

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资 基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

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 25 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	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	11
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	56
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	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 市场中性策略执行情况	56

7.13 投资组合报告附注	57
8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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的情况	58
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	58
9 开放式基金份额变动	59
10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
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	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	64
11 备查文件目录	64
11.1 备查文件目录	64
11.2 存放地点	65
11.3 查阅方式	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金
基金简称	广发套利
基金主代码	000992
交易代码	000992
基金运作方式	定期开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 6 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
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	59,820,491.42 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期稳定的绝对收益。在有效控制系统性风险的基础上，通过量化模型构建市场中性投资组合，对冲市场系统风险，力争实现超越业绩比较基准的绝对收益。
投资策略	本基金主要采用对冲套利的投资策略，坚持模型驱动的纪律性，运用基金管理人自主研发的量化多因素选股模型，选取具备投资价值的股票构建投资组合，并做空股指期货进行对冲操作，有效的规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益，力争实现基金资产长期稳健的增值。
业绩比较基准	1 年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为特殊类型的混合型基金，主要采用追求绝对收益的市场中性策略，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。

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		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-89899158	010-66105798

注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	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.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	-334,095.26
本期利润	-19,585.63
加权平均基金份额本期利润	-0.0003
本期加权平均净值利润率	-0.03%
本期基金份额净值增长率	0.00%
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	3,056,177.71
期末可供分配基金份额利润	0.0511
期末基金资产净值	72,092,427.22

期末基金份额净值	1.205
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	22.98%

注：（1）所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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-0.25%	0.12%	0.13%	0.00%	-0.38%	0.12%
过去三个月	0.84%	0.14%	0.38%	0.00%	0.46%	0.14%
过去六个月	0.00%	0.14%	0.75%	0.00%	-0.75%	0.14%
过去一年	-6.08%	0.22%	1.52%	0.00%	-7.60%	0.22%
过去三年	-9.94%	0.33%	4.56%	0.00%	-14.50%	0.33%
自基金合同生效起至今	22.98%	0.31%	13.28%	0.00%	9.70%	0.31%

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

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015 年 2 月 6 日至 2023 年 6 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

经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准，本基金管理人于2003年8月5日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈甄璞	本基金的基金经理；广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2019-10-17	-	18年	陈甄璞先生，工商管理硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任海富通基金管理有限公司量化研究员、投资经理、基金经理，广发基金管理有限公司量化投资部总经理。

陈宇庭	本基金的基金经理；广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2020-05-06	-	7 年	陈宇庭先生，理学和金融学双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任海富通基金管理有限公司量化投资部投资经理助理，广发基金管理有限公司量化投资部研究员、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 2 月 25 日至 2020 年 5 月 6 日)、广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 2 月 25 日至 2020 年 5 月 6 日)、广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理(自 2019 年 7 月 22 日至 2020 年 10 月 19 日)。
-----	--	------------	---	-----	---

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关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

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流

程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 34 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，A 股整体呈现冲高回落的走势，其中主要涨幅集中分布在 1 月份，市场在二季度内明显承压回落。期间，风格分化较为明显，大盘价值、小盘价值均明显跑赢小盘成长、大盘成长；从因子角度来看，估值和红利类因子表现较好，成长因子在 5 月后也逐步小幅反弹；从行业角度来看，受到人工智能技术推广预期的提振，通信、传媒、计算机等行业领跑，而建材、房地产、消费者服务落后；

本产品通过量化多因子模型构建股票多头组合，同时利用股指期货空头对冲市场风险，构建市场中性策略组合，并根据期指基差水平调整对冲策略的配置比例。上半年期间，产品以红利、价值等超额收益稳定的基本面因子为基础，叠加动量反转、流动性等量价类因子构建多头组合，同时把握了对冲成本下降的机会调整配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 0.00%，同期业绩比较基准收益率为 0.75%。

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，虽然市场情绪带来一定扰动，但权益资产的风险溢价再次进入性价比较高的区间。随着指数调整，医药、食品饮料、消费者服务、家电、非银行金融、银行、建材等多个行业的性价比明显提升，带来了配置的机会。此外，对冲成本也逐步收敛至近年来的较低水平，为市场中性策略提供了较好的运作环境。因此，管理人将保持乐观，积极运用对冲策略，力争实现稳健的超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

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。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

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合规守信、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——广发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

本托管人依法对广发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：广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

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	4,113,726.55	1,910,520.04
结算备付金		11,542,425.11	11,196,573.49
存出保证金		5,344,137.28	6,371,156.46
交易性金融资产	6.4.7.2	51,273,348.34	57,373,337.61
其中：股票投资		47,531,507.35	53,677,137.72
基金投资		-	-
债券投资		3,741,840.99	3,696,199.89
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	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		72,273,637.28	76,851,587.60
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		-	-
应付清算款		389.53	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		59,193.00	65,138.62
应付托管费		11,838.59	13,027.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		27,784.13	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	82,004.81	70,053.37
负债合计		181,210.06	148,219.69
净资产:			
实收基金	6.4.7.8	59,820,491.42	63,628,946.65
未分配利润	6.4.7.9	12,271,935.80	13,074,421.26
净资产合计		72,092,427.22	76,703,367.91
负债和净资产总计		72,273,637.28	76,851,587.60

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值（暂估附加管理费前）人民币 1.205 元，基金份额总额 59,820,491.42 份，基金资产净值（暂估附加管理费前）人民币 72,092,427.22 元，暂估附加管理费人民币 0 元，基金资产净值（暂估附加管理费后）人民币 72,092,427.22 元。实际计提时的附加管理费金额可能会与此处暂估附加管理费金额有差异。

6.2 利润表

会计主体：广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

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		488,213.59	-7,768,338.92
1.利息收入		99,495.69	593,511.28
其中：存款利息收入	6.4.7.10	99,495.69	593,511.28
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		74,157.57	-1,641,729.81
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-1,642,515.70	-39,358,444.98
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	69,862.04	146,642.63
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	1,088,602.39	35,940,227.24
股利收益	6.4.7.17	558,208.84	1,629,845.30
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）	6.4.7.18	314,509.63	-6,880,773.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	50.70	160,653.06
减：二、营业总支出		507,799.22	1,979,932.59
1. 管理人报酬		368,196.04	1,447,758.63
2. 托管费		73,639.19	289,551.69
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		3,946.72	153,793.16
8. 其他费用	6.4.7.21	62,017.27	88,829.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		-19,585.63	-9,748,271.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,585.63	-9,748,271.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-19,585.63	-9,748,271.51

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	63,628,946.65	13,074,421.26	76,703,367.91
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	63,628,946.65	13,074,421.26	76,703,367.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,808,455.23	-802,485.46	-4,610,940.69
（一）、综合收益总额	-	-19,585.63	-19,585.63
（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）	-3,808,455.23	-782,899.83	-4,591,355.06
其中：1.基金申购款	27,902.45	5,727.60	33,630.05
2.基金赎回款	-3,836,357.68	-788,627.43	-4,624,985.11
（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、本期期末净资产（基金净值）	59,820,491.42	12,271,935.80	72,092,427.22
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	330,310,902.86	105,011,180.29	435,322,083.15
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	330,310,902.86	105,011,180.29	435,322,083.15

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-186,373,359.62	-64,238,598.31	-250,611,957.93
（一）、综合收益总额	-	-9,748,271.51	-9,748,271.51
（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）	-186,373,359.62	-54,490,326.80	-240,863,686.42
其中：1.基金申购款	32,314.71	9,583.50	41,898.21
2.基金赎回款	-186,405,674.33	-54,499,910.30	-240,905,584.63
（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、本期期末净资产（基金净值）	143,937,543.24	40,772,581.98	184,710,125.22

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：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2014]1406号《关于准予广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2015 年 2 月 6 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 1 月 21 日至 2015 年 2 月 3 日，本基金为契约型开放式混合型基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 1,126,397,761.48 元，有效认购户数为 8,492 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 98,066.25 元，折合基金份额 98,066.25 份，按照基金合同的有

关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2023 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度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

本基金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 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业

纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

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

(3) 企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

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

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	4,113,726.55
等于：本金	4,113,357.56
加：应计利息	368.99
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	4,113,726.55

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		49,290,417.31	-	47,531,507.35	-1,758,909.96
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,658,288.00	127,493.69	3,741,840.99	-43,940.70
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,658,288.00	127,493.69	3,741,840.99	-43,940.70
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		52,948,705.31	127,493.69	51,273,348.34	-1,802,850.66

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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-43,955,520.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-43,955,520.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-43,955,520.00	-	-	-

注：期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2307	IF2307	-3.00	-3,447,360.00	26,460.00
IF2309	IF2309	-23.00	-26,489,100.00	-272,520.00

IM2307	IM2307	-11.00	-14,464,560.00	-199,440.00
合计	-	-	-	-445,500.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-445,500.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的衍生工具为国债/股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

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 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	25,436.54
其中：交易所市场	25,436.54
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	56,568.27
合计	82,004.81

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	63,628,946.65	63,628,946.65
本期申购	27,902.45	27,902.45

本期赎回（以“-”号填列）	-3,836,357.68	-3,836,357.68
本期末	59,820,491.42	59,820,491.42

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,554,093.87	9,520,327.39	13,074,421.26
本期利润	-334,095.26	314,509.63	-19,585.63
本期基金份额交易产生的变动数	-163,820.90	-619,078.93	-782,899.83
其中：基金申购款	1,172.15	4,555.45	5,727.60
基金赎回款	-164,993.05	-623,634.38	-788,627.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,056,177.71	9,215,758.09	12,271,935.80

6.4.7.10 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	6,976.24
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	92,309.97
其他	209.48
合计	99,495.69

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 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	-1,642,515.70
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	-1,642,515.70

6.4.7.11.2 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	129,861,275.69
减：卖出股票成本总额	131,296,551.96

减：交易费用	207,239.43
买卖股票差价收入	-1,642,515.70

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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	69,097.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	764.89
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	69,862.04

6.4.7.13.2 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	5,768.49
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,000.00
减：应计利息总额	3.35
减：交易费用	0.25
买卖债券差价收入	764.89

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	1,088,602.39

6.4.7.17 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	558,208.84
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	558,208.84

6.4.7.18 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	1,972,549.63
——股票投资	2,003,002.33
——债券投资	-30,452.70
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-1,658,040.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-1,658,040.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	314,509.63

6.4.7.19 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	49.44
基金转换费收入	1.26
合计	50.70

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 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	12,396.69
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	349.00
账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	62,017.27

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，本基金无需要披露的或有事项。

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，本基金无需要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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 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

广发证券股份有限公司	-	-	20,800.00	2.03%
------------	---	---	-----------	-------

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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	368,196.04	1,447,758.63
其中：支付销售机构的客户维护费	116,505.91	181,979.60

注：基金管理人的管理费为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中，基金管理人的基本管理费和附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下：

(1) 基金管理人的基本管理费

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

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金基本管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

(2) 基金管理人的附加管理费

1) 基金管理人可在满足以下条件的前提下，提取附加管理费：

附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照“新高法原则”提取超额收益的 10% 作为附加管理费：即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和 1 的孰高者，管理人才能收取附加管理费，附加管理费按照下述公式计算并收取。提取评价日是指每次基金封闭期的最后一个工作日。

2) 附加管理费的计算方法和提取

在满足以上附加管理费提取条件的情况下，附加管理费的计算方法为：

$$\text{附加管理费}=[P(a)-P(h)]*10\%*S(a)$$

其中：

P(a)：提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值

$P(a)=\text{提取评价日基金份额净值}*\text{提取评价日的折算因子}+\sum_{i=1, n}\text{第 } i \text{ 次基金份额分红}*\text{第 } i \text{ 次分}$
 红日的折算因子，其中 n 为累计分红次数

P(h)：以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期间最高基金份额累计净值和 1
 的孰高者，其中首次封闭期的 P(h)为 1

S(a)：提取评价日的基金份额=提取评价日基金总份额-提取评价日的折算因子

特定日期的折算因子为相应日期（包括当日）之前所有折算系数的乘积

折算系数=基金折算日除权前基金份额净值÷基金折算日除权后基金份额净值

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。由基金管理人向基金托管人发送基金附加管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2 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	73,639.19	289,551.69

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内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。

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,200.02	10,000,200.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.72%	6.95%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		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	4,113,726.55	6,976.24	8,269,880.06	16,215.19

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，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	重大事项停牌	6.97	2023-07-03	7.40	1,900.00	12,173.78	13,243.00	-

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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 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	7,873.65	-
未评级	3,733,967.34	3,696,199.89
合计	3,741,840.99	3,696,199.89

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合

的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VaR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

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	4,113,726.55	-	-	-	4,113,726.55
结算备付金	11,542,425.11	-	-	-	11,542,425.11
存出保证金	5,344,137.28	-	-	-	5,344,137.28
交易性金融资产	3,741,840.99	-	-	47,531,507.35	51,273,348.34
资产总计	24,742,129.93	-	-	47,531,507.35	72,273,637.28
负债					
应付清算款	-	-	-	389.53	389.53
应付管理人报酬	-	-	-	59,193.00	59,193.00
应付托管费	-	-	-	11,838.59	11,838.59
应交税费	-	-	-	27,784.13	27,784.13
其他负债	-	-	-	82,004.81	82,004.81
负债总计	-	-	-	181,210.06	181,210.06
利率敏感度缺口	24,742,129.93	-	-	47,350,297.29	72,092,427.22
上年度末 2022年12月31	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

日					
资产					
银行存款	1,910,520.04	-	-	-	1,910,520.04
结算备付金	11,196,573.49	-	-	-	11,196,573.49
存出保证金	6,371,156.46	-	-	-	6,371,156.46
交易性金融资产	3,696,199.89	-	-	53,677,137.72	57,373,337.61
资产总计	23,174,449.88	-	-	53,677,137.72	76,851,587.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	65,138.62	65,138.62
应付托管费	-	-	-	13,027.70	13,027.70
其他负债	-	-	-	70,053.37	70,053.37
负债总计	-	-	-	148,219.69	148,219.69
利率敏感度缺口	23,174,449.88	-	-	53,528,918.03	76,703,367.91

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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
	市场利率上升 25 个基点	-816.63	-5,322.23
	市场利率下降 25 个基点	816.98	5,337.61

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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VaR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	47,531,507.35	65.93	53,677,137.72	69.98
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	7,873.65	0.01	-	-
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	47,539,381.00	65.94	53,677,137.72	69.98

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金针对股票构建投资组合，并做空股指期货进行对冲操作，因此无重大其他价格风险。

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	47,526,138.00
第二层次	3,747,210.34
第三层次	-
合计	51,273,348.34

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低

层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内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 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	47,531,507.35	65.77
	其中：普通股	47,531,507.35	65.77
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,741,840.99	5.18
	其中：债券	3,741,840.99	5.18
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,656,151.66	21.66
8	其他各项资产	5,344,137.28	7.39
9	合计	72,273,637.28	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

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	443,497.00	0.62
B	采矿业	1,340,118.00	1.86
C	制造业	28,949,643.04	40.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,055,608.00	2.85
E	建筑业	921,236.40	1.28
F	批发和零售业	502,977.90	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	934,804.20	1.30
H	住宿和餐饮业	36,005.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,171,522.91	4.40
J	金融业	6,391,289.00	8.87
K	房地产业	742,911.00	1.03
L	租赁和商务服务业	430,103.50	0.60
M	科学研究和技术服务业	493,416.00	0.68
N	水利、环境和公共设施管理业	401,769.40	0.56
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	53,909.00	0.07
Q	卫生和社会工作	281,574.00	0.39
R	文化、体育和娱乐业	337,794.00	0.47
S	综合	43,329.00	0.06
	合计	47,531,507.35	65.93

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通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	800	1,352,800.00	1.88
2	300750	宁德时代	4,420	1,011,251.80	1.40
3	002038	双鹭药业	79,400	801,146.00	1.11
4	601318	中国平安	16,300	756,320.00	1.05
5	600011	华能国际	80,100	741,726.00	1.03
6	600036	招商银行	22,300	730,548.00	1.01

7	000333	美的集团	8,100	477,252.00	0.66
8	000887	中鼎股份	31,400	411,026.00	0.57
9	002594	比亚迪	1,400	361,578.00	0.50
10	601166	兴业银行	22,000	344,300.00	0.48
11	600887	伊利股份	11,500	325,680.00	0.45
12	688001	华兴源创	8,793	311,448.06	0.43
13	000651	格力电器	8,200	299,382.00	0.42
14	000725	京东方 A	72,400	296,116.00	0.41
15	000001	平安银行	25,000	280,750.00	0.39
16	600958	东方证券	28,600	277,420.00	0.38
17	601012	隆基绿能	9,600	275,232.00	0.38
18	600309	万华化学	3,000	263,520.00	0.37
19	002475	立讯精密	8,100	262,845.00	0.36
20	600276	恒瑞医药	5,200	249,080.00	0.35
21	002415	海康威视	7,400	245,014.00	0.34
22	688111	金山办公	500	236,110.00	0.33
23	600030	中信证券	11,600	229,448.00	0.32
24	601138	工业富联	9,100	229,320.00	0.32
25	603259	药明康德	3,600	224,316.00	0.31
26	601601	中国太保	8,600	223,428.00	0.31
27	002304	洋河股份	1,700	223,295.00	0.31
28	000858	五粮液	1,300	212,641.00	0.29
29	300760	迈瑞医疗	700	209,860.00	0.29
30	601939	建设银行	33,300	208,458.00	0.29
31	300059	东方财富	14,560	206,752.00	0.29
32	002142	宁波银行	7,800	197,340.00	0.27
33	600690	海尔智家	8,400	197,232.00	0.27
34	601328	交通银行	33,400	193,720.00	0.27
35	600406	国电南瑞	8,220	189,882.00	0.26
36	601988	中国银行	48,300	188,853.00	0.26
37	600028	中国石化	29,200	185,712.00	0.26
38	002611	东方精工	32,000	183,680.00	0.25
39	601088	中国神华	5,900	181,425.00	0.25
40	601766	中国中车	27,600	179,400.00	0.25
41	002714	牧原股份	4,200	177,030.00	0.25
42	600031	三一重工	10,200	169,626.00	0.24
43	000002	万科 A	11,900	166,838.00	0.23
44	601899	紫金矿业	14,600	166,002.00	0.23
45	600050	中国联通	33,900	162,720.00	0.23
46	601728	中国电信	27,700	155,951.00	0.22
47	601888	中国中免	1,400	154,742.00	0.21
48	300498	温氏股份	8,300	152,305.00	0.21
49	002129	TCL 中环	4,575	151,890.00	0.21
50	601919	中远海控	16,100	151,340.00	0.21

51	600438	通威股份	4,400	150,964.00	0.21
52	601336	新华保险	4,100	150,757.00	0.21
53	600016	民生银行	39,800	149,250.00	0.21
54	002352	顺丰控股	3,300	148,797.00	0.21
55	601688	华泰证券	10,800	148,716.00	0.21
56	600089	特变电工	6,600	147,114.00	0.20
57	002139	拓邦股份	11,000	143,550.00	0.20
58	002230	科大讯飞	2,100	142,716.00	0.20
59	601857	中国石油	19,000	141,930.00	0.20
60	002215	诺普信	18,800	141,188.00	0.20
61	000921	海信家电	5,200	140,140.00	0.19
62	601211	国泰君安	9,900	138,501.00	0.19
63	601985	中国核电	19,500	137,475.00	0.19
64	601668	中国建筑	23,900	137,186.00	0.19
65	000063	中兴通讯	3,000	136,620.00	0.19
66	002746	仙坛股份	17,000	133,960.00	0.19
67	600761	安徽合力	6,700	133,531.00	0.19
68	300015	爱尔眼科	7,140	132,447.00	0.18
69	688516	奥特维	700	131,880.00	0.18
70	002283	天润工业	20,300	130,326.00	0.18
71	600900	长江电力	5,900	130,154.00	0.18
72	600905	三峡能源	24,200	129,954.00	0.18
73	002737	葵花药业	5,300	129,002.00	0.18
74	002402	和而泰	7,500	127,350.00	0.18
75	600363	联创光电	3,400	126,140.00	0.17
76	600211	西藏药业	2,100	124,740.00	0.17
77	000625	长安汽车	9,600	124,128.00	0.17
78	600583	海油工程	20,900	122,265.00	0.17
79	688556	高测股份	2,300	122,222.00	0.17
80	688981	中芯国际	2,401	121,298.52	0.17
81	300014	亿纬锂能	2,000	121,000.00	0.17
82	001979	招商蛇口	9,200	119,876.00	0.17
83	300119	瑞普生物	6,700	119,260.00	0.17
84	603588	高能环境	12,700	118,999.00	0.17
85	002782	可立克	7,700	117,733.00	0.16
86	002460	赣锋锂业	1,900	115,824.00	0.16
87	002252	上海莱士	15,200	114,152.00	0.16
88	601288	农业银行	32,100	113,313.00	0.16
89	600572	康恩贝	16,400	112,340.00	0.16
90	600660	福耀玻璃	3,100	111,135.00	0.15
91	002990	盛视科技	3,000	110,400.00	0.15
92	000895	双汇发展	4,500	110,205.00	0.15
93	601169	北京银行	23,600	109,268.00	0.15
94	002664	信质集团	7,700	108,416.00	0.15

95	603288	海天味业	2,300	107,755.00	0.15
96	000792	盐湖股份	5,600	107,352.00	0.15
97	301039	中集车辆	8,100	107,163.00	0.15
98	600585	海螺水泥	4,500	106,830.00	0.15
99	603986	兆易创新	1,000	106,250.00	0.15
100	688711	宏微科技	1,820	106,178.80	0.15
101	600019	宝钢股份	18,800	105,656.00	0.15
102	002466	天齐锂业	1,500	104,865.00	0.15
103	000568	泸州老窖	500	104,785.00	0.15
104	600999	招商证券	7,700	104,489.00	0.14
105	002929	润建股份	2,400	104,184.00	0.14
106	601390	中国中铁	13,700	103,846.00	0.14
107	600210	紫江企业	19,500	103,740.00	0.14
108	002050	三花智控	3,400	102,884.00	0.14
109	603019	中科曙光	2,000	101,800.00	0.14
110	601222	林洋能源	12,300	100,737.00	0.14
111	688518	联赢激光	3,600	100,296.00	0.14
112	605589	圣泉集团	4,600	100,004.00	0.14
113	300443	金雷股份	2,800	99,260.00	0.14
114	002237	恒邦股份	9,100	99,099.00	0.14
115	603466	风语筑	7,100	98,690.00	0.14
116	603566	普莱柯	4,200	97,650.00	0.14
117	603118	共进股份	7,200	95,688.00	0.13
118	688303	大全能源	2,351	95,097.95	0.13
119	601619	嘉泽新能	20,800	94,640.00	0.13
120	601877	正泰电器	3,400	94,010.00	0.13
121	688012	中微公司	600	93,870.00	0.13
122	603209	兴通股份	4,420	93,748.20	0.13
123	002841	视源股份	1,400	93,576.00	0.13
124	603197	保隆科技	1,700	92,225.00	0.13
125	600837	海通证券	10,000	92,200.00	0.13
126	300143	盈康生命	8,100	91,854.00	0.13
127	300041	回天新材	7,770	91,686.00	0.13
128	300842	帝科股份	1,000	91,440.00	0.13
129	603368	柳药集团	3,700	91,427.00	0.13
130	601816	京沪高铁	17,300	90,998.00	0.13
131	002351	漫步者	4,400	90,992.00	0.13
132	688676	金盘科技	3,000	90,870.00	0.13
133	600104	上汽集团	6,400	90,688.00	0.13
134	002249	大洋电机	15,900	90,630.00	0.13
135	002616	长青集团	17,600	90,112.00	0.12
136	601006	大秦铁路	12,100	89,903.00	0.12
137	603960	克来机电	4,800	89,520.00	0.12
138	000682	东方电子	9,200	89,424.00	0.12

139	600266	城建发展	17,600	89,408.00	0.12
140	300896	爱美客	200	88,990.00	0.12
141	603501	韦尔股份	900	88,236.00	0.12
142	601377	兴业证券	14,200	86,904.00	0.12
143	600000	浦发银行	12,000	86,880.00	0.12
144	600919	江苏银行	11,800	86,730.00	0.12
144	300219	鸿利智汇	11,800	86,730.00	0.12
145	601916	浙商银行	32,800	86,592.00	0.12
146	300177	中海达	12,700	85,979.00	0.12
147	000048	京基智农	4,400	85,888.00	0.12
148	601137	博威合金	5,500	85,580.00	0.12
149	600048	保利发展	6,500	84,695.00	0.12
150	600502	安徽建工	16,000	84,480.00	0.12
151	002967	广电计量	4,200	84,378.00	0.12
152	600547	山东黄金	3,500	82,180.00	0.11
153	300122	智飞生物	1,850	81,770.00	0.11
154	002179	中航光电	1,780	80,723.00	0.11
155	002698	博实股份	4,600	80,454.00	0.11
156	603171	税友股份	2,000	79,960.00	0.11
157	000338	潍柴动力	6,400	79,744.00	0.11
158	600176	中国巨石	5,600	79,296.00	0.11
159	002108	沧州明珠	17,400	78,822.00	0.11
160	600059	古越龙山	7,500	77,850.00	0.11
161	600346	恒力石化	5,400	77,382.00	0.11
162	600111	北方稀土	3,200	76,736.00	0.11
163	601669	中国电建	13,300	76,342.00	0.11
164	601929	吉视传媒	41,400	76,176.00	0.11
165	688508	芯朋微	1,300	75,387.00	0.10
166	605117	德业股份	500	74,775.00	0.10
167	600941	中国移动	800	74,640.00	0.10
168	601009	南京银行	9,300	74,400.00	0.10
169	600196	复星医药	2,400	74,160.00	0.10
170	002458	益生股份	6,000	74,100.00	0.10
171	600809	山西汾酒	400	74,028.00	0.10
172	000538	云南白药	1,400	73,472.00	0.10
173	603799	华友钴业	1,600	73,456.00	0.10
174	000938	紫光股份	2,300	73,255.00	0.10
175	300133	华策影视	10,300	73,027.00	0.10
176	688389	普门科技	3,100	72,819.00	0.10
177	002622	皓宸医疗	23,000	72,680.00	0.10
178	688599	天合光能	1,701	72,479.61	0.10
179	600821	金开新能	10,500	72,345.00	0.10
180	002314	南山控股	21,900	72,270.00	0.10
181	002429	兆驰股份	13,100	72,050.00	0.10

182	002001	新和成	4,600	70,840.00	0.10
183	688148	芳源股份	5,800	70,760.00	0.10
184	600066	宇通客车	4,800	70,752.00	0.10
185	002821	凯莱英	600	70,716.00	0.10
186	002938	鹏鼎控股	2,900	70,441.00	0.10
187	000601	韶能股份	15,200	69,768.00	0.10
188	002233	塔牌集团	9,000	69,480.00	0.10
189	601818	光大银行	22,600	69,382.00	0.10
190	603993	洛阳钼业	12,800	68,224.00	0.09
191	000661	长春高新	500	68,150.00	0.09
192	601360	三六零	5,400	67,716.00	0.09
193	002601	龙佰集团	4,100	67,650.00	0.09
194	300496	中科创达	700	67,445.00	0.09
195	601827	三峰环境	9,100	67,340.00	0.09
196	300662	科锐国际	1,900	67,203.00	0.09
197	601788	光大证券	4,200	66,738.00	0.09
198	600741	华域汽车	3,600	66,456.00	0.09
199	002123	梦网科技	5,000	66,450.00	0.09
200	600570	恒生电子	1,500	66,435.00	0.09
201	300777	中简科技	1,400	66,164.00	0.09
202	002736	国信证券	7,500	65,475.00	0.09
203	688169	石头科技	200	64,136.00	0.09
204	600745	闻泰科技	1,300	63,570.00	0.09
205	000408	藏格矿业	2,800	63,196.00	0.09
206	002085	万丰奥威	9,100	63,063.00	0.09
207	601186	中国铁建	6,400	63,040.00	0.09
208	605168	三人行	725	62,306.50	0.09
209	300298	三诺生物	2,300	62,192.00	0.09
210	603195	公牛集团	640	61,478.40	0.09
211	600582	天地科技	10,500	61,215.00	0.08
212	600929	雪天盐业	7,700	61,138.00	0.08
213	000100	TCL 科技	15,500	61,070.00	0.08
214	600183	生益科技	4,300	61,060.00	0.08
215	603959	百利科技	5,300	60,950.00	0.08
216	601615	明阳智能	3,600	60,768.00	0.08
217	600557	康缘药业	2,200	60,412.00	0.08
218	300290	荣科科技	12,500	60,000.00	0.08
218	002032	苏泊尔	1,200	60,000.00	0.08
219	002271	东方雨虹	2,200	59,972.00	0.08
220	300146	汤臣倍健	2,500	59,950.00	0.08
221	002641	公元股份	10,600	59,784.00	0.08
222	300109	新开源	2,400	59,688.00	0.08
223	603185	弘元绿能	800	59,640.00	0.08
224	300593	新雷能	2,600	59,566.00	0.08

225	000559	万向钱潮	10,900	59,405.00	0.08
226	001308	康冠科技	2,150	59,039.00	0.08
227	603093	南华期货	5,400	58,806.00	0.08
228	002421	达实智能	16,700	58,784.00	0.08
229	002959	小熊电器	700	58,450.00	0.08
230	600061	国投资本	8,200	58,384.00	0.08
231	000869	张裕 A	1,900	58,254.00	0.08
232	600233	圆通速递	4,000	58,240.00	0.08
233	300347	泰格医药	900	58,086.00	0.08
234	601229	上海银行	10,100	58,075.00	0.08
235	300224	正海磁材	4,500	57,870.00	0.08
236	002812	恩捷股份	600	57,810.00	0.08
237	002130	沃尔核材	7,100	57,652.00	0.08
238	601311	骆驼股份	6,200	57,536.00	0.08
239	600531	豫光金铅	9,100	57,330.00	0.08
240	600436	片仔癀	200	57,272.00	0.08
241	600789	鲁抗医药	8,900	57,138.00	0.08
242	000591	太阳能	8,400	56,952.00	0.08
243	601995	中金公司	1,600	56,832.00	0.08
244	300638	广和通	2,500	56,700.00	0.08
245	688188	柏楚电子	300	56,568.00	0.08
246	300433	蓝思科技	4,800	56,448.00	0.08
247	002015	协鑫能科	4,200	56,406.00	0.08
248	601567	三星医疗	4,400	55,572.00	0.08
249	000801	四川九洲	7,600	55,480.00	0.08
250	600483	福能股份	4,800	55,440.00	0.08
251	300653	正海生物	1,600	55,024.00	0.08
252	601989	中国重工	11,400	54,948.00	0.08
253	600893	航发动力	1,300	54,938.00	0.08
254	003032	传智教育	3,700	53,909.00	0.07
255	002635	安洁科技	3,900	53,820.00	0.07
256	002027	分众传媒	7,900	53,799.00	0.07
257	000517	荣安地产	17,500	53,375.00	0.07
258	603301	振德医疗	1,800	53,316.00	0.07
259	600362	江西铜业	2,800	53,144.00	0.07
260	600699	均胜电子	3,000	52,920.00	0.07
261	600510	黑牡丹	8,700	52,809.00	0.07
262	300033	同花顺	300	52,584.00	0.07
263	300866	安克创新	600	52,500.00	0.07
264	002074	国轩高科	1,900	52,478.00	0.07
265	605499	东鹏饮料	300	51,870.00	0.07
266	002706	良信股份	4,600	51,750.00	0.07
267	688008	澜起科技	900	51,678.00	0.07
268	688132	邦彦技术	1,900	51,642.00	0.07

269	600284	浦东建设	8,400	51,408.00	0.07
270	002851	麦格米特	1,400	51,058.00	0.07
271	300271	华宇软件	4,600	50,968.00	0.07
272	002414	高德红外	6,510	50,582.70	0.07
273	002756	永兴材料	800	50,088.00	0.07
274	000157	中联重科	7,400	49,950.00	0.07
275	000759	中百集团	11,000	49,610.00	0.07
276	002262	恩华药业	1,600	49,328.00	0.07
277	603444	吉比特	100	49,111.00	0.07
278	300226	上海钢联	1,500	48,600.00	0.07
279	000977	浪潮信息	1,000	48,500.00	0.07
280	002807	江阴银行	13,100	48,339.00	0.07
281	300332	天壕能源	4,200	48,174.00	0.07
282	600098	广州发展	7,700	47,586.00	0.07
283	603328	依顿电子	5,700	47,196.00	0.07
284	300296	利亚德	7,200	47,016.00	0.07
285	000567	海德股份	3,650	46,793.00	0.06
286	601136	首创证券	3,300	46,761.00	0.06
287	002669	康达新材	3,500	46,725.00	0.06
288	688722	同益中	2,500	46,350.00	0.06
289	300855	图南股份	1,310	46,269.20	0.06
290	600481	双良节能	3,300	46,134.00	0.06
291	600132	重庆啤酒	500	46,080.00	0.06
292	000800	一汽解放	5,500	46,035.00	0.06
293	002055	得润电子	4,800	45,888.00	0.06
294	601699	潞安环能	2,800	45,696.00	0.06
295	600577	精达股份	10,800	45,576.00	0.06
296	601126	四方股份	3,000	45,570.00	0.06
297	300142	沃森生物	1,700	44,965.00	0.06
298	688002	睿创微纳	1,000	44,800.00	0.06
299	603601	再升科技	10,400	44,408.00	0.06
300	002241	歌尔股份	2,500	44,375.00	0.06
301	002034	旺能环境	2,800	44,268.00	0.06
302	603868	飞科电器	700	44,163.00	0.06
303	688036	传音控股	300	44,100.00	0.06
304	300979	华利集团	900	43,866.00	0.06
305	600562	国睿科技	2,700	43,740.00	0.06
306	603939	益丰药房	1,180	43,660.00	0.06
307	600584	长电科技	1,400	43,638.00	0.06
308	300762	上海瀚讯	3,700	43,549.00	0.06
309	605123	派克新材	400	43,460.00	0.06
310	002236	大华股份	2,200	43,450.00	0.06
311	000551	创元科技	3,900	43,329.00	0.06
312	688326	经纬恒润-W	300	43,317.00	0.06

313	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.06
314	002435	长江健康	8,800	42,856.00	0.06
315	000513	丽珠集团	1,100	42,801.00	0.06
316	000811	冰轮环境	2,700	42,552.00	0.06
317	000166	申万宏源	9,200	42,504.00	0.06
318	601868	中国能建	18,100	42,354.00	0.06
319	600478	科力远	5,900	42,126.00	0.06
320	603156	养元饮品	1,700	41,990.00	0.06
321	000913	钱江摩托	2,300	41,929.00	0.06
322	601225	陕西煤业	2,300	41,837.00	0.06
323	688007	光峰科技	2,000	41,700.00	0.06
324	600010	包钢股份	23,200	41,528.00	0.06
325	603997	继峰股份	2,900	41,470.00	0.06
326	002895	川恒股份	2,100	41,370.00	0.06
327	002489	浙江永强	10,200	41,310.00	0.06
328	300408	三环集团	1,400	41,090.00	0.06
329	688050	爱博医疗	200	41,066.00	0.06
330	600578	京能电力	10,500	41,055.00	0.06
331	603916	苏博特	3,100	41,044.00	0.06
332	601369	陕鼓动力	4,500	40,995.00	0.06
333	600312	平高电气	3,300	40,887.00	0.06
334	603279	景津装备	1,300	40,768.00	0.06
335	300439	美康生物	3,600	40,716.00	0.06
336	600575	淮河能源	15,900	40,704.00	0.06
337	000552	甘肃能化	12,200	40,626.00	0.06
338	603323	苏农银行	9,600	40,416.00	0.06
339	603027	千禾味业	1,900	40,128.00	0.06
340	002234	民和股份	2,200	40,062.00	0.06
341	600926	杭州银行	3,400	39,950.00	0.06
342	300450	先导智能	1,100	39,787.00	0.06
343	002413	雷科防务	7,600	39,748.00	0.06
344	002705	新宝股份	2,200	39,666.00	0.06
345	002128	电投能源	3,000	39,660.00	0.06
346	600383	金地集团	5,500	39,655.00	0.06
347	600027	华电国际	5,900	39,471.00	0.05
348	300529	健帆生物	1,700	39,406.00	0.05
349	000555	神州信息	3,200	39,360.00	0.05
350	300628	亿联网络	1,120	39,278.40	0.05
351	601800	中国交建	3,600	39,276.00	0.05
352	600986	浙文互联	6,100	39,040.00	0.05
353	000963	华东医药	900	39,033.00	0.05
354	300872	天阳科技	2,500	38,850.00	0.05
355	603659	璞泰来	1,015	38,793.30	0.05
356	603103	横店影视	2,300	38,732.00	0.05

357	000793	华闻集团	18,000	38,700.00	0.05
358	300782	卓胜微	400	38,652.00	0.05
359	002991	甘源食品	500	38,350.00	0.05
359	300326	凯利泰	5,900	38,350.00	0.05
360	300601	康泰生物	1,500	38,085.00	0.05
361	300127	银河磁体	2,100	38,073.00	0.05
362	603208	江山欧派	1,040	37,876.80	0.05
363	688126	沪硅产业	1,800	37,620.00	0.05
364	002434	万里扬	4,200	37,590.00	0.05
365	002367	康力电梯	4,100	37,433.00	0.05
366	600015	华夏银行	6,900	37,329.00	0.05
367	300775	三角防务	1,100	37,158.00	0.05
368	603517	绝味食品	1,000	37,150.00	0.05
369	002918	蒙娜丽莎	2,400	37,056.00	0.05
370	300497	富祥药业	2,900	37,004.00	0.05
371	002649	博彦科技	2,600	36,738.00	0.05
372	300770	新媒股份	800	36,688.00	0.05
373	600009	上海机场	800	36,336.00	0.05
374	002768	国恩股份	1,500	36,285.00	0.05
375	002484	江海股份	1,700	36,193.00	0.05
376	600258	首旅酒店	1,900	36,005.00	0.05
377	003816	中国广核	11,500	35,765.00	0.05
378	688363	华熙生物	400	35,664.00	0.05
379	600477	杭萧钢构	8,700	35,583.00	0.05
380	300363	博腾股份	1,200	35,508.00	0.05
381	600886	国投电力	2,800	35,420.00	0.05
382	300674	宇信科技	2,000	35,360.00	0.05
383	002912	中新赛克	800	35,208.00	0.05
384	301363	美好医疗	800	35,192.00	0.05
385	300274	阳光电源	300	34,989.00	0.05
386	603183	建研院	7,400	34,928.00	0.05
387	002372	伟星新材	1,700	34,918.00	0.05
388	002555	三七互娱	1,000	34,880.00	0.05
389	600458	时代新材	2,900	34,771.00	0.05
390	603308	应流股份	1,900	34,770.00	0.05
391	603589	口子窖	700	34,545.00	0.05
392	002180	纳思达	1,000	34,250.00	0.05
393	002135	东南网架	5,300	34,238.00	0.05
394	002459	晶澳科技	820	34,194.00	0.05
395	300827	上能电气	943	33,995.15	0.05
396	300454	深信服	300	33,975.00	0.05
397	601319	中国人保	5,800	33,872.00	0.05
398	300393	中来股份	2,400	33,696.00	0.05
399	000860	顺鑫农业	1,000	33,690.00	0.05

400	605009	豪悦护理	700	33,600.00	0.05
401	000028	国药一致	770	33,579.70	0.05
402	600025	华能水电	4,700	33,511.00	0.05
403	300319	麦捷科技	3,900	33,384.00	0.05
404	300795	米奥会展	800	33,368.00	0.05
405	601677	明泰铝业	2,400	33,312.00	0.05
406	600963	岳阳林纸	4,500	33,165.00	0.05
407	600674	川投能源	2,200	33,110.00	0.05
408	002617	露笑科技	4,200	33,096.00	0.05
409	601208	东材科技	2,600	33,020.00	0.05
410	600039	四川路桥	3,360	32,961.60	0.05
411	601886	江河集团	3,700	32,893.00	0.05
412	601636	旗滨集团	3,800	32,756.00	0.05
413	000425	徐工机械	4,800	32,496.00	0.05
413	603599	广信股份	1,200	32,496.00	0.05
414	300627	华测导航	1,000	32,470.00	0.05
415	002425	凯撒文化	5,700	32,091.00	0.04
416	002544	普天科技	1,400	32,060.00	0.04
417	688488	艾迪药业	2,600	32,032.00	0.04
418	300661	圣邦股份	390	32,030.70	0.04
419	002518	科士达	800	32,008.00	0.04
420	603187	海容冷链	1,600	31,984.00	0.04
421	002371	北方华创	100	31,765.00	0.04
422	688027	国盾量子	200	31,664.00	0.04
423	300185	通裕重工	11,300	31,527.00	0.04
424	603605	珀莱雅	280	31,472.00	0.04
425	601117	中国化学	3,800	31,464.00	0.04
426	601066	中信建投	1,300	31,460.00	0.04
427	000823	超声电子	3,300	31,284.00	0.04
428	001696	宗申动力	4,400	31,152.00	0.04
429	688588	凌志软件	2,000	31,100.00	0.04
430	600490	鹏欣资源	8,400	30,912.00	0.04
431	000036	华联控股	7,500	30,900.00	0.04
432	300769	德方纳米	280	30,864.40	0.04
433	600633	浙数文化	1,900	30,799.00	0.04
434	300118	东方日升	1,200	30,756.00	0.04
435	300091	金通灵	10,300	30,694.00	0.04
436	002424	贵州百灵	3,400	30,532.00	0.04
437	601998	中信银行	5,100	30,498.00	0.04
438	000030	富奥股份	6,000	30,240.00	0.04
439	603008	喜临门	1,200	30,216.00	0.04
440	002266	浙富控股	7,300	30,149.00	0.04
441	000528	柳工	3,800	30,020.00	0.04
442	603300	华铁应急	5,500	29,975.00	0.04

443	002274	华昌化工	4,000	29,960.00	0.04
444	002158	汉钟精机	1,200	29,952.00	0.04
445	688006	杭可科技	980	29,860.60	0.04
446	603317	天味食品	2,040	29,804.40	0.04
447	300525	博思软件	1,940	29,759.60	0.04
448	603806	福斯特	800	29,752.00	0.04
449	601918	新集能源	7,000	29,750.00	0.04
449	000533	顺钠股份	7,000	29,750.00	0.04
450	002202	金风科技	2,800	29,736.00	0.04
451	600995	南网储能	2,700	29,727.00	0.04
452	301367	怡和嘉业	200	29,668.00	0.04
453	600517	国网英大	5,200	29,640.00	0.04
454	688388	嘉元科技	1,100	29,612.00	0.04
455	688223	晶科能源	2,100	29,526.00	0.04
456	001338	永顺泰	1,600	29,504.00	0.04
456	688277	天智航-U	1,600	29,504.00	0.04
457	600827	百联股份	2,200	29,414.00	0.04
458	601686	友发集团	4,300	29,412.00	0.04
459	601618	中国中冶	7,400	29,378.00	0.04
460	600508	上海能源	2,000	29,360.00	0.04
461	603429	集友股份	3,300	29,238.00	0.04
462	002056	横店东磁	1,600	29,136.00	0.04
463	300634	彩讯股份	1,100	29,040.00	0.04
463	002727	一心堂	1,100	29,040.00	0.04
464	605090	九丰能源	1,300	29,029.00	0.04
465	603306	华懋科技	1,000	29,020.00	0.04
466	002891	中宠股份	1,200	28,968.00	0.04
467	603416	信捷电气	700	28,917.00	0.04
468	601515	东风股份	6,600	28,908.00	0.04
469	300900	广联航空	1,000	28,810.00	0.04
470	002223	鱼跃医疗	800	28,792.00	0.04
471	600057	厦门象屿	3,300	28,710.00	0.04
472	000917	电广传媒	3,900	28,509.00	0.04
473	601928	凤凰传媒	2,500	28,500.00	0.04
474	300596	利安隆	700	28,469.00	0.04
475	300366	创意信息	2,300	28,428.00	0.04
476	603567	珍宝岛	1,900	28,424.00	0.04
477	600552	凯盛科技	2,400	28,416.00	0.04
477	601956	东贝集团	4,800	28,416.00	0.04
478	000828	东莞控股	3,100	28,365.00	0.04
479	300316	晶盛机电	400	28,360.00	0.04
480	600496	精工钢构	7,600	28,348.00	0.04
481	603866	桃李面包	2,800	28,336.00	0.04
482	300130	新国都	1,000	28,330.00	0.04

483	002646	天佑德酒	2,100	28,329.00	0.04
484	002195	岩山科技	9,800	28,322.00	0.04
485	600850	电科数字	1,200	28,308.00	0.04
486	000915	华特达因	800	28,232.00	0.04
487	002020	京新药业	2,200	28,204.00	0.04
488	600867	通化东宝	2,700	28,188.00	0.04
489	603260	合盛硅业	400	28,008.00	0.04
490	002049	紫光国微	300	27,975.00	0.04
491	603299	苏盐井神	2,800	27,944.00	0.04
492	000090	天健集团	5,500	27,720.00	0.04
493	603936	博敏电子	2,300	27,600.00	0.04
494	603719	良品铺子	1,100	27,511.00	0.04
495	003012	东鹏控股	3,400	27,506.00	0.04
496	601901	方正证券	4,200	27,468.00	0.04
497	600330	天通股份	2,300	27,416.00	0.04
498	300973	立高食品	400	27,368.00	0.04
498	300413	芒果超媒	800	27,368.00	0.04
499	300783	三只松鼠	1,400	27,356.00	0.04
500	600285	羚锐制药	1,700	27,302.00	0.04
501	000761	本钢板材	6,800	27,200.00	0.04
502	603010	万盛股份	2,500	27,175.00	0.04
503	301031	中熔电气	200	27,142.00	0.04
504	600876	凯盛新能	1,700	27,132.00	0.04
505	603881	数据港	1,200	27,108.00	0.04
506	300751	迈为股份	160	27,100.80	0.04
507	000786	北新建材	1,100	26,961.00	0.04
508	000951	中国重汽	1,600	26,960.00	0.04
509	002152	广电运通	2,300	26,956.00	0.04
510	600188	兖矿能源	900	26,928.00	0.04
511	600328	中盐化工	2,990	26,910.00	0.04
512	601607	上海医药	1,200	26,892.00	0.04
513	300358	楚天科技	1,800	26,874.00	0.04
514	000876	新希望	2,300	26,864.00	0.04
515	605222	起帆电缆	1,300	26,858.00	0.04
516	002065	东华软件	3,800	26,828.00	0.04
517	300759	康龙化成	700	26,796.00	0.04
518	300401	花园生物	2,300	26,726.00	0.04
519	600984	建设机械	5,900	26,668.00	0.04
520	601609	金田股份	4,100	26,609.00	0.04
521	603071	物产环能	1,600	26,544.00	0.04
522	300738	奥飞数据	2,600	26,520.00	0.04
523	300232	洲明科技	2,900	26,506.00	0.04
524	300223	北京君正	300	26,493.00	0.04
525	603636	南威软件	1,800	26,406.00	0.04

526	600073	上海梅林	3,600	26,280.00	0.04
527	600997	开滦股份	4,400	26,268.00	0.04
528	688396	华润微	500	26,205.00	0.04
529	300267	尔康制药	8,100	26,163.00	0.04
530	300348	长亮科技	2,500	26,100.00	0.04
531	603612	索通发展	1,500	25,995.00	0.04
532	000767	晋控电力	8,200	25,994.00	0.04
533	301050	雷电微力	400	25,972.00	0.04
534	688018	乐鑫科技	200	25,964.00	0.04
535	003006	百亚股份	1,500	25,920.00	0.04
536	002088	鲁阳节能	1,400	25,816.00	0.04
537	002978	安宁股份	800	25,688.00	0.04
538	600710	苏美达	3,000	25,680.00	0.04
539	603439	贵州三力	1,500	25,590.00	0.04
540	605507	国邦医药	1,200	25,524.00	0.04
541	688368	晶丰明源	200	25,442.00	0.04
542	603392	万泰生物	380	25,372.60	0.04
543	603229	奥翔药业	1,200	25,176.00	0.03
544	600662	外服控股	4,400	25,168.00	0.03
545	301316	慧博云通	1,100	25,135.00	0.03
546	002832	比音勒芬	700	24,787.00	0.03
547	300031	宝通科技	1,000	24,720.00	0.03
548	002007	华兰生物	1,100	24,651.00	0.03
549	603609	禾丰股份	2,700	24,570.00	0.03
549	002214	大立科技	1,800	24,570.00	0.03
550	002697	红旗连锁	4,200	24,528.00	0.03
551	300207	欣旺达	1,500	24,480.00	0.03
552	600968	海油发展	7,900	24,253.00	0.03
553	605388	均瑶健康	1,900	24,149.00	0.03
554	300999	金龙鱼	600	23,994.00	0.03
555	603297	永新光学	300	23,970.00	0.03
556	601238	广汽集团	2,300	23,966.00	0.03
557	000727	冠捷科技	11,300	23,956.00	0.03
558	605339	南侨食品	1,200	23,892.00	0.03
559	300421	力星股份	2,000	23,880.00	0.03
560	300147	香雪制药	4,500	23,715.00	0.03
561	600971	恒源煤电	3,000	23,370.00	0.03
562	601021	春秋航空	400	22,988.00	0.03
563	300457	赢合科技	1,300	22,958.00	0.03
564	002563	森马服饰	3,600	22,392.00	0.03
565	600332	白云山	700	22,316.00	0.03
566	600219	南山铝业	7,300	22,046.00	0.03
567	300456	赛微电子	900	22,032.00	0.03
568	300737	科顺股份	2,400	21,984.00	0.03

569	688190	云路股份	300	21,900.00	0.03
570	300633	开立医疗	400	21,800.00	0.03
571	600197	伊力特	800	21,736.00	0.03
572	603393	新天然气	800	21,472.00	0.03
573	688526	科前生物	900	21,411.00	0.03
574	301217	铜冠铜箔	1,500	21,345.00	0.03
575	688198	佰仁医疗	200	21,222.00	0.03
576	603305	旭升集团	760	21,181.20	0.03
577	603369	今世缘	400	21,120.00	0.03
578	300639	凯普生物	2,100	21,042.00	0.03
579	601658	邮储银行	4,300	21,027.00	0.03
580	300621	维业股份	2,100	21,021.00	0.03
581	688239	航宇科技	300	20,985.00	0.03
582	600612	老凤祥	300	20,964.00	0.03
583	600323	瀚蓝环境	1,100	20,823.00	0.03
584	300763	锦浪科技	200	20,820.00	0.03
585	002422	科伦药业	700	20,776.00	0.03
586	600875	东方电气	1,100	20,515.00	0.03
587	300723	一品红	700	20,510.00	0.03
588	600267	海正药业	1,800	20,484.00	0.03
589	002017	东信和平	1,560	20,451.60	0.03
590	603127	昭衍新药	500	20,450.00	0.03
591	002993	奥海科技	600	20,352.00	0.03
592	002839	张家港行	4,800	20,304.00	0.03
593	002745	木林森	2,200	20,240.00	0.03
594	002174	游族网络	1,200	20,160.00	0.03
595	300136	信维通信	1,000	20,080.00	0.03
596	600918	中泰证券	2,900	20,039.00	0.03
597	601860	紫金银行	7,900	19,829.00	0.03
598	300677	英科医疗	900	19,800.00	0.03
599	002545	东方铁塔	2,800	19,768.00	0.03
600	601878	浙商证券	2,000	19,760.00	0.03
600	600297	广汇汽车	9,500	19,760.00	0.03
601	000032	深桑达 A	600	19,740.00	0.03
602	301087	可孚医疗	400	19,720.00	0.03
603	000813	德展健康	6,700	19,698.00	0.03
604	601872	招商轮船	3,400	19,686.00	0.03
605	603489	八方股份	280	19,633.60	0.03
606	301239	普瑞眼科	200	19,616.00	0.03
607	000723	美锦能源	2,600	19,604.00	0.03
608	000617	中油资本	2,700	19,521.00	0.03
609	600763	通策医疗	200	19,372.00	0.03
610	300124	汇川技术	300	19,263.00	0.03
611	600590	泰豪科技	2,700	19,251.00	0.03

612	002989	中天精装	1,176	19,168.80	0.03
613	603833	欧派家居	200	19,160.00	0.03
614	000783	长江证券	3,300	19,140.00	0.03
615	603816	顾家家居	500	19,075.00	0.03
616	600803	新奥股份	1,000	18,980.00	0.03
617	688187	时代电气	450	18,837.00	0.03
618	002311	海大集团	400	18,736.00	0.03
619	301267	华夏眼科	300	18,285.00	0.03
620	688561	奇安信-U	351	18,185.31	0.03
621	600884	杉杉股份	1,200	18,168.00	0.03
622	002384	东山精密	700	18,130.00	0.03
623	300919	中伟股份	300	18,075.00	0.03
624	603899	晨光股份	400	17,856.00	0.02
625	601801	皖新传媒	1,900	17,841.00	0.02
626	002206	海利得	3,300	17,688.00	0.02
627	002595	豪迈科技	500	17,565.00	0.02
628	300888	稳健医疗	420	17,501.40	0.02
629	600486	扬农化工	200	17,484.00	0.02
630	688033	天宜上佳	900	17,208.00	0.02
631	300383	光环新网	1,600	17,200.00	0.02
632	688475	萤石网络	400	17,144.00	0.02
633	301047	义翘神州	200	17,140.00	0.02
634	300017	网宿科技	2,400	17,064.00	0.02
635	600635	大众公用	5,100	16,932.00	0.02
636	002624	完美世界	1,000	16,890.00	0.02
637	300084	海默科技	2,700	16,875.00	0.02
638	600640	国脉文化	1,400	16,814.00	0.02
639	300097	智云股份	2,500	16,725.00	0.02
640	603733	仙鹤股份	800	16,680.00	0.02
641	002612	朗姿股份	700	16,646.00	0.02
642	300206	理邦仪器	1,100	16,588.00	0.02
643	603032	德新科技	480	16,579.20	0.02
644	600874	创业环保	2,800	16,408.00	0.02
645	600989	宝丰能源	1,300	16,393.00	0.02
646	688005	容百科技	300	16,206.00	0.02
647	603129	春风动力	100	16,190.00	0.02
648	300815	玉禾田	1,080	16,070.40	0.02
649	002061	浙江交科	3,600	16,056.00	0.02
650	601898	中煤能源	1,900	16,036.00	0.02
651	603602	纵横通信	1,300	15,977.00	0.02
652	000885	城发环境	1,200	15,972.00	0.02
653	002126	银轮股份	900	15,930.00	0.02
654	300856	科思股份	200	15,754.00	0.02
655	000421	南京公用	2,900	15,660.00	0.02

656	002063	远光软件	1,800	15,624.00	0.02
657	000507	珠海港	2,800	15,484.00	0.02
658	002865	钧达股份	100	15,253.00	0.02
659	600018	上港集团	2,900	15,225.00	0.02
660	603105	芯能科技	900	15,201.00	0.02
661	601881	中国银河	1,300	15,093.00	0.02
662	002916	深南电路	200	15,074.00	0.02
663	002390	信邦制药	3,400	15,062.00	0.02
664	002536	飞龙股份	1,000	15,000.00	0.02
665	603345	安井食品	100	14,680.00	0.02
666	000877	天山股份	1,800	14,652.00	0.02
667	601155	新城控股	1,000	14,410.00	0.02
668	002064	华峰化学	2,100	14,406.00	0.02
669	000852	石化机械	2,000	14,380.00	0.02
670	002120	韵达股份	1,500	14,340.00	0.02
671	601156	东航物流	1,100	14,300.00	0.02
672	000910	大亚圣象	1,800	14,058.00	0.02
673	603568	伟明环保	800	14,008.00	0.02
674	601216	君正集团	3,400	13,940.00	0.02
675	300101	振芯科技	700	13,573.00	0.02
676	600351	亚宝药业	1,900	13,490.00	0.02
677	002284	亚太股份	1,500	13,455.00	0.02
678	688607	康众医疗	700	13,384.00	0.02
679	601298	青岛港	1,900	13,243.00	0.02
680	002651	利君股份	1,700	13,209.00	0.02
681	688551	科威尔	200	13,116.00	0.02
682	000521	长虹美菱	1,700	12,988.00	0.02
683	601128	常熟银行	1,900	12,958.00	0.02
684	300287	飞利信	2,900	12,905.00	0.02
685	300767	震安科技	500	12,680.00	0.02
686	002293	罗莱生活	1,100	12,650.00	0.02
687	603877	太平鸟	500	12,640.00	0.02
688	688385	复旦微电	251	12,575.10	0.02
689	600606	绿地控股	4,400	12,100.00	0.02
690	688221	前沿生物-U	1,100	11,726.00	0.02
691	600029	南方航空	1,900	11,457.00	0.02
692	600869	远东股份	2,000	11,040.00	0.02
693	600863	内蒙华电	2,600	10,790.00	0.01
694	300811	铂科新材	180	10,699.20	0.01
695	605196	华通线缆	1,500	10,680.00	0.01
696	300773	拉卡拉	600	10,464.00	0.01
697	601600	中国铝业	1,900	10,431.00	0.01
698	002733	雄韬股份	600	10,374.00	0.01
699	600052	东望时代	2,400	10,296.00	0.01

700	300532	今天国际	500	10,280.00	0.01
701	002803	吉宏股份	500	10,230.00	0.01
702	002456	欧菲光	1,800	10,080.00	0.01
703	601958	金钼股份	900	10,035.00	0.01
704	603520	司太立	600	10,008.00	0.01
705	002815	崇达技术	800	9,960.00	0.01
706	601111	中国国航	1,200	9,888.00	0.01
707	300102	乾照光电	1,500	9,870.00	0.01
708	300096	易联众	1,600	9,824.00	0.01
709	000560	我爱我家	3,600	9,540.00	0.01
710	300502	新易盛	140	9,515.80	0.01
711	603979	金诚信	300	9,330.00	0.01
712	688266	泽璟制药-U	200	9,310.00	0.01
713	600717	天津港	2,100	9,303.00	0.01
714	300382	斯莱克	700	9,233.00	0.01
715	603063	禾望电气	300	9,225.00	0.01
716	601588	北辰实业	4,500	9,135.00	0.01
717	000498	山东路桥	1,400	8,988.00	0.01
718	301029	怡合达	200	8,936.00	0.01
719	300957	贝泰妮	100	8,888.00	0.01
720	600120	浙江东方	2,300	8,809.00	0.01
721	688278	特宝生物	200	8,782.00	0.01
722	002987	京北方	400	8,768.00	0.01
723	002204	大连重工	1,700	8,738.00	0.01
724	002643	万润股份	500	8,705.00	0.01
725	300416	苏试试验	400	8,624.00	0.01
726	002847	盐津铺子	100	8,505.00	0.01
727	605266	健之佳	100	8,383.00	0.01
728	601808	中海油服	600	8,328.00	0.01
729	688425	铁建重工	1,700	8,177.00	0.01
730	300203	聚光科技	400	8,108.00	0.01
731	688315	诺禾致源	300	7,965.00	0.01
732	601698	中国卫通	400	7,952.00	0.01
733	688021	奥福环保	300	7,776.00	0.01
734	601236	红塔证券	1,000	7,450.00	0.01
735	001270	铖昌科技	80	6,984.00	0.01
736	300881	盛德鑫泰	200	6,590.00	0.01
737	003011	海象新材	200	6,450.00	0.01
738	300314	戴维医疗	300	6,342.00	0.01
739	002917	金奥博	500	6,180.00	0.01
740	300389	艾比森	300	6,111.00	0.01
741	300590	移为通信	500	6,110.00	0.01
742	600023	浙能电力	1,200	6,084.00	0.01
743	300982	苏文电能	100	6,056.00	0.01

744	002576	通达动力	300	5,997.00	0.01
745	002478	常宝股份	800	5,960.00	0.01
746	600129	太极集团	100	5,949.00	0.01
747	002997	瑞鹄模具	200	5,946.00	0.01
748	002093	国脉科技	700	5,908.00	0.01
749	603518	锦泓集团	500	5,675.00	0.01
750	301257	普蕊斯	100	5,620.00	0.01
751	300335	迪森股份	1,000	5,580.00	0.01
752	601702	华峰铝业	400	5,472.00	0.01
753	603768	常青股份	300	5,331.00	0.01
754	000739	普洛药业	300	5,322.00	0.01
755	603040	新坐标	200	5,318.00	0.01
756	603889	新澳股份	700	5,257.00	0.01
757	688718	唯赛勃	300	5,193.00	0.01
758	603859	能科科技	100	5,113.00	0.01
759	603878	武进不锈	600	5,070.00	0.01
760	603088	宁波精达	600	5,028.00	0.01
761	000055	方大集团	1,000	4,950.00	0.01
762	600636	国新文化	400	4,912.00	0.01
763	300702	天宇股份	200	4,854.00	0.01
764	600820	隧道股份	800	4,808.00	0.01
765	300445	康斯特	300	4,755.00	0.01
766	600888	新疆众和	600	4,752.00	0.01
767	603628	清源股份	300	4,749.00	0.01
768	000557	西部创业	900	4,743.00	0.01
769	002580	圣阳股份	500	4,695.00	0.01
770	603309	维力医疗	300	4,641.00	0.01
771	601098	中南传媒	400	4,640.00	0.01
772	603236	移远通信	80	4,616.80	0.01
773	600985	淮北矿业	400	4,608.00	0.01
774	600794	保税科技	1,300	4,576.00	0.01
775	002728	特一药业	300	4,575.00	0.01
776	688063	派能科技	23	4,559.75	0.01
777	002053	云南能投	400	4,488.00	0.01
778	002011	盾安环境	300	4,149.00	0.01
779	301101	明月镜片	100	4,103.00	0.01
780	600419	天润乳业	200	3,244.00	0.00
781	605077	华康股份	100	2,648.00	0.00
782	300138	晨光生物	100	1,790.00	0.00
783	002507	涪陵榨菜	80	1,464.80	0.00
784	300390	天华新能	40	1,432.00	0.00
785	601519	大智慧	100	716.00	0.00
786	603233	大参林	20	560.20	0.00
787	002378	章源钨业	20	116.40	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	600519	贵州茅台	2,153,521.00	2.81
2	601006	大秦铁路	1,922,024.00	2.51
3	601238	广汽集团	1,705,262.00	2.22
4	300677	英科医疗	1,528,228.00	1.99
5	000001	平安银行	1,406,721.00	1.83
6	601318	中国平安	1,400,450.00	1.83
7	601939	建设银行	1,162,310.00	1.52
8	600036	招商银行	1,121,393.00	1.46
9	300750	宁德时代	1,112,756.00	1.45
10	600011	华能国际	958,724.00	1.25
11	601988	中国银行	878,642.00	1.15
12	002038	双鹭药业	785,311.00	1.02
13	600958	东方证券	728,148.00	0.95
14	600674	川投能源	721,466.00	0.94
15	002142	宁波银行	719,563.00	0.94
16	002460	赣锋锂业	677,745.00	0.88
17	000858	五粮液	664,689.00	0.87
18	601328	交通银行	638,859.00	0.83
19	601166	兴业银行	619,726.00	0.81
20	600030	中信证券	609,891.23	0.80

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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	2,386,283.06	3.11
2	601006	大秦铁路	1,832,674.00	2.39
3	300677	英科医疗	1,719,279.00	2.24
4	601318	中国平安	1,713,489.00	2.23

5	601238	广汽集团	1,639,350.60	2.14
6	000001	平安银行	1,417,476.02	1.85
7	300750	宁德时代	1,340,442.80	1.75
8	000858	五粮液	1,225,185.32	1.60
9	600036	招商银行	997,145.54	1.30
10	601939	建设银行	944,760.00	1.23
11	600030	中信证券	868,267.60	1.13
12	002142	宁波银行	803,983.30	1.05
13	002460	赣锋锂业	739,160.04	0.96
14	600674	川投能源	716,195.28	0.93
15	601899	紫金矿业	677,987.50	0.88
16	000568	泸州老窖	677,636.00	0.88
17	601988	中国银行	675,097.00	0.88
18	002129	TCL 中环	663,109.00	0.86
19	300274	阳光电源	647,990.00	0.84
20	002594	比亚迪	637,737.17	0.83

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	123,147,919.26
卖出股票收入（成交）总额	129,861,275.69

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,733,967.34	5.18
	其中：政策性金融债	3,733,967.34	5.18
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）	7,873.65	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	3,741,840.99	5.19
----	----	--------------	------

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	018008	国开 1802	36,000	3,733,967.34	5.18
2	118031	天 23 转债	70	7,873.65	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据基金合同的要求控制股指期货空头头寸价值占权益类多头头寸价值的比例。在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特征。

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

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 47,531,507.35 元，占基金资产净值的比例为 65.93%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 44,401,020.00 元，占基金资产净值的比例为 61.59%，空头合约市值占股票资产的比例为 93.41%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 4,295.53 元，公允价值变动损益为

344,962.33 元。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚。中国平安保险（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

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。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.13.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,344,137.28
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,344,137.28

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 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

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
7,587	7,884.60	10,000,200.02	16.72%	49,820,291.40	83.28%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	390,949.77	0.6535%

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的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10,000,200.0 2	16.72%	10,000,200.0 2	16.72%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,200.0 2	16.72%	10,000,200.0 2	16.72%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月6日）基金份额总额	1,126,397,761.48
本报告期期初基金份额总额	63,628,946.65
本报告期基金总申购份额	27,902.45
减：本报告期基金总赎回份额	3,836,357.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	59,820,491.42

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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

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	
招商证券	4	253,009,194.95	100.00%	57,437.87	100.00%	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	8	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-

华菁证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

(1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

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
招商证券	17,768.49	100.00%	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	关于广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金运用股指期货进行对冲的投资策略的执行情况公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-08
3	关于广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金第三十二个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-08
4	广发基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金分红方式变更规则的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-23
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
7	关于广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金运用股指期货进行对冲的投资策略的执行情况公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-10
8	关于广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金第三十三个开放期开放申购、赎回和转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-10

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

- 4.《广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 5.法律意见书
- 6.基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7.基金托管人业务资格批件、营业执照

11.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

11.3 查阅方式

- 1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日