |
| 621 | 002066 | 瑞泰科技 | 800 | 9,560.00 | 0.02 |
| 622 | 000938 | 紫光股份 | 300 | 9,555.00 | 0.02 |
| 623 | 600885 | 宏发股份 | 300 | 9,555.00 | 0.02 |
| 624 | 002517 | 恺英网络 | 600 | 9,444.00 | 0.02 |
| 625 | 300743 | 天地数码 | 600 | 9,432.00 | 0.02 |
| 626 | 688189 | 南新制药 | 1,000 | 9,410.00 | 0.02 |
| 627 | 600482 | 中国动力 | 400 | 9,376.00 | 0.02 |
| 628 | 002028 | 思源电气 | 200 | 9,344.00 | 0.02 |
| 629 | 002049 | 紫光国微 | 100 | 9,325.00 | 0.02 |
| 630 | 300774 | 倍杰特 | 800 | 9,312.00 | 0.02 |
| 631 | 002436 | 兴森科技 | 600 | 9,300.00 | 0.02 |
| 632 | 000636 | 风华高科 | 600 | 9,204.00 | 0.02 |
| 633 | 601985 | 中国核电 | 1,300 | 9,165.00 | 0.02 |
| 634 | 002218 | 拓日新能 | 1,900 | 9,120.00 | 0.02 |
| 635 | 603059 | 倍加洁 | 400 | 9,096.00 | 0.02 |
| 636 | 002050 | 三花智控 | 300 | 9,078.00 | 0.02 |
| 637 | 002558 | 巨人网络 | 500 | 8,965.00 | 0.02 |
| 638 | 002295 | 精艺股份 | 1,300 | 8,931.00 | 0.02 |
| 639 | 000807 | 云铝股份 | 700 | 8,911.00 | 0.02 |
| 640 | 300745 | 欣锐科技 | 200 | 8,834.00 | 0.02 |
| 641 | 000756 | 新华制药 | 400 | 8,632.00 | 0.02 |
| 642 | 603206 | 嘉环科技 | 500 | 8,625.00 | 0.02 |
| 643 | 688088 | 虹软科技 | 200 | 8,550.00 | 0.02 |
| 644 | 688419 | 耐科装备 | 200 | 8,516.00 | 0.02 |
| 645 | 300046 | 台基股份 | 500 | 8,385.00 | 0.02 |
| 646 | 002463 | 沪电股份 | 400 | 8,376.00 | 0.02 |
| 647 | 688332 | 中科蓝讯 | 100 | 8,368.00 | 0.02 |
| 648 | 002662 | 京威股份 | 2,500 | 8,325.00 | 0.02 |
| 649 | 688203 | 海正生材 | 600 | 8,268.00 | 0.02 |
| 650 | 688589 | 力合微 | 200 | 8,148.00 | 0.01 |
| 651 | 688379 | 华光新材 | 400 | 8,124.00 | 0.01 |
| 652 | 600707 | 彩虹股份 | 1,700 | 8,092.00 | 0.01 |
| 653 | 002438 | 江苏神通 | 700 | 8,036.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 654 | 688217 | 睿昂基因 | 200 | 8,030.00 | 0.01 |
| 655 | 000014 | 沙河股份 | 700 | 8,008.00 | 0.01 |
| 656 | 300873 | 海晨股份 | 400 | 7,956.00 | 0.01 |
| 657 | 605077 | 华康股份 | 300 | 7,944.00 | 0.01 |
| 658 | 300909 | 汇创达 | 300 | 7,926.00 | 0.01 |
| 659 | 300785 | 值得买 | 300 | 7,854.00 | 0.01 |
| 660 | 000887 | 中鼎股份 | 600 | 7,854.00 | 0.01 |
| 661 | 600207 | 安彩高科 | 1,300 | 7,839.00 | 0.01 |
| 662 | 688625 | 呈和科技 | 200 | 7,838.00 | 0.01 |
| 663 | 600981 | 汇鸿集团 | 2,700 | 7,830.00 | 0.01 |
| 664 | 300292 | 吴通控股 | 2,000 | 7,800.00 | 0.01 |
| 665 | 000548 | 湖南投资 | 1,600 | 7,744.00 | 0.01 |
| 666 | 300837 | 浙矿股份 | 200 | 7,680.00 | 0.01 |
| 667 | 002081 | 金螳螂 | 1,700 | 7,667.00 | 0.01 |
| 668 | 000707 | 双环科技 | 900 | 7,650.00 | 0.01 |
| 669 | 002498 | 汉缆股份 | 1,900 | 7,619.00 | 0.01 |
| 670 | 002137 | 实益达 | 1,100 | 7,601.00 | 0.01 |
| 671 | 002093 | 国脉科技 | 900 | 7,596.00 | 0.01 |
| 672 | 000605 | 渤海股份 | 1,200 | 7,584.00 | 0.01 |
| 673 | 300286 | 安科瑞 | 200 | 7,572.00 | 0.01 |
| 674 | 600884 | 杉杉股份 | 500 | 7,570.00 | 0.01 |
| 675 | 300306 | 远方信息 | 600 | 7,566.00 | 0.01 |
| 676 | 002391 | 长青股份 | 1,100 | 7,557.00 | 0.01 |
| 677 | 603882 | 金域医学 | 100 | 7,550.00 | 0.01 |
| 678 | 605066 | 天正电气 | 800 | 7,528.00 | 0.01 |
| 679 | 300468 | 四方精创 | 700 | 7,497.00 | 0.01 |
| 680 | 000822 | 山东海化 | 1,100 | 7,491.00 | 0.01 |
| 681 | 600155 | 华创云信 | 1,200 | 7,464.00 | 0.01 |
| 682 | 002228 | 合兴包装 | 2,300 | 7,429.00 | 0.01 |
| 683 | 002022 | 科华生物 | 700 | 7,420.00 | 0.01 |
| 684 | 600872 | 中炬高新 | 200 | 7,358.00 | 0.01 |
| 685 | 300047 | 天源迪科 | 900 | 7,326.00 | 0.01 |
| 686 | 002409 | 雅克科技 | 100 | 7,288.00 | 0.01 |
| 687 | 002472 | 双环传动 | 200 | 7,260.00 | 0.01 |
| 688 | 000009 | 中国宝安 | 600 | 7,242.00 | 0.01 |
| 689 | 300146 | 汤臣倍健 | 300 | 7,194.00 | 0.01 |
| 690 | 600111 | 北方稀土 | 300 | 7,194.00 | 0.01 |
| 691 | 600660 | 福耀玻璃 | 200 | 7,170.00 | 0.01 |
| 692 | 002738 | 中矿资源 | 140 | 7,131.60 | 0.01 |
| 693 | 688013 | 天臣医疗 | 300 | 7,113.00 | 0.01 |
| 694 | 300715 | 凯伦股份 | 500 | 7,090.00 | 0.01 |
| 695 | 300004 | 南风股份 | 1,300 | 7,020.00 | 0.01 |
| 696 | 002466 | 天齐锂业 | 100 | 6,991.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 697 | 000541 | 佛山照明 | 1,200 | 6,852.00 | 0.01 |
| 698 | 603272 | 联翔股份 | 400 | 6,784.00 | 0.01 |
| 699 | 002156 | 通富微电 | 300 | 6,780.00 | 0.01 |
| 700 | 300058 | 蓝色光标 | 700 | 6,769.00 | 0.01 |
| 701 | 002624 | 完美世界 | 400 | 6,756.00 | 0.01 |
| 702 | 605058 | 澳弘电子 | 300 | 6,735.00 | 0.01 |
| 703 | 000534 | 万泽股份 | 400 | 6,708.00 | 0.01 |
| 704 | 688098 | 申联生物 | 900 | 6,642.00 | 0.01 |
| 705 | 002870 | 香山股份 | 200 | 6,634.00 | 0.01 |
| 706 | 301109 | 军信股份 | 400 | 6,604.00 | 0.01 |
| 707 | 300599 | 雄塑科技 | 800 | 6,584.00 | 0.01 |
| 708 | 001211 | 双枪科技 | 300 | 6,579.00 | 0.01 |
| 709 | 688551 | 科威尔 | 100 | 6,558.00 | 0.01 |
| 710 | 002966 | 苏州银行 | 1,000 | 6,550.00 | 0.01 |
| 711 | 688349 | 三一重能 | 200 | 6,444.00 | 0.01 |
| 712 | 002185 | 华天科技 | 700 | 6,440.00 | 0.01 |
| 713 | 603586 | 金麒麟 | 400 | 6,388.00 | 0.01 |
| 714 | 000632 | 三木集团 | 1,500 | 6,345.00 | 0.01 |
| 715 | 300956 | 英力股份 | 400 | 6,292.00 | 0.01 |
| 716 | 688065 | 凯赛生物 | 100 | 6,226.00 | 0.01 |
| 717 | 002625 | 光启技术 | 400 | 6,104.00 | 0.01 |
| 718 | 600536 | 中国软件 | 130 | 6,094.40 | 0.01 |
| 719 | 002282 | 博深股份 | 800 | 6,072.00 | 0.01 |
| 720 | 600027 | 华电国际 | 900 | 6,021.00 | 0.01 |
| 721 | 300405 | 科隆股份 | 1,100 | 6,017.00 | 0.01 |
| 722 | 600129 | 太极集团 | 100 | 5,949.00 | 0.01 |
| 723 | 688621 | 阳光诺和 | 100 | 5,882.00 | 0.01 |
| 724 | 601108 | 财通证券 | 800 | 5,792.00 | 0.01 |
| 725 | 688636 | 智明达 | 100 | 5,500.00 | 0.01 |
| 726 | 300285 | 国瓷材料 | 200 | 5,480.00 | 0.01 |
| 727 | 300951 | 博硕科技 | 100 | 5,463.00 | 0.01 |
| 728 | 300868 | 杰美特 | 300 | 5,460.00 | 0.01 |
| 729 | 300315 | 掌趣科技 | 700 | 5,460.00 | 0.01 |
| 730 | 002271 | 东方雨虹 | 200 | 5,452.00 | 0.01 |
| 731 | 600161 | 天坛生物 | 200 | 5,430.00 | 0.01 |
| 732 | 688793 | 倍轻松 | 100 | 5,390.00 | 0.01 |
| 733 | 600988 | 赤峰黄金 | 400 | 5,384.00 | 0.01 |
| 734 | 000423 | 东阿阿胶 | 100 | 5,345.00 | 0.01 |
| 735 | 601233 | 桐昆股份 | 400 | 5,300.00 | 0.01 |
| 736 | 002008 | 大族激光 | 200 | 5,240.00 | 0.01 |
| 737 | 688011 | 新光光电 | 200 | 5,164.00 | 0.01 |
| 738 | 300568 | 星源材质 | 300 | 5,157.00 | 0.01 |
| 739 | 603980 | 吉华集团 | 1,200 | 5,124.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 740 | 600096 | 云天化 | 300 | 5,121.00 | 0.01 |
| 741 | 002613 | 北玻股份 | 1,100 | 5,093.00 | 0.01 |
| 742 | 603019 | 中科曙光 | 100 | 5,090.00 | 0.01 |
| 743 | 600082 | 海泰发展 | 1,600 | 5,040.00 | 0.01 |
| 744 | 600418 | 江淮汽车 | 400 | 5,036.00 | 0.01 |
| 745 | 300073 | 当升科技 | 100 | 5,033.00 | 0.01 |
| 746 | 603900 | 莱绅通灵 | 800 | 5,024.00 | 0.01 |
| 747 | 300169 | 天晟新材 | 1,200 | 5,016.00 | 0.01 |
| 748 | 002044 | 美年健康 | 700 | 4,977.00 | 0.01 |
| 749 | 603368 | 柳药集团 | 200 | 4,942.00 | 0.01 |
| 750 | 603589 | 口子窖 | 100 | 4,935.00 | 0.01 |
| 751 | 300395 | 菲利华 | 100 | 4,920.00 | 0.01 |
| 752 | 000977 | 浪潮信息 | 100 | 4,850.00 | 0.01 |
| 753 | 601162 | 天风证券 | 1,600 | 4,768.00 | 0.01 |
| 754 | 688293 | 奥浦迈 | 100 | 4,767.00 | 0.01 |
| 755 | 002589 | 瑞康医药 | 1,400 | 4,760.00 | 0.01 |
| 756 | 300604 | 长川科技 | 100 | 4,749.00 | 0.01 |
| 757 | 605255 | 天普股份 | 300 | 4,740.00 | 0.01 |
| 758 | 002385 | 大北农 | 700 | 4,620.00 | 0.01 |
| 759 | 688626 | 翔宇医疗 | 100 | 4,551.00 | 0.01 |
| 760 | 603045 | 福达合金 | 300 | 4,542.00 | 0.01 |
| 761 | 600009 | 上海机场 | 100 | 4,542.00 | 0.01 |
| 762 | 002179 | 中航光电 | 100 | 4,535.00 | 0.01 |
| 763 | 601006 | 大秦铁路 | 600 | 4,458.00 | 0.01 |
| 764 | 300122 | 智飞生物 | 100 | 4,420.00 | 0.01 |
| 765 | 300535 | 达威股份 | 300 | 4,368.00 | 0.01 |
| 766 | 688567 | 孚能科技 | 200 | 4,318.00 | 0.01 |
| 767 | 600893 | 航发动力 | 100 | 4,226.00 | 0.01 |
| 768 | 600794 | 保税科技 | 1,200 | 4,224.00 | 0.01 |
| 769 | 002303 | 美盈森 | 1,300 | 4,199.00 | 0.01 |
| 770 | 002709 | 天赐材料 | 100 | 4,119.00 | 0.01 |
| 771 | 002368 | 太极股份 | 100 | 4,117.00 | 0.01 |
| 772 | 600999 | 招商证券 | 300 | 4,071.00 | 0.01 |
| 773 | 300136 | 信维通信 | 200 | 4,016.00 | 0.01 |
| 774 | 603313 | 梦百合 | 400 | 4,012.00 | 0.01 |
| 775 | 002407 | 多氟多 | 200 | 3,972.00 | 0.01 |
| 776 | 603739 | 蔚蓝生物 | 300 | 3,933.00 | 0.01 |
| 777 | 000933 | 神火股份 | 300 | 3,900.00 | 0.01 |
| 778 | 600958 | 东方证券 | 400 | 3,880.00 | 0.01 |
| 779 | 002261 | 拓维信息 | 200 | 3,862.00 | 0.01 |
| 780 | 600807 | 济南高新 | 1,300 | 3,835.00 | 0.01 |
| 781 | 600705 | 中航产融 | 1,000 | 3,830.00 | 0.01 |
| 782 | 603816 | 顾家家居 | 100 | 3,815.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 783 | 601326 | 秦港股份 | 1,100 | 3,718.00 | 0.01 |
| 784 | 603939 | 益丰药房 | 100 | 3,700.00 | 0.01 |
| 785 | 300096 | 易联众 | 600 | 3,684.00 | 0.01 |
| 786 | 605358 | 立昂微 | 100 | 3,673.00 | 0.01 |
| 787 | 002568 | 百润股份 | 100 | 3,635.00 | 0.01 |
| 788 | 600298 | 安琪酵母 | 100 | 3,621.00 | 0.01 |
| 789 | 002223 | 鱼跃医疗 | 100 | 3,599.00 | 0.01 |
| 790 | 300390 | 天华新能 | 100 | 3,580.00 | 0.01 |
| 791 | 002176 | 江特电机 | 300 | 3,576.00 | 0.01 |
| 792 | 002497 | 雅化集团 | 200 | 3,556.00 | 0.01 |
| 793 | 688367 | 工大高科 | 200 | 3,536.00 | 0.01 |
| 794 | 600771 | 广誉远 | 100 | 3,527.00 | 0.01 |
| 795 | 000975 | 银泰黄金 | 300 | 3,510.00 | 0.01 |
| 796 | 002555 | 三七互娱 | 100 | 3,488.00 | 0.01 |
| 797 | 002600 | 领益智造 | 500 | 3,455.00 | 0.01 |
| 798 | 605336 | 帅丰电器 | 200 | 3,440.00 | 0.01 |
| 799 | 301176 | 逸豪新材 | 200 | 3,436.00 | 0.01 |
| 800 | 002430 | 杭氧股份 | 100 | 3,436.00 | 0.01 |
| 801 | 002798 | 帝欧家居 | 500 | 3,385.00 | 0.01 |
| 802 | 000860 | 顺鑫农业 | 100 | 3,369.00 | 0.01 |
| 803 | 000818 | 航锦科技 | 100 | 3,337.00 | 0.01 |
| 804 | 300024 | 机器人 | 200 | 3,334.00 | 0.01 |
| 805 | 300768 | 迪普科技 | 200 | 3,314.00 | 0.01 |
| 806 | 688585 | 上纬新材 | 400 | 3,292.00 | 0.01 |
| 807 | 002410 | 广联达 | 100 | 3,249.00 | 0.01 |
| 808 | 300253 | 卫宁健康 | 300 | 3,246.00 | 0.01 |
| 809 | 002240 | 盛新锂能 | 100 | 3,187.00 | 0.01 |
| 810 | 601168 | 西部矿业 | 300 | 3,153.00 | 0.01 |
| 811 | 603682 | 锦和商管 | 600 | 3,150.00 | 0.01 |
| 812 | 300277 | 海联讯 | 400 | 3,136.00 | 0.01 |
| 813 | 600356 | 恒丰纸业 | 400 | 3,132.00 | 0.01 |
| 814 | 002294 | 信立泰 | 100 | 3,119.00 | 0.01 |
| 815 | 600584 | 长电科技 | 100 | 3,117.00 | 0.01 |
| 816 | 002465 | 海格通信 | 300 | 3,102.00 | 0.01 |
| 817 | 300699 | 光威复材 | 100 | 3,085.00 | 0.01 |
| 818 | 600426 | 华鲁恒升 | 100 | 3,063.00 | 0.01 |
| 819 | 300595 | 欧普康视 | 100 | 3,019.00 | 0.01 |
| 820 | 002439 | 启明星辰 | 100 | 2,976.00 | 0.01 |
| 821 | 301237 | 和顺科技 | 100 | 2,969.00 | 0.01 |
| 822 | 000831 | 中国稀土 | 100 | 2,960.00 | 0.01 |
| 823 | 600066 | 宇通客车 | 200 | 2,948.00 | 0.01 |
| 824 | 603000 | 人民网 | 100 | 2,920.00 | 0.01 |
| 825 | 600361 | 创新新材 | 600 | 2,880.00 | 0.01 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 826 | 600727 | 鲁北化工 | 500 | 2,850.00 | 0.01 |
| 827 | 301055 | 张小泉 | 200 | 2,846.00 | 0.01 |
| 828 | 688057 | 金达莱 | 200 | 2,846.00 | 0.01 |
| 829 | 600118 | 中国卫星 | 100 | 2,821.00 | 0.01 |
| 830 | 600160 | 巨化股份 | 200 | 2,756.00 | 0.01 |
| 831 | 002064 | 华峰化学 | 400 | 2,744.00 | 0.01 |
| 832 | 601128 | 常熟银行 | 400 | 2,728.00 | 0.00 |
| 833 | 600251 | 冠农股份 | 300 | 2,709.00 | 0.00 |
| 834 | 600873 | 梅花生物 | 300 | 2,679.00 | 0.00 |
| 835 | 300142 | 沃森生物 | 100 | 2,645.00 | 0.00 |
| 836 | 002779 | 中坚科技 | 100 | 2,631.00 | 0.00 |
| 837 | 601099 | 太平洋 | 1,000 | 2,580.00 | 0.00 |
| 838 | 600392 | 盛和资源 | 200 | 2,574.00 | 0.00 |
| 839 | 300118 | 东方日升 | 100 | 2,563.00 | 0.00 |
| 840 | 603687 | 大胜达 | 300 | 2,556.00 | 0.00 |
| 841 | 600879 | 航天电子 | 300 | 2,547.00 | 0.00 |
| 842 | 600177 | 雅戈尔 | 400 | 2,524.00 | 0.00 |
| 843 | 601360 | 三六零 | 200 | 2,508.00 | 0.00 |
| 844 | 000729 | 燕京啤酒 | 200 | 2,494.00 | 0.00 |
| 845 | 600060 | 海信视像 | 100 | 2,475.00 | 0.00 |
| 846 | 300054 | 鼎龙股份 | 100 | 2,473.00 | 0.00 |
| 847 | 601990 | 南京证券 | 300 | 2,454.00 | 0.00 |
| 848 | 001230 | 劲旅环境 | 100 | 2,451.00 | 0.00 |
| 849 | 600559 | 老白干酒 | 100 | 2,451.00 | 0.00 |
| 850 | 300339 | 润和软件 | 100 | 2,396.00 | 0.00 |
| 851 | 002532 | 天山铝业 | 400 | 2,396.00 | 0.00 |
| 852 | 002138 | 顺络电子 | 100 | 2,391.00 | 0.00 |
| 853 | 600547 | 山东黄金 | 100 | 2,348.00 | 0.00 |
| 854 | 000400 | 许继电气 | 100 | 2,305.00 | 0.00 |
| 855 | 600777 | 新潮能源 | 900 | 2,277.00 | 0.00 |
| 856 | 600141 | 兴发集团 | 100 | 2,222.00 | 0.00 |
| 857 | 002389 | 航天彩虹 | 100 | 2,221.00 | 0.00 |
| 858 | 600235 | 民丰特纸 | 400 | 2,168.00 | 0.00 |
| 859 | 000683 | 远兴能源 | 300 | 2,157.00 | 0.00 |
| 860 | 002078 | 太阳纸业 | 200 | 2,138.00 | 0.00 |
| 861 | 601696 | 中银证券 | 200 | 2,132.00 | 0.00 |
| 862 | 600638 | 新黄浦 | 400 | 2,116.00 | 0.00 |
| 863 | 600642 | 申能股份 | 300 | 2,097.00 | 0.00 |
| 864 | 603212 | 赛伍技术 | 100 | 2,081.00 | 0.00 |
| 865 | 002372 | 伟星新材 | 100 | 2,054.00 | 0.00 |
| 866 | 002803 | 吉宏股份 | 100 | 2,046.00 | 0.00 |
| 867 | 000021 | 深科技 | 100 | 1,999.00 | 0.00 |
| 868 | 600859 | 王府井 | 100 | 1,979.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 869 | 600325 | 华发股份 | 200 | 1,970.00 | 0.00 |
| 870 | 600746 | 江苏索普 | 300 | 1,959.00 | 0.00 |
| 871 | 000629 | 钒钛股份 | 500 | 1,955.00 | 0.00 |
| 872 | 300459 | 汤姆猫 | 300 | 1,947.00 | 0.00 |
| 873 | 601609 | 金田股份 | 300 | 1,947.00 | 0.00 |
| 874 | 300068 | 南都电源 | 100 | 1,936.00 | 0.00 |
| 875 | 603003 | 龙宇股份 | 200 | 1,910.00 | 0.00 |
| 876 | 002673 | 西部证券 | 300 | 1,905.00 | 0.00 |
| 877 | 600549 | 厦门钨业 | 100 | 1,903.00 | 0.00 |
| 878 | 603022 | 新通联 | 200 | 1,882.00 | 0.00 |
| 879 | 600714 | 金瑞矿业 | 200 | 1,874.00 | 0.00 |
| 880 | 600521 | 华海药业 | 100 | 1,841.00 | 0.00 |
| 881 | 002241 | 歌尔股份 | 100 | 1,775.00 | 0.00 |
| 882 | 600699 | 均胜电子 | 100 | 1,764.00 | 0.00 |
| 883 | 603657 | 春光科技 | 100 | 1,755.00 | 0.00 |
| 884 | 600143 | 金发科技 | 200 | 1,746.00 | 0.00 |
| 885 | 002195 | 二三四五 | 600 | 1,734.00 | 0.00 |
| 886 | 300589 | 江龙船艇 | 100 | 1,567.00 | 0.00 |
| 887 | 600076 | 康欣新材 | 600 | 1,542.00 | 0.00 |
| 888 | 000998 | 隆平高科 | 100 | 1,535.00 | 0.00 |
| 889 | 002065 | 东华软件 | 200 | 1,412.00 | 0.00 |
| 890 | 600481 | 双良节能 | 100 | 1,398.00 | 0.00 |
| 891 | 300069 | 金利华电 | 100 | 1,364.00 | 0.00 |
| 892 | 001979 | 招商蛇口 | 100 | 1,303.00 | 0.00 |
| 893 | 600380 | 健康元 | 100 | 1,271.00 | 0.00 |
| 894 | 300103 | 达刚控股 | 200 | 1,228.00 | 0.00 |
| 895 | 601377 | 兴业证券 | 200 | 1,224.00 | 0.00 |
| 896 | 002152 | 广电运通 | 100 | 1,172.00 | 0.00 |
| 897 | 000719 | 中原传媒 | 100 | 1,170.00 | 0.00 |
| 898 | 600499 | 科达制造 | 100 | 1,136.00 | 0.00 |
| 899 | 300849 | 锦盛新材 | 100 | 1,086.00 | 0.00 |
| 900 | 600021 | 上海电力 | 100 | 1,077.00 | 0.00 |
| 901 | 600399 | 抚顺特钢 | 100 | 1,020.00 | 0.00 |
| 902 | 600711 | 盛屯矿业 | 200 | 972.00 | 0.00 |
| 903 | 000166 | 申万宏源 | 200 | 924.00 | 0.00 |
| 904 | 600010 | 包钢股份 | 500 | 895.00 | 0.00 |
| 905 | 601198 | 东兴证券 | 100 | 802.00 | 0.00 |
| 906 | 601009 | 南京银行 | 100 | 800.00 | 0.00 |
| 907 | 601577 | 长沙银行 | 100 | 776.00 | 0.00 |
| 908 | 603077 | 和邦生物 | 300 | 729.00 | 0.00 |
| 909 | 000703 | 恒逸石化 | 100 | 678.00 | 0.00 |
| 910 | 300088 | 长信科技 | 100 | 603.00 | 0.00 |
| 911 | 002145 | 中核钛白 | 100 | 589.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|--------|------|
| 912 | 000488 | 晨鸣纸业 | 100 | 485.00 | 0.00 |
| 913 | 002701 | 奥瑞金 | 100 | 451.00 | 0.00 |
| 914 | 601016 | 节能风电 | 100 | 367.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 601318 | 中国平安 | 2,293,690.00 | 5.43 |
| 2 | 688599 | 天合光能 | 1,998,344.44 | 4.73 |
| 3 | 301039 | 中集车辆 | 1,857,274.46 | 4.39 |
| 4 | 603688 | 石英股份 | 1,843,717.00 | 4.36 |
| 5 | 601319 | 中国人保 | 1,811,672.00 | 4.29 |
| 6 | 601012 | 隆基绿能 | 1,775,128.00 | 4.20 |
| 7 | 002603 | 以岭药业 | 1,636,341.00 | 3.87 |
| 8 | 601766 | 中国中车 | 1,577,337.00 | 3.73 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 1,576,524.00 | 3.73 |
| 10 | 300207 | 欣旺达 | 1,574,533.00 | 3.73 |
| 11 | 603613 | 国联股份 | 1,551,250.00 | 3.67 |
| 12 | 002192 | 融捷股份 | 1,508,922.00 | 3.57 |
| 13 | 002056 | 横店东磁 | 1,492,240.52 | 3.53 |
| 14 | 000538 | 云南白药 | 1,427,352.00 | 3.38 |
| 15 | 601916 | 浙商银行 | 1,406,486.40 | 3.33 |
| 16 | 300232 | 洲明科技 | 1,405,898.00 | 3.33 |
| 17 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,353,586.00 | 3.20 |
| 18 | 601669 | 中国电建 | 1,350,191.00 | 3.19 |
| 19 | 600688 | 上海石化 | 1,336,002.00 | 3.16 |
| 20 | 300750 | 宁德时代 | 1,317,517.00 | 3.12 |
| 21 | 688223 | 晶科能源 | 1,312,450.99 | 3.11 |
| 22 | 300316 | 晶盛机电 | 1,305,511.00 | 3.09 |
| 23 | 002466 | 天齐锂业 | 1,303,650.24 | 3.08 |
| 24 | 601169 | 北京银行 | 1,291,781.00 | 3.06 |
| 25 | 600433 | 冠豪高新 | 1,281,947.00 | 3.03 |
| 26 | 002049 | 紫光国微 | 1,268,955.00 | 3.00 |
| 27 | 600491 | 龙元建设 | 1,257,190.00 | 2.97 |
| 28 | 300861 | 美畅股份 | 1,251,329.00 | 2.96 |
| 29 | 600900 | 长江电力 | 1,242,537.00 | 2.94 |
| 30 | 600150 | 中国船舶 | 1,234,310.00 | 2.92 |
| 31 | 002475 | 立讯精密 | 1,217,032.40 | 2.88 |
| 32 | 002625 | 光启技术 | 1,216,715.00 | 2.88 |
| 33 | 601600 | 中国铝业 | 1,208,728.00 | 2.86 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 34 | 605589 | 圣泉集团 | 1,204,529.00 | 2.85 |
| 35 | 600809 | 山西汾酒 | 1,196,286.00 | 2.83 |
| 36 | 601939 | 建设银行 | 1,181,521.00 | 2.80 |
| 37 | 601009 | 南京银行 | 1,181,030.00 | 2.79 |
| 38 | 002990 | 盛视科技 | 1,178,310.00 | 2.79 |
| 39 | 600926 | 杭州银行 | 1,177,237.00 | 2.79 |
| 40 | 688363 | 华熙生物 | 1,176,513.35 | 2.78 |
| 41 | 003035 | 南网能源 | 1,156,232.24 | 2.74 |
| 42 | 688348 | 昱能科技 | 1,153,779.10 | 2.73 |
| 43 | 688063 | 派能科技 | 1,133,379.82 | 2.68 |
| 44 | 601818 | 光大银行 | 1,129,709.00 | 2.67 |
| 45 | 002746 | 仙坛股份 | 1,126,287.00 | 2.66 |
| 46 | 603345 | 安井食品 | 1,121,543.00 | 2.65 |
| 47 | 300896 | 爱美客 | 1,119,815.00 | 2.65 |
| 48 | 600353 | 旭光电子 | 1,097,695.00 | 2.60 |
| 49 | 301095 | 广立微 | 1,087,180.40 | 2.57 |
| 50 | 688009 | 中国通号 | 1,065,352.12 | 2.52 |
| 51 | 002050 | 三花智控 | 1,064,718.00 | 2.52 |
| 52 | 300839 | 博汇股份 | 1,061,513.00 | 2.51 |
| 53 | 600887 | 伊利股份 | 1,061,035.00 | 2.51 |
| 54 | 603306 | 华懋科技 | 1,059,874.00 | 2.51 |
| 55 | 603799 | 华友钴业 | 1,057,874.00 | 2.50 |
| 56 | 300185 | 通裕重工 | 1,056,007.00 | 2.50 |
| 57 | 601966 | 玲珑轮胎 | 1,055,070.00 | 2.50 |
| 58 | 300630 | 普利制药 | 1,046,469.00 | 2.48 |
| 59 | 601898 | 中煤能源 | 1,037,827.00 | 2.46 |
| 60 | 000776 | 广发证券 | 1,037,577.00 | 2.45 |
| 61 | 600728 | 佳都科技 | 1,036,971.00 | 2.45 |
| 62 | 300017 | 网宿科技 | 1,035,235.00 | 2.45 |
| 63 | 002315 | 焦点科技 | 1,034,546.00 | 2.45 |
| 64 | 000728 | 国元证券 | 1,027,768.00 | 2.43 |
| 65 | 601995 | 中金公司 | 1,019,045.00 | 2.41 |
| 66 | 601628 | 中国人寿 | 1,017,779.00 | 2.41 |
| 67 | 601619 | 嘉泽新能 | 998,708.00 | 2.36 |
| 68 | 603027 | 千禾味业 | 995,813.20 | 2.36 |
| 69 | 603567 | 珍宝岛 | 993,190.00 | 2.35 |
| 70 | 000733 | 振华科技 | 984,939.00 | 2.33 |
| 71 | 601336 | 新华保险 | 977,664.36 | 2.31 |
| 72 | 301089 | 拓新药业 | 976,176.00 | 2.31 |
| 73 | 002839 | 张家港行 | 974,960.00 | 2.31 |
| 74 | 000738 | 航发控制 | 974,803.00 | 2.31 |
| 75 | 002459 | 晶澳科技 | 974,011.00 | 2.30 |
| 76 | 000333 | 美的集团 | 972,982.00 | 2.30 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 77 | 000858 | 五 粮 液 | 972,419.00 | 2.30 |
| 78 | 002250 | 联化科技 | 971,424.00 | 2.30 |
| 79 | 300777 | 中简科技 | 956,950.00 | 2.26 |
| 80 | 001269 | 欧晶科技 | 954,109.00 | 2.26 |
| 81 | 600143 | 金发科技 | 952,549.00 | 2.25 |
| 82 | 301017 | 漱玉平民 | 951,608.00 | 2.25 |
| 83 | 601688 | 华泰证券 | 950,980.00 | 2.25 |
| 84 | 600570 | 恒生电子 | 948,338.00 | 2.24 |
| 85 | 600850 | 电科数字 | 946,032.00 | 2.24 |
| 86 | 601658 | 邮储银行 | 945,599.00 | 2.24 |
| 87 | 000338 | 潍柴动力 | 943,505.00 | 2.23 |
| 88 | 688126 | 沪硅产业 | 939,620.81 | 2.22 |
| 89 | 000997 | 新 大 陆 | 937,256.00 | 2.22 |
| 90 | 300002 | 神州泰岳 | 924,825.00 | 2.19 |
| 91 | 600008 | 首创环保 | 924,734.00 | 2.19 |
| 92 | 002594 | 比亚迪 | 923,368.00 | 2.18 |
| 93 | 000739 | 普洛药业 | 912,355.00 | 2.16 |
| 94 | 603229 | 奥翔药业 | 901,805.00 | 2.13 |
| 95 | 603399 | 吉翔股份 | 897,852.00 | 2.12 |
| 96 | 000831 | 中国稀土 | 890,244.00 | 2.11 |
| 97 | 601881 | 中国银河 | 877,747.00 | 2.08 |
| 98 | 600066 | 宇通客车 | 873,986.00 | 2.07 |
| 99 | 002299 | 圣农发展 | 871,216.00 | 2.06 |
| 100 | 300015 | 爱尔眼科 | 870,977.00 | 2.06 |
| 101 | 688516 | 奥特维 | 870,727.83 | 2.06 |
| 102 | 600050 | 中国联通 | 869,847.00 | 2.06 |
| 103 | 601618 | 中国中冶 | 866,320.00 | 2.05 |
| 104 | 600489 | 中金黄金 | 865,583.00 | 2.05 |
| 105 | 600036 | 招商银行 | 859,021.00 | 2.03 |
| 106 | 300842 | 帝科股份 | 856,028.00 | 2.03 |
| 107 | 000581 | 威孚高科 | 852,632.00 | 2.02 |
| 108 | 300634 | 彩讯股份 | 849,524.00 | 2.01 |
| 109 | 601028 | 玉龙股份 | 846,437.00 | 2.00 |

注：本期累计买入金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.2 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 | 600519 | 贵州茅台 | 1,960,809.00 | 4.64 |
| 2 | 002192 | 融捷股份 | 1,891,756.00 | 4.48 |
| 3 | 600150 | 中国船舶 | 1,832,803.08 | 4.34 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 1,730,197.70 | 4.09 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 5 | 301039 | 中集车辆 | 1,713,706.00 | 4.05 |
| 6 | 300207 | 欣旺达 | 1,692,216.00 | 4.00 |
| 7 | 300017 | 网宿科技 | 1,680,735.00 | 3.98 |
| 8 | 002594 | 比亚迪 | 1,665,162.00 | 3.94 |
| 9 | 002603 | 以岭药业 | 1,659,455.00 | 3.93 |
| 10 | 300750 | 宁德时代 | 1,644,682.00 | 3.89 |
| 11 | 002625 | 光启技术 | 1,635,479.21 | 3.87 |
| 12 | 300777 | 中简科技 | 1,602,862.00 | 3.79 |
| 13 | 601319 | 中国人保 | 1,563,870.00 | 3.70 |
| 14 | 002466 | 天齐锂业 | 1,504,062.60 | 3.56 |
| 15 | 601012 | 隆基绿能 | 1,494,062.00 | 3.53 |
| 16 | 603613 | 国联股份 | 1,486,209.00 | 3.52 |
| 17 | 601916 | 浙商银行 | 1,477,512.00 | 3.50 |
| 18 | 600157 | 永泰能源 | 1,456,868.00 | 3.45 |
| 19 | 603259 | 药明康德 | 1,368,577.00 | 3.24 |
| 20 | 688063 | 派能科技 | 1,365,675.72 | 3.23 |
| 21 | 300002 | 神州泰岳 | 1,302,619.00 | 3.08 |
| 22 | 600926 | 杭州银行 | 1,298,394.00 | 3.07 |
| 23 | 601766 | 中国中车 | 1,288,842.00 | 3.05 |
| 24 | 600433 | 冠豪高新 | 1,286,736.00 | 3.04 |
| 25 | 688223 | 晶科能源 | 1,280,962.24 | 3.03 |
| 26 | 601901 | 方正证券 | 1,268,647.00 | 3.00 |
| 27 | 002036 | 联创电子 | 1,242,535.00 | 2.94 |
| 28 | 600598 | 北大荒 | 1,241,237.00 | 2.94 |
| 29 | 002049 | 紫光国微 | 1,241,041.00 | 2.94 |
| 30 | 600491 | 龙元建设 | 1,237,386.00 | 2.93 |
| 31 | 003035 | 南网能源 | 1,217,658.58 | 2.88 |
| 32 | 002756 | 永兴材料 | 1,214,038.00 | 2.87 |
| 33 | 600688 | 上海石化 | 1,211,952.00 | 2.87 |
| 34 | 300232 | 洲明科技 | 1,207,856.00 | 2.86 |
| 35 | 605589 | 圣泉集团 | 1,203,208.88 | 2.85 |
| 36 | 002475 | 立讯精密 | 1,202,934.00 | 2.85 |
| 37 | 300861 | 美畅股份 | 1,201,136.00 | 2.84 |
| 38 | 002460 | 赣锋锂业 | 1,189,649.20 | 2.81 |
| 39 | 000001 | 平安银行 | 1,177,363.00 | 2.79 |
| 40 | 300316 | 晶盛机电 | 1,166,622.00 | 2.76 |
| 41 | 601009 | 南京银行 | 1,156,966.00 | 2.74 |
| 42 | 688599 | 天合光能 | 1,151,672.15 | 2.72 |
| 43 | 603345 | 安井食品 | 1,145,078.00 | 2.71 |
| 44 | 600353 | 旭光电子 | 1,122,230.00 | 2.66 |
| 45 | 301095 | 广立微 | 1,120,871.00 | 2.65 |
| 46 | 300630 | 普利制药 | 1,117,118.14 | 2.64 |
| 47 | 688363 | 华熙生物 | 1,113,321.06 | 2.63 |

| | | | | |
|----|--------|--------|--------------|------|
| 48 | 002315 | 焦点科技 | 1,106,534.00 | 2.62 |
| 49 | 002050 | 三花智控 | 1,075,279.00 | 2.54 |
| 50 | 688556 | 高测股份 | 1,062,334.37 | 2.51 |
| 51 | 002839 | 张家港行 | 1,055,412.00 | 2.50 |
| 52 | 600438 | 通威股份 | 1,051,965.78 | 2.49 |
| 53 | 000408 | 藏格矿业 | 1,046,077.00 | 2.47 |
| 54 | 688009 | 中国通号 | 1,044,923.23 | 2.47 |
| 55 | 600895 | 张江高科 | 1,040,771.00 | 2.46 |
| 56 | 603688 | 石英股份 | 1,038,631.00 | 2.46 |
| 57 | 300839 | 博汇股份 | 1,031,149.10 | 2.44 |
| 58 | 002082 | 万邦德 | 1,025,325.00 | 2.43 |
| 59 | 603306 | 华懋科技 | 1,021,758.00 | 2.42 |
| 60 | 000728 | 国元证券 | 1,011,526.00 | 2.39 |
| 61 | 688348 | 昱能科技 | 1,010,258.69 | 2.39 |
| 62 | 601898 | 中煤能源 | 1,003,292.00 | 2.37 |
| 63 | 000776 | 广发证券 | 1,002,267.00 | 2.37 |
| 64 | 002938 | 鹏鼎控股 | 998,024.00 | 2.36 |
| 65 | 300634 | 彩讯股份 | 992,154.00 | 2.35 |
| 66 | 600850 | 电科数字 | 990,658.00 | 2.34 |
| 67 | 002250 | 联化科技 | 983,969.00 | 2.33 |
| 68 | 600143 | 金发科技 | 981,519.00 | 2.32 |
| 69 | 601939 | 建设银行 | 980,011.00 | 2.32 |
| 70 | 600809 | 山西汾酒 | 968,902.00 | 2.29 |
| 71 | 688126 | 沪硅产业 | 968,731.89 | 2.29 |
| 72 | 301017 | 漱玉平民 | 960,716.00 | 2.27 |
| 73 | 601658 | 邮储银行 | 956,529.00 | 2.26 |
| 74 | 002318 | 久立特材 | 956,051.00 | 2.26 |
| 75 | 600008 | 首创环保 | 929,480.00 | 2.20 |
| 76 | 601881 | 中国银河 | 928,800.00 | 2.20 |
| 77 | 000733 | 振华科技 | 923,546.00 | 2.19 |
| 78 | 603399 | 吉翔股份 | 921,879.00 | 2.18 |
| 79 | 002129 | TCL 中环 | 908,859.25 | 2.15 |
| 80 | 601818 | 光大银行 | 905,337.00 | 2.14 |
| 81 | 300856 | 科思股份 | 903,056.00 | 2.14 |
| 82 | 000651 | 格力电器 | 902,741.00 | 2.14 |
| 83 | 603027 | 千禾味业 | 897,104.00 | 2.12 |
| 84 | 000088 | 盐田港 | 895,860.00 | 2.12 |
| 85 | 000338 | 潍柴动力 | 894,588.00 | 2.12 |
| 86 | 000538 | 云南白药 | 891,946.80 | 2.11 |
| 87 | 000739 | 普洛药业 | 889,399.00 | 2.10 |
| 88 | 600066 | 宇通客车 | 887,167.00 | 2.10 |
| 89 | 601688 | 华泰证券 | 887,114.00 | 2.10 |
| 90 | 600039 | 四川路桥 | 881,589.00 | 2.09 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 91 | 002299 | 圣农发展 | 880,161.00 | 2.08 |
| 92 | 688516 | 奥特维 | 878,394.32 | 2.08 |
| 93 | 603229 | 奥翔药业 | 871,278.20 | 2.06 |
| 94 | 000831 | 中国稀土 | 869,330.00 | 2.06 |
| 95 | 000738 | 航发控制 | 866,620.00 | 2.05 |
| 96 | 300014 | 亿纬锂能 | 864,110.00 | 2.04 |
| 97 | 002056 | 横店东磁 | 857,424.00 | 2.03 |
| 98 | 601600 | 中国铝业 | 850,432.00 | 2.01 |
| 99 | 002746 | 仙坛股份 | 847,404.00 | 2.00 |

注：本期累计卖出金额按买卖成交金额，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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 | 359,582,019.48 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 350,530,209.19 |

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|--------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 2,528,145.15 | 4.61 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 1,100.12 | 0.00 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 2,529,245.27 | 4.62 |

7.6 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债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019688 | 22 国债 23 | 14,000 | 1,415,669.64 | 2.58 |
| 2 | 019703 | 23 国债 10 | 5,000 | 502,631.51 | 0.92 |
| 3 | 019663 | 21 国债 15 | 2,000 | 204,028.93 | 0.37 |
| 4 | 019679 | 22 国债 14 | 2,000 | 203,595.78 | 0.37 |
| 5 | 019694 | 23 国债 01 | 2,000 | 202,219.29 | 0.37 |

7.7 报告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。

7.8 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。

7.9 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金报告期内进行了少量的股指期货交易，均以套期保值为目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国平安保险(集团)股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局深圳市分局处罚的情况。

除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2

本报告期内，未出现基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 报告期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 24,398.18 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 24,471.06 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 48,869.24 |

7.12.4 报告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。

7.12.5 报告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不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 创金合信量化核心混合 A | 548 | 32,407.43 | 6,215,964.19 | 35.00% | 11,543,305.82 | 65.00% |
| 创金合信量化核心混合 C | 2,101 | 8,579.77 | 2,016,535.59 | 11.19% | 16,009,567.16 | 88.81% |
| 合计 | 2,574 | 13,902.63 | 8,232,499.78 | 23.01% | 27,552,872.98 | 76.99% |

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

份额单位：份

| 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 | 创金合信量化核心混合 A | 2,453,764.84 | 13.82% |
| | 创金合信量化核心混合 C | 20,357.22 | 0.11% |
| | 合计 | 2,474,122.06 | 6.91% |

注：分级基金机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|--------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 创金合信量化核心混合 A | >100 |
| | 创金合信量化核心混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 创金合信量化核心混合 A | >100 |
| | 创金合信量化核心混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 创金合信量化核心混合 A | 创金合信量化核心混合 C |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2017年3月27日)基金份额总额 | 269,241,417.75 | 532,756,314.04 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,649,124.70 | 14,263,159.59 |
| 本报告期基金总申购份额 | 7,937,612.98 | 21,325,165.02 |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 3,827,467.67 | 17,562,221.86 |
| 本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 17,759,270.01 | 18,026,102.75 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未出现涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 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，未出现管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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 | |
| 财通证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 2 | 709,834,029.71 | 100.00% | 18,849.59 | 100.00% | - |
| 东方财富证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 2 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 证券 | | | | | | |
| 国信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华林证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 2 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西部证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金财富 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 第一创业 证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | 4 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证 券 | 4 | - | - | - | - | - |

注：交易单元的选择标准和程序：

(1) 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咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告及其它专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(3) 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；

(4) 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需要，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，并与被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

本基金报告期内新增财通证券 2 个交易单元、平安证券 2 个交易单元、首创证券 2 个交易单元。

10.7.2 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 |
| 财通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | 3,853,806.65 | 100.00% | 37,150,000.00 | 100.00% | - | - |
| 东方财富证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东兴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 恒泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华福证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华林证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 金元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 上海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 万联证券 | - | - | - | - | - | - |
| 五矿证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 西部证券 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金财富 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 第一创业 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证 券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 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 | 创金合信量化核心混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告 | 公司官网、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-01-20 |
| 2 | 创金合信基金管理有限公司关于调整“特定投资群体”的客户适用范围的公告 | 公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-02-15 |
| 3 | 创金合信基金管理有限公司关于面向特定投资群体通过直销中心认购、申购（含定期定额投资）及转换转入旗下所有基金实施费率优惠的公告 | 公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-09 |
| 4 | 创金合信量化核心混合型证券投资基金 2022 年年度报告 | 公司官网、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-03-30 |
| 5 | 创金合信量化核心混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告 | 公司官网、中国证监会基金电子披露网站 | 2023-04-21 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

| 类别 | 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 | 20230411 - 20230625 | 0.00 | 6,215,964.19 | 0.00 | 6,215,964.19 | 17.37% |
| 个人 | 1 | 20230101 - 20230116 | 6,484,663.77 | 0.00 | 6,484,663.77 | 0.00 | 0.00% |

产品特有风险

本基金在报告期内,存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形,可能会存在以下风险:

1、大额申购风险在发生投资者大额申购时,若本基金所投资的标的资产未及时准备,则可能降低基金净值涨幅。

2、大额赎回风险

(1)若本基金在短时间内难以变现足够的资产予以应对,可能导致流动性风险;

(2)若持有基金份额比例达到或超过基金份额总额 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回,将可能对基金管理人的管理造成影响;

(3)基金管理人被迫大量卖出基金投资标的以赎回现金,可能使基金资产净值受到不利影响,影响基金的投资运作;

(4)因基金净值精度计算问题,可能因赎回费归入基金资产,导致基金净值有较大波动;

(5)大额赎回导致基金资产规模过小,不能满足存续条件,可能导致基金合同终止、清算等风险。本基金管理人将建立完善的风险管理机制,以有效防止上述风险,最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

创金合信基金成立于 2014 年 7 月,是第一家成立时即实现员工持股的基金公司。股东由第一创业证券股份有限公司、以及经营管理层和核心员工持股的 7 家投资合伙企业构成。秉承“以客户为中心”的文化理念,创金合信基金迅速构建起独特的服务优势和核心竞争力,并在客户数量和规模上取得快速突破。2022 年 7 月,创金合信基金荣获证券时报第十七届“明星基金公司成长奖”。截至 2023 年 6 月 30 日,创金合信基金共管理 95 只公募基金,公募管理规模 1161.93 亿元。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《创金合信量化核心混合型证券投资基金基金合同》;
- 2、《创金合信量化核心混合型证券投资基金托管协议》;
- 3、创金合信量化核心混合型证券投资基金 2023 年中期报告原文。

12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道梦海大道 5035 华润前海大厦 A 座 36-38 楼

12.3 查阅方式

www.cjxfund.com

创金合信基金管理有限公司

2023 年 8 月 30 日