

建信中证 500 指数量化增强型发起式证券
投资基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 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。

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	108
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	108
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	108
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	108
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	108
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	108
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	108
8.12 投资组合报告附注	109
§ 9 基金份额持有人信息	109
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	109
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	110
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	110
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	110
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	110
§ 10 开放式基金份额变动	111
§ 11 重大事件揭示	111
11.1 基金份额持有人大会决议	111
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	111
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	112
11.4 基金投资策略的改变	112
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	112
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	112
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	113
11.8 其他重大事件	115
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	116
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	116
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	116
§ 13 备查文件目录	116
13.1 备查文件目录	116
13.2 存放地点	117
13.3 查阅方式	117

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金	
基金简称	建信中证 500 指数量化增强	
基金主代码	016267	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 23 日	
基金管理人	建信基金管理有限责任公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	214,623,580.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
下属分级基金的交易代码	016267	016268
报告期末下属分级基金的份额总额	126,436,026.38 份	88,187,554.06 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以标的指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金投资港股通标的股票的，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	建信基金管理有限责任公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴曙明
	联系电话	010-66228888
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn
		陆志俊
		95559
		luzj@bankcomm.com

客户服务电话	400-81-95533; 010-66228000	95559
传真	010-66228001	021-62701216
注册地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	100033	200336
法定代表人	生柳荣	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
本期已实现收益	-13,865,227.49	-7,991,191.49	1,575.11	79.66
本期利润	-19,068,223.68	-8,523,542.19	25,859.53	2,565.05
加权平均基金份额本期利润	-0.1491	-0.1536	0.0021	0.0021
本期加权平均净值利润率	-14.65%	-15.38%	0.21%	0.21%
本期基金份额净值增长率	-5.47%	-5.75%	0.21%	0.21%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-8,846,454.59	-6,415,287.91	1,575.11	79.66
期末可供分配基	-0.0700	-0.0727	0.0001	0.0001

基金份额利润				
期末基金资产净值	119,769,166.75	83,293,750.93	12,125,459.37	1,240,916.09
期末基金份额净值	0.9473	0.9445	1.0021	1.0021
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	-5.27%	-5.55%	0.21%	0.21%

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

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

3、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。

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

建信中证 500 指数量化增强发起 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.49%	0.78%	-4.36%	0.82%	-0.13%	-0.04%
过去六个月	-9.03%	0.79%	-9.01%	0.81%	-0.02%	-0.02%
过去一年	-5.47%	0.77%	-7.01%	0.78%	1.54%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-5.27%	0.76%	-5.70%	0.78%	0.43%	-0.02%

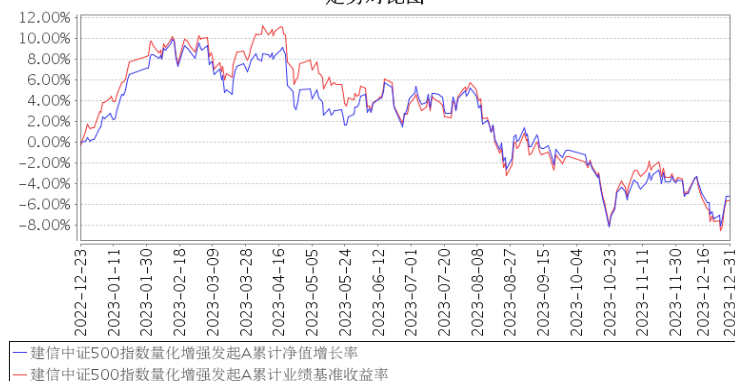
建信中证 500 指数量化增强发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.56%	0.78%	-4.36%	0.82%	-0.20%	-0.04%
过去六个月	-9.17%	0.79%	-9.01%	0.81%	-0.16%	-0.02%

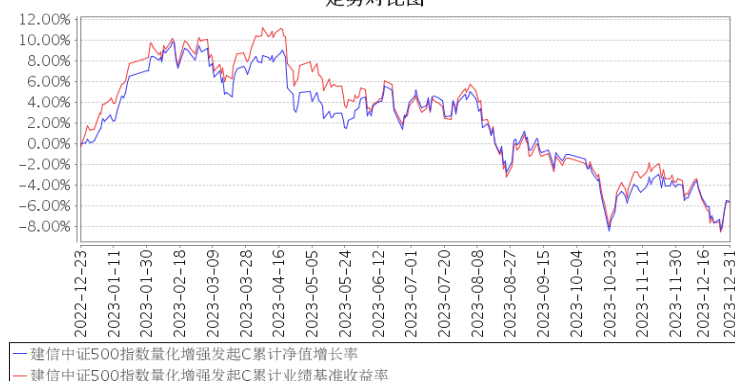
过去一年	-5.75%	0.77%	-7.01%	0.78%	1.26%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	-5.55%	0.76%	-5.70%	0.78%	0.15%	-0.02%

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

建信中证500指数量化增强发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



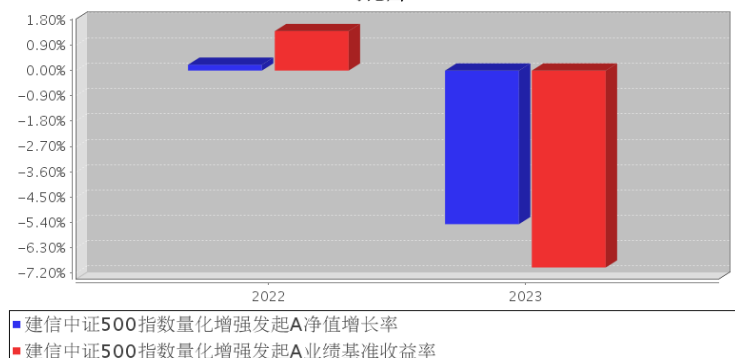
建信中证500指数量化增强发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



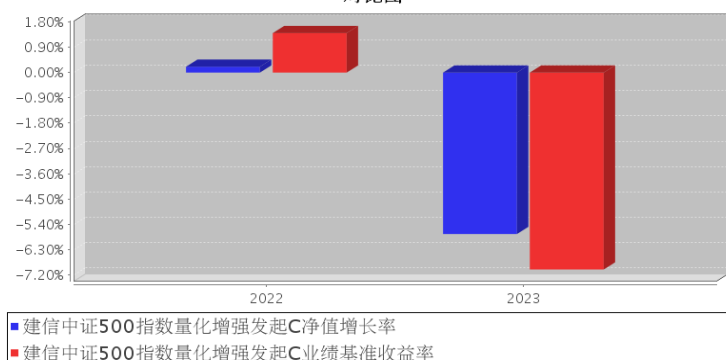
注：本基金基金合同于 2022 年 12 月 23 日生效，截至报告期末建仓结束未满一年。本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同相关规定。

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

建信中证500指数量化增强发起A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



建信中证500指数量化增强发起C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自2022年12月23日起生效，自合同生效以来，本基金未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于2005年9月19日，由中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司合资设立，注册资本2亿元。

公司拥有公开募集证券投资基金、私募资产管理计划、QDII、保险资金受托等业务资格，总部设在北京，下设北京、上海、广州、成都、深圳五家分公司，并分别在上海和香港设立了子公司——建信资本管理有限责任公司、建信资产管理（香港）有限公司。自成立以来，公司秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“善建财富 相伴成长”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“可信赖的财富管理专家，资产管理行业的领跑者”。

公司以持续优秀的管理能力、完善周到的服务，为超过7000万境内外个人和机构投资者提供资产管理解决方案。截至2023年12月31日，公司管理运作163只公开募集证券投资基金以及多个私募资产管理计划，资产管理规模1.03余万亿元。

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		

刘明辉	本基金的基金经理	2022 年 12 月 23 日	-	8	刘明辉先生，硕士。2015 年 7 月毕业于北京大学应用统计专业，同年 7 月加入建信基金，历任金融工程及指数投资部助理研究员、研究员兼投资经理助理、投资经理、基金经理职务。2021 年 10 月 27 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2022 年 10 月 17 日起任建信恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。
叶乐天	数量投资部副经理，本基金的基金经理	2022 年 12 月 23 日	-	15	叶乐天先生，数量投资部副总经理，博士。曾任中国国际金融有限公司市场风险管理分析员、量化分析经理。2011 年 9 月加入建信基金管理有限责任公司，历任基金经理助理、基金经理、金融工程及指数投资部总经理助理、副总经理。2012 年 3 月 21 日至 2016 年 7 月 20 日任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013 年 3 月 28 日起任建信央视财经 50 指数分级发起式证券投资基金的基金经理，该基金自 2021 年 1 月 1 日起转型为建信央视财经 50 指数证券投资基金（LOF），叶乐天继续担任该基金的基金经理；2014 年 1 月 27 日起任建信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2015 年 8 月 26 日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月 9 日起任建信多因子量化股票型证券投资基金的基金经理；2017 年 4 月 18 日至 2023 年 11 月 17 日任建信民丰回报定期开放混合型证券投资基金的基金经理；2017 年 5 月 22 日起任建信鑫荣回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 1 月 10 日至 2022 年 8 月 9 日任建信鑫利回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 8 月 24 日至 2022 年 11 月 17 日任建信量化优享定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 11 月 22 日起任建信中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 11 月 13 日起任建信 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月 15 日起任建信灵活配置混合型证券投资基金基金经理；2022 年 12 月 23 日起任建信中证 500 指数

					量化增强型发起式证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------

注：①上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 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销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《建信基金管理有限责任公司公平交易制度》的规定。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未出现所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为指数增强型基金，基准指数为中证 500 指数。管理人主要采用量化投资的方法对产品进行管理。

在报告期内，管理人充分利用各类数据构建量化模型，挖掘量化因子，基于市场状况及因子表现调整所用的因子种类及权重，构建在量化模型体系中稳健有效的选股因子，结合风险模型，在保持对标的指数的风格和行业进行跟踪、保持一定相似度的基础上精选个股，同时叠加卫星策略，力争获得更高的超额收益与更低的跟踪误差。

在运作期内，管理人利用股指期货对基金仓位调整并利用基差策略进行增强。报告期内，本基金取得了一定的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期本基金 A 净值增长率-5.47%，波动率 0.77%，业绩比较基准收益率-7.01%，波动率 0.78%。本报告期本基金 C 净值增长率-5.75%，波动率 0.77%，业绩比较基准收益率-7.01%，波动率 0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在报告期间，市场整体下行，资金的共识度有所降低，抱团现象减弱，市场主线较弱，小微盘表现非常强势。

2023 年市场已经计入较多悲观预期，当前市场面临的困境在 24 年将有一定改善，其中确定性最高的是盈利的温和修复，其次是外部流动性的改善，中长期信心仍有待进一步观察政策效果和经济修复程度，我们判断 2024 年市场将是一个温和修复的震荡市。

2023 年，主流宽基指数相较于传统基金重仓股票表现更好，给了指数增强类产品更多的机会。中证 500 指数是中盘股的代表性宽基指数，也是被最多指增和量化多头产品作为基准的指数之一。500 增强策略面临的竞争越来越激烈。利用多因子模型进行指数增强时，传统因子收益衰弱乃至失效，高频因子和机器学习模型起到更重要的作用，整体风格向小盘倾斜。小盘特别是微盘股票优异的表现给了量化投资更多的机会，也隐藏着一定的风险。未来，我们既需要进一步提高模型稳健性与精度，挖掘拥挤度低的新因子，也要时刻关注小微盘中的风险。

我们会针对 500 指数设计定制性的策略，保持模型更新速度。持仓方面保持较低的各类风险敞口，保持和指数类似的风格和行业占比，聚焦选股，在紧跟指数的同时，在更加复杂的市场状况中争取获得更高超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，本基金管理人的内部监察稽核工作以保障基金合规运作和基金份额持有人合法权益为出发点，坚持独立、客观、公正的原则，在督察长的指导下，公司风险与合规管理部牵头组织继续完善了风险管控制度和业务流程。报告期内，公司实施了不同形式的检查，对发现的潜在合规风险，及时与有关业务部门沟通并向管理层报告，采取相应措施防范风险。依照有关规定，定期向公司董事会、总裁和监管部门报送监察稽核报告，并根据不定期检查结果，形成专项审计报告，促进了内控体系的不断完善和薄弱环节的持续改进。

在本报告期，本基金管理人在自身经营和基金合法合规运作及内部风险控制中采取了以下措施：

1、根据法律法规以及监管部门的最新规定和公司业务的发展情况，在对公司各业务线管理制度和业务流程重新进行梳理后，制定和完善了一系列管理制度和业务操作流程，使公司基金投资管理运作有章可循。

2、将公司监察稽核工作重心放在事前审查上，把事前审查作为内部风险控制的最主要安全阀门。报告期内，在公司自身经营和受托资产管理过程中，为化解和控制合规风险，事前制定了明确的合规风险控制指标，并相应地将其嵌入系统，实现系统自动管控，减少人工干预环节；对潜在合规风险事项，加强事前审查，以便有效预防和控制公司运营中的潜在合规性风险。

3、要求业务部门进行风险自查工作，以将自查和稽查有效结合。监察稽核工作是在业务部门自身风险控制的基础上所进行的再监督，业务部门作为合规性风险防范的第一道防线，需经常开展合规性风险的自查工作。在准备定期监察稽核报告之前，皆要求业务部门进行风险自查，由内控合规部门对业务部门的自查结果进行事先告知或不告知的现场抽查，以检查落实相关法律法规的遵守以及公司有关管理制度、业务操作流程的执行情况。

4、把事中、事后检查视为监察稽核工作的重要组成部分。根据公司年度监察稽核工作计划，实施了涵盖公司各业务线的稽核检查项目，重点检查了投资、销售、运营等关键业务环节，尤其加强了对容易触发违法违规事件的防控检查，对检查中发现的问题均及时要求相关部门予以整改，并对整改情况进行跟踪检查，促进了公司各项业务的持续健康发展。

5、大力推动监控系统的建设，充分发挥了系统自动监控的作用，尽量减少人工干预可能诱发的合规风险，提高了内控监督检查的效率。

6、通过对新业务、新产品风险识别、评价和预防的培训以及基金行业重大事件的通报，加强了风险管理的宣传，强化了员工的遵规守法意识。

7、在公司内控管理方面，注重借鉴外部审计机构的专业知识、经验以及监管部门现场检查的

意见反馈，重视他们对公司内控管理所作的评价以及提出的建议和意见，并按部门一一沟通，认真进行整改、落实。

8、高度重视与信安金融集团就内部风险控制业务所进行的广泛交流，以吸取其在内控管理方面的成功经验。

9、依据相关法规要求，认真做好本基金的信息披露工作，确保披露信息的真实、准确、完整和及时。

本基金管理人承诺将秉承“持有人利益重于泰山”的原则，秉持“创新、诚信、专业、稳健、共赢”的核心价值观，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，以充分保障持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本公司设立资产估值委员会，主要负责审核和决定受托资产估值相关事宜，确保受托资产估值流程和结果公允合理。资产估值委员会由公司分管核算业务的高管、督察长、风险与合规管理部、投资风险管理部、基金会计部负责人组成。分管投资、研究业务的公司高管、相关投资管理部门负责人、相关研究部门负责人作为投资产品价值研究的专业成员出席资产估值委员会会议。

资产估值委员会成员均为多年从事估值运作、证券行业研究、风险管理工作，熟悉业内法律法规的专家型人员。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未实施利润分配，符合相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，建信基金管理有限责任公司在建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由建信基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2024）审字第 70071792_A75 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度和 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度和 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一

	<p>步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相</p>

	<p>关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	贺 耀 王华敏
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2024 年 3 月 26 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	14,906,927.33	264,095.38
结算备付金		1,966,353.46	-
存出保证金		282,624.00	-
交易性金融资产	7.4.7.2	186,787,042.46	6,109,929.26
其中：股票投资		186,787,042.46	6,109,929.26
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	6,598,268.22
债权投资	7.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	403,463.56
应收股利		-	-
应收申购款		381,463.62	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		204,324,410.87	13,375,756.42
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		970,008.36	-
应付管理人报酬		176,052.21	2,926.83
应付托管费		17,605.21	292.68
应付销售服务费		21,285.97	81.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	76,541.44	6,079.92
负债合计		1,261,493.19	9,380.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	214,623,580.44	13,337,950.88
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-11,560,662.76	28,424.58
净资产合计		203,062,917.68	13,366,375.46
负债和净资产总计		204,324,410.87	13,375,756.42

注：（1）报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 214,623,580.44 份，其中建信中证 500 指数量化增强发起 A 基金份额总额 126,436,026.38 份，基金份额净值人民币 0.9473 元；建信中证 500 指数量化增强发起 C 基金份额总额 88,187,554.06 份，基金份额净值人民币 0.9445 元。

（2）本财务报表的实际编制期间为 2023 年度和 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日（基 金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-25,362,603.57	32,399.85
1. 利息收入		76,134.09	5,296.35
其中：存款利息收入	7.4.7.13	73,859.84	854.93
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		2,274.25	4,441.42
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-19,898,026.40	333.69
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-21,623,769.14	-1,066.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-1,063,006.95	-
股利收益	7.4.7.19	2,788,749.69	1,400.00
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.20	-5,735,346.89	26,769.81
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	194,635.63	-
减：二、营业总支出		2,229,162.30	3,975.27
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,829,881.39	2,926.83
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	182,988.11	292.68
3. 销售服务费		163,505.15	81.53
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		507.91	-
8. 其他费用	7.4.7.23	52,279.74	674.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-27,591,765.87	28,424.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-27,591,765.87	28,424.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-27,591,765.87	28,424.58

7.3 净资产变动表

会计主体：建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,337,950.88	-	28,424.58	13,366,375.46
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	13,337,950.88	-	28,424.58	13,366,375.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	201,285,629.56	-	-11,589,087.34	189,696,542.22
（一）、综合收益总额	-	-	-27,591,765.87	-27,591,765.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	201,285,629.56	-	16,002,678.53	217,288,308.09
其中：1. 基金申购款	593,398,882.97	-	23,971,641.90	617,370,524.87

2. 基金赎回款	-392,113,253.41	-	-7,968,963.37	-400,082,216.78
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	214,623,580.44	-	-11,560,662.76	203,062,917.68
项目	上年度可比期间			
	2022 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	13,337,950.88	-	-	13,337,950.88
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	28,424.58	28,424.58
(一)、综合收益总额	-	-	28,424.58	28,424.58
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-	-
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产	-	-	-	-

产减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	13,337,950.88	-	28,424.58	13,366,375.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张军红

张力铮

丁颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]1423 号《关于准予建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由建信基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 13,334,913.62 元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61490173_A104 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 13,337,950.88 份基金份额，其中认购资金利息折合 3,037.26 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式等不同，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/申购费用但不从本类别基金资产中计提销售服务费、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购/申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用的，称为 C 类基金份额。A 类基金份额、C 类基金份额分设不同的基金代码，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。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为 10,001,889.08 份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、地方政府债券、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率 \times 95%+银行活期存款税后利率 \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人建信基金管理有限责任公司于 2024 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 12 月 31 日和 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度和自 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2023 年度和自 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）起至 2022 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期

信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

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

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

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（3）股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

（4）处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

7.4.6.2 增值税

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，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；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，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。

7.4.6.5 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	6,717,519.25	264,095.38
等于：本金	6,716,980.85	263,629.80
加：应计利息	538.40	465.58
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	8,189,408.08	-
等于：本金	8,188,804.76	-
加：应计利息	603.32	-
减：坏账准备	-	-
合计	14,906,927.33	264,095.38

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		192,477,526.21	-	186,787,042.46	-5,690,483.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		192,477,526.21	-	186,787,042.46	-5,690,483.75
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,083,159.45	-	6,109,929.26	26,769.81
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,083,159.45	-	6,109,929.26	26,769.81

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,373,293.33	-	-	-
	2,373,293.33	-	-	-

其中：股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,373,293.33	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

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

7.4.7.3.2 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
IM2401	IM2401	2.00	2,355,200.00	-18,093.33
合计				-18,093.33
减：可抵销期货暂收款				-18,093.33
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末	
	2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	6,598,268.22	-
银行间市场	-	-
合计	6,598,268.22	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	36,541.44	6,079.92
其中：交易所市场	36,541.44	6,079.92
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	40,000.00	-
合计	76,541.44	6,079.92

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

建信中证 500 指数量化增强发起 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,099,599.84	12,099,599.84
本期申购	275,453,985.67	275,453,985.67
本期赎回（以“-”号填列）	-161,117,559.13	-161,117,559.13
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	126,436,026.38	126,436,026.38

建信中证 500 指数量化增强发起 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,238,351.04	1,238,351.04
本期申购	317,944,897.30	317,944,897.30
本期赎回（以“-”号填列）	-230,995,694.28	-230,995,694.28
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	88,187,554.06	88,187,554.06

注：（1）如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

（2）本基金于 2022 年 11 月 21 日至 2022 年 12 月 21 日向社会公开募集。截至 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）止，建信中证 500 指数量化增强 A 类基金份额募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 12,096,943.41 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 2,656.43 元；建信中证 500 指数量化增强 C 类基金份额募集的扣除认购费后的有效净认购金额为人民币 1,237,970.21 元，有效净认购资金在募集期间产生的利息为人民币 380.83 元。建信中

证 500 指数量化增强 A 类基金份额和 C 类基金份额实收基金合计为人民币 13,337,950.88 元,折合 13,337,950.88 份基金份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

建信中证 500 指数量化增强发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,575.11	24,284.42	25,859.53
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	1,575.11	24,284.42	25,859.53
本期利润	-13,865,227.49	-5,202,996.19	-19,068,223.68
本期基金份额交易产生的变动数	5,017,197.79	7,358,306.73	12,375,504.52
其中：基金申购款	6,525,842.43	10,431,289.30	16,957,131.73
基金赎回款	-1,508,644.64	-3,072,982.57	-4,581,627.21
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,846,454.59	2,179,594.96	-6,666,859.63

建信中证 500 指数量化增强发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	79.66	2,485.39	2,565.05
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	79.66	2,485.39	2,565.05
本期利润	-7,991,191.49	-532,350.70	-8,523,542.19
本期基金份额交易产生的变动数	1,575,823.92	2,051,350.09	3,627,174.01
其中：基金申购款	456,787.29	6,557,722.88	7,014,510.17
基金赎回款	1,119,036.63	-4,506,372.79	-3,387,336.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,415,287.91	1,521,484.78	-4,893,803.13

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	28,227.74	465.58

定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	10,799.55	-
结算备付金利息收入	34,308.83	-
其他	523.72	389.35
合计	73,859.84	854.93

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年12月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-21,623,769.14	-1,066.31
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	-21,623,769.14	-1,066.31

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年12月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	1,282,174,589.26	249,097.00
减：卖出股票成本总额	1,300,366,480.92	243,315.26
减：交易费用	3,431,877.48	6,848.05
买卖股票差价收入	-21,623,769.14	-1,066.31

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月	2022 年 12 月 23 日（基金合同

	31 日	生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-1,063,006.95	-

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,788,749.69	1,400.00
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	2,788,749.69	1,400.00

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-5,717,253.56	26,769.81
股票投资	-5,717,253.56	26,769.81
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-18,093.33	-
权证投资	-	-
股指期货投资	-18,093.33	-
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	-5,735,346.89	26,769.81

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	194,614.73	-
基金转换费收入	20.90	-

合计	194,635.63	-
----	------------	---

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 23 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	-
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	11,853.97	274.23
其他	400.00	400.00
证券组合费	20.94	-
存托服务费	4.83	-
合计	52,279.74	674.23

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司（“建信基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
中国华电集团资本控股有限公司	基金管理人的股东
美国信安金融服务公司	基金管理人的股东
建信资产管理（香港）有限公司	基金管理人的子公司
建信资本管理有限责任公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,829,881.39	2,926.83
其中：应支付销售机构的客户维护费	677,281.62	285.28
应支付基金管理人的净管理费	1,152,599.77	2,641.55

注：支付基金管理人建信基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$
7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	182,988.11	292.68

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$
7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中证 500 指数量 化增强发起 A	建信中证 500 指数量 化增强发起 C	合计
交通银行	-	4.73	4.73
中国建设银行	-	8,886.42	8,886.42
合计	-	8,891.15	8,891.15
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 12 月 23 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	建信中证 500 指数量 化增强发起 A	建信中证 500 指数量 化增强发起 C	合计
	建信基金	-	0.07
中国建设银行	-	55.53	55.53
合计	-	55.60	55.60

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给建信基金，再由建信基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额无销售服务费，C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.30%。销售服务费的计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C

基金合同生效日(2022年12月23日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,889.08	-
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	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.91%	-
项目	上年度可比期间 2022年12月23日(基金合同生效日)至2022年12月31日	
	建信中证500指数量化增强发起A	建信中证500指数量化增强发起C
基金合同生效日(2022年12月23日)持有的基金份额	10,001,889.08	-
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	10,001,889.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	82.66%	-

注:分级持有份额占总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年12月23日(基金合同生效日)至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期	6,717,519.25	28,227.74	264,095.38	465.58

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001239	永达股份	2023 年 12 月 4 日	6 个月	新发未上市	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新发未上市	53.63	75.36	46	2,466.98	3,466.56	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新发未上市	41.00	44.16	64	2,624.00	2,826.24	-
301210	金杨股份	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	57.88	45.48	122	7,061.36	5,548.56	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新发未上市	28.88	34.59	174	5,025.12	6,018.66	-
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	38.13	28.36	238	9,074.94	6,749.68	-
301362	民爆光电	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新发未上市	51.05	38.52	158	8,065.90	6,086.16	-
301371	敷尔	2023 年 7 月	6 个月	新发未上市	55.68	37.58	106	5,902.08	3,983.48	-

	佳	月 24 日		市							
301395	仁信新材	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发 未上 市	26.68	18.69	260	6,936.80	4,859.40	-	
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新发 未上 市	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-	
301418	协昌科技	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新发 未上 市	51.88	50.20	104	5,395.52	5,220.80	-	
301421	波长光电	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新发 未上 市	29.38	59.37	205	6,022.90	12,170.85	-	
301459	丰茂股份	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新发 未上 市	31.90	39.84	176	5,614.40	7,011.84	-	
301469	恒达新材	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新发 未上 市	36.58	33.09	169	6,182.02	5,592.21	-	
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新发 未上 市	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-	
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新发 未上 市	39.78	69.09	165	6,563.70	11,399.85	-	
301489	思泉新材	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新发 未上 市	41.66	64.11	118	4,915.88	7,564.98	-	
301498	乖宝宠物	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新发 未上 市	39.99	38.81	155	6,198.45	6,015.55	-	
301500	飞南	2023 年 9	6 个月	新发 未上	23.97	20.89	195	4,674.15	4,073.55	-	

	资源	月 13 日		市						
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月	新发未上市	10.00	15.85	406	4,060.00	6,435.10	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新发未上市	16.82	26.68	327	5,500.14	8,724.36	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新发未上市	56.56	62.23	107	6,051.92	6,658.61	-
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新发未上市	12.00	35.01	393	4,716.00	13,758.93	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新发未上市	28.00	22.67	234	6,552.00	5,304.78	-
301516	中远通	2023 年 12 月 1 日	6 个月	新发未上市	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新发未上市	26.87	43.69	155	4,164.85	6,771.95	-
301518	长华化学	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新发未上市	25.75	23.01	221	5,690.75	5,085.21	-
301520	万邦医药	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新发未上市	67.88	52.74	93	6,312.84	4,904.82	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新发未上市	99.57	81.46	52	5,177.64	4,235.92	-
301526	国际	2023 年 12 月	6 个月	新发未上	2.66	4.45	3,506	9,325.96	15,601.70	-

	复材	月 19 日		市						
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	6 个月	新发未上市	71.80	68.91	76	5,456.80	5,237.16	-
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新发未上市	36.60	37.88	112	4,099.20	4,242.56	-
301533	威马农机	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新发未上市	29.50	33.16	186	5,487.00	6,167.76	-
301548	崇德科技	2023 年 9 月 11 日	6 个月	新发未上市	66.80	58.99	61	4,074.80	3,598.39	-
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新发未上市	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新发未上市	7.33	13.40	830	6,083.90	11,122.00	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新发未上市	24.22	18.24	286	6,926.92	5,216.64	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新发未上市	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023 年 11 月 21 日	6 个月	新发未上市	23.23	35.58	203	4,715.69	7,222.74	-
301578	辰奕智能	2023 年 12 月 21 日	6 个月	新发未上市	48.94	68.32	106	5,187.64	7,241.92	-
601083	锦江	2023 年 11 月	6 个月	新发未上	11.25	11.07	373	4,196.25	4,129.11	-

	航运	月 28 日		市							
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新发未上市	1.70	4.06	1,698	2,886.60	6,893.88	-	
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新发未上市	16.80	31.19	117	1,965.60	3,649.23	-	
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新发未上市	23.10	23.31	75	1,732.50	1,748.25	-	
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新发未上市	14.23	18.19	172	2,447.56	3,128.68	-	
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新发未上市	15.32	23.87	106	1,623.92	2,530.22	-	
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新发未上市	17.38	16.66	150	2,607.00	2,499.00	-	
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新发未上市	21.29	21.53	98	2,086.42	2,109.94	-	
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新发未上市	21.77	29.58	100	2,177.00	2,958.00	-	
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新发未上市	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-	
603275	众辰科技	2023 年 8 月 16 日	6 个月	新发未上市	49.97	39.70	55	2,748.35	2,183.50	-	
603296	华勤	2023 年 8 月	6 个月	新发未上	80.80	77.75	79	6,383.20	6,142.25	-	

	技术	月 1 日		市						
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新发未上市	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688347	华虹公司	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新发未上市	52.00	42.06	5,122	266,344.00	215,431.32	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新发未上市	9.87	12.75	711	7,017.57	9,065.25	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新发未上市	5.18	8.09	1,082	5,604.76	8,753.38	-
688573	信宇人	2023 年 8 月 9 日	6 个月	新发未上市	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新发未上市	26.74	38.67	205	5,481.70	7,927.35	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新发未上市	24.98	28.02	261	6,519.78	7,313.22	-
688592	司南导航	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新发未上市	50.50	50.53	184	9,292.00	9,297.52	-
688646	逸飞激光	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新发未上市	46.80	36.07	122	5,709.60	4,400.54	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新发未上市	31.95	52.25	176	5,623.20	9,196.00	-
688653	康希	2023 年 11 月	6 个月	新发未上	10.50	15.99	542	5,691.00	8,666.58	-

	通信	月 10 日		市						
688657	浩辰软件	2023 年 9 月 25 日	6 个月	新发未上市	103.40	78.23	58	5,997.20	4,537.34	-
688693	锆威特	2023 年 8 月 10 日	6 个月	新发未上市	40.83	43.41	107	4,368.81	4,644.87	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新发未上市	29.66	36.39	176	5,220.16	6,404.64	-
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26 日	6 个月	新发未上市	55.66	55.66	3,596	200,153.36	200,153.36	-
688717	艾罗能源	2023 年 12 月 26 日	1 个月内(含)	新发未上市	55.66	55.66	1,541	85,772.06	85,772.06	-
688719	爱科赛博	2023 年 9 月 20 日	6 个月	新发未上市	69.98	60.10	101	7,067.98	6,070.10	-
688720	艾森股份	2023 年 11 月 29 日	6 个月	新发未上市	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定政策和程序来识别及分析这些风险，运用特定的风险量化模型和指标评估风险损失的程
度，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对这些风险进行监督
和检查评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

本基金风险管理的主要目标是基金管理人通过事前监测、事中监控和事后评估，有效管理和
控制上述风险，追求基金资产长期稳定增值。

本基金管理人建立了以董事会审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理与内控合规委员
会、督察长、风险与合规管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系，并由独立于公司管理
层和其他业务部门的督察长和风险与合规管理部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行
检查、监督及报告。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的活期存款存放于本基金托管人的帐户，与该机构存款相关的信用风险不重大。本基
金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清
算，违约风险可能性很小。在定期存款和银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并对
证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用产品投资流程，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。按信用评级列示的债券、资产支持证券和同业存单的投资情况如下表所示，如无表格，
则本基金于本期末及上年年末未持有除国债、央行票据、政策性金融债以外的债券。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

公司建立了健全有效的流动性风险内部控制体系，对流动性风险管理的组织架构、职责分工以及指标监控体系进行了明确规定，同时建立了以流动性风险为核心的压力测试体系，由独立的风险管理部门负责压力测试的实施，多维度对投资组合流动性风险进行管控。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

在负债端，基金管理人建立了投资者申购赎回管理机制，结合市场形势对投资者申购赎回情况进行分析，合理控制投资组合持有人结构。在极端情形下，投资组合面临巨额赎回时，基金管理人将根据相关法律法规要求以及基金合同的约定，审慎利用流动性风险管理工具处理赎回申请，保障基金持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指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利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,906,927.33	-	-	-	14,906,927.33
结算备付金	1,966,353.46	-	-	-	1,966,353.46
存出保证金	282,624.00	-	-	-	282,624.00
交易性金融资产	-	-	-	186,787,042.46	186,787,042.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	381,463.62	381,463.62
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,155,904.79	-	-	187,168,506.08	204,324,410.87
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	970,008.36	970,008.36
应付管理人报酬	-	-	-	176,052.21	176,052.21
应付托管费	-	-	-	17,605.21	17,605.21
应付销售服务费	-	-	-	21,285.97	21,285.97
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	76,541.44	76,541.44
负债总计	-	-	-	1,261,493.19	1,261,493.19
利率敏感度缺口	17,155,904.79	-	-	-185,907,012.89	203,062,917.68
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					
货币资金	264,095.38	-	-	-	264,095.38
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	6,109,929.26	6,109,929.26
衍生金融资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	403,463.56	403,463.56
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,598,268.22	-	-	-	6,598,268.22
资产总计	6,862,363.60	-	-	6,513,392.82	13,375,756.42
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,079.92	6,079.92
应付托管费	-	-	-	292.68	292.68
应付销售服务费	-	-	-	81.53	81.53
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,926.83	2,926.83
负债总计	-	-	-	9,380.96	9,380.96
利率敏感度缺口	6,862,363.60	-	-	6,504,011.86	13,366,375.46

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	186,787,042.46	91.98	6,109,929.26	45.71
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	186,787,042.46	91.98	6,109,929.26	45.71

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	9,573,168.25	-
	业绩比较基准下降 5%	-9,573,168.25	-

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	185,834,244.09	6,109,929.26
第二层次	285,925.42	-
第三层次	666,872.95	-
合计	186,787,042.46	6,109,929.26

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	604,589.85	604,589.85
当期出售/结算	-	-	-

转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	62,283.10	62,283.10
其中：计入损益的利得或损失	-	62,283.10	62,283.10
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	666,872.95	666,872.95
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	62,283.10	62,283.10
项目	上年度可比期间 2022年12月23日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售期股票投资	666,872.95	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	负相关
项目	上年度末公	采用的估值	不可观察输入值		

	允价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

无。

7.4.15.2 其他事项

无。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 26 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	186,787,042.46	91.42
	其中：股票	186,787,042.46	91.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	16,873,280.79	8.26

8	其他各项资产	664,087.62	0.33
9	合计	204,324,410.87	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	1,041,108.00	0.51
B	采矿业	7,557,121.00	3.72
C	制造业	92,045,792.74	45.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,222,475.85	3.06
E	建筑业	2,613,996.00	1.29
F	批发和零售业	3,328,066.15	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	3,869,118.34	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,866,235.80	5.35
J	金融业	13,945,032.44	6.87
K	房地产业	1,117,746.00	0.55
L	租赁和商务服务业	2,342,652.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	1,063,777.96	0.52
N	水利、环境和公共设施管理业	551,640.00	0.27
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,687,871.00	1.82
S	综合	634,778.00	0.31
	合计	150,887,411.28	74.31

8.2.2 报告期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,574,101.80	13.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,142.00	0.01

E	建筑业	577,198.00	0.28
F	批发和零售业	1,190,463.23	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	4,129.11	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,514,005.44	1.24
J	金融业	2,202,959.00	1.08
K	房地产业	768,405.00	0.38
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	25,835.43	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	1,151,834.17	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	876,500.00	0.43
S	综合	-	-
	合计	35,899,631.18	17.68

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	600637	东方明珠	377,300	2,837,296.00	1.40
2	600901	江苏金租	571,820	2,767,608.80	1.36
3	601958	金钼股份	291,600	2,755,620.00	1.36
4	000987	越秀资本	450,082	2,709,493.64	1.33
5	601611	中国核建	377,200	2,613,996.00	1.29
6	002399	海普瑞	217,200	2,547,756.00	1.25
7	000959	首钢股份	730,000	2,525,800.00	1.24
8	002608	江苏国信	383,900	2,522,223.00	1.24
9	600927	永安期货	160,000	2,513,600.00	1.24
10	600642	申能股份	390,900	2,509,578.00	1.24
11	688728	格科微	122,200	2,501,434.00	1.23
12	600299	安迪苏	312,300	2,498,400.00	1.23

13	002653	海思科	106,700	2,470,105.00	1.22
14	002600	领益智造	364,300	2,462,668.00	1.21
15	000050	深天马 A	228,800	2,436,720.00	1.20
16	600737	中粮糖业	295,500	2,434,920.00	1.20
17	603517	绝味食品	90,500	2,430,830.00	1.20
18	600153	建发股份	251,500	2,421,945.00	1.19
19	000060	中金岭南	556,100	2,402,352.00	1.18
20	601168	西部矿业	167,800	2,394,506.00	1.18
21	300136	信维通信	100,400	2,369,440.00	1.17
22	688234	天岳先进	35,800	2,365,306.00	1.16
23	000553	安道麦 A	340,200	2,360,988.00	1.16
24	603026	胜华新材	51,100	2,343,446.00	1.15
25	600350	山东高速	315,861	2,192,075.34	1.08
26	600765	中航重机	102,700	1,962,597.00	0.97
27	688276	百克生物	35,400	1,940,274.00	0.96
28	600517	国网英大	404,900	1,931,373.00	0.95
29	600161	天坛生物	62,240	1,925,705.60	0.95
30	000932	华菱钢铁	372,000	1,915,800.00	0.94
31	600967	内蒙一机	230,700	1,905,582.00	0.94
32	000156	华数传媒	246,800	1,818,916.00	0.90
33	600801	华新水泥	142,000	1,765,060.00	0.87
34	600482	中国动力	97,000	1,746,970.00	0.86
35	603893	瑞芯微	24,200	1,534,280.00	0.76
36	000739	普洛药业	96,800	1,489,752.00	0.73
37	300251	光线传媒	176,700	1,440,105.00	0.71
38	603228	景旺电子	61,400	1,385,184.00	0.68
39	300682	朗新集团	84,100	1,378,399.00	0.68
40	603160	汇顶科技	18,800	1,299,080.00	0.64
41	002019	亿帆医药	87,500	1,293,250.00	0.64
42	600062	华润双鹤	68,900	1,281,540.00	0.63
43	600415	小商品城	172,700	1,264,164.00	0.62
44	603786	科博达	17,700	1,263,072.00	0.62
45	600566	济川药业	40,100	1,260,343.00	0.62
46	600066	宇通客车	94,900	1,257,425.00	0.62
47	600481	双良节能	145,000	1,226,700.00	0.60
48	600498	烽火通信	73,700	1,226,368.00	0.60
49	002563	森马服饰	206,400	1,190,928.00	0.59
50	600985	淮北矿业	70,700	1,175,741.00	0.58
51	002557	洽洽食品	32,500	1,131,650.00	0.56
52	600885	宏发股份	40,900	1,130,476.00	0.56
53	603650	彤程新材	33,600	1,118,880.00	0.55
54	300001	特锐德	51,800	1,041,180.00	0.51
55	002299	圣农发展	60,600	1,041,108.00	0.51

56	688072	拓荆科技	4,400	1,017,720.00	0.50
57	688772	珠海冠宇	46,200	1,016,862.00	0.50
58	000930	中粮科技	152,800	1,014,592.00	0.50
59	002294	信立泰	29,200	953,672.00	0.47
60	002368	太极股份	31,600	933,148.00	0.46
61	688105	诺唯赞	29,098	931,717.96	0.46
62	603737	三棵树	19,300	918,873.00	0.45
63	002025	航天电器	18,800	902,776.00	0.44
64	600546	山煤国际	51,500	901,765.00	0.44
65	600131	国网信通	58,900	892,335.00	0.44
66	603866	桃李面包	114,500	877,070.00	0.43
67	000729	燕京啤酒	101,400	875,082.00	0.43
68	002423	中粮资本	131,000	875,080.00	0.43
69	600369	西南证券	213,700	874,033.00	0.43
70	300383	光环新网	88,200	857,304.00	0.42
71	002429	兆驰股份	153,000	853,740.00	0.42
72	601555	东吴证券	116,300	850,153.00	0.42
73	603056	德邦股份	58,700	849,389.00	0.42
74	000537	中绿电	84,900	817,587.00	0.40
75	300395	菲利华	21,900	800,664.00	0.39
76	002408	齐翔腾达	151,200	798,336.00	0.39
77	600582	天地科技	145,700	792,608.00	0.39
78	002153	石基信息	80,020	779,394.80	0.38
79	000785	居然之家	233,700	771,210.00	0.38
80	002867	周大生	50,800	771,144.00	0.38
81	600167	联美控股	134,200	760,914.00	0.37
82	601598	中国外运	143,000	749,320.00	0.37
83	601577	长沙银行	105,300	718,146.00	0.35
84	688208	道通科技	29,768	706,990.00	0.35
85	002465	海格通信	52,400	673,340.00	0.33
86	603000	人民网	23,900	668,722.00	0.33
87	601666	平煤股份	57,600	665,856.00	0.33
88	600673	东阳光	86,600	634,778.00	0.31
89	603379	三美股份	18,600	632,400.00	0.31
90	002444	巨星科技	27,300	614,796.00	0.30
91	000997	新大陆	30,900	605,949.00	0.30
92	300502	新易盛	11,900	586,908.00	0.29
93	603185	弘元绿能	17,500	582,400.00	0.29
94	300253	卫宁健康	80,700	580,233.00	0.29
95	600839	四川长虹	109,000	576,610.00	0.28
96	600339	中油工程	186,600	565,398.00	0.28
97	000988	华工科技	18,300	544,608.00	0.27
98	688567	孚能科技	32,800	534,968.00	0.26

99	601231	环旭电子	34,400	519,784.00	0.26
100	603596	伯特利	7,100	492,030.00	0.24
101	600079	人福医药	19,400	482,284.00	0.24
102	300212	易华录	14,900	468,605.00	0.23
103	301236	软通动力	10,000	462,000.00	0.23
104	688169	石头科技	1,600	452,720.00	0.22
105	601139	深圳燃气	57,700	397,553.00	0.20
106	300394	天孚通信	4,300	393,536.00	0.19
107	603317	天味食品	27,100	360,159.00	0.18
108	000423	东阿阿胶	7,100	350,172.00	0.17
109	600928	西安银行	101,800	338,994.00	0.17
110	603355	莱克电气	14,900	332,270.00	0.16
111	600129	太极集团	6,900	320,574.00	0.16
112	601828	美凯龙	79,400	307,278.00	0.15
113	600977	中国电影	24,900	304,776.00	0.15
114	002266	浙富控股	89,600	304,640.00	0.15
115	600764	中国海防	11,600	289,420.00	0.14
116	002373	千方科技	24,900	279,129.00	0.14
117	600535	天士力	16,400	279,128.00	0.14
118	601106	中国一重	93,100	268,128.00	0.13
119	600126	杭钢股份	49,000	261,170.00	0.13
120	000021	深科技	15,600	252,876.00	0.12
121	600329	达仁堂	7,500	252,375.00	0.12
122	000967	盈峰环境	52,000	247,000.00	0.12
123	002281	光迅科技	8,500	242,250.00	0.12
124	600416	湘电股份	14,900	236,612.00	0.12
125	600095	湘财股份	30,500	229,055.00	0.11
126	000960	锡业股份	15,700	224,824.00	0.11
127	600418	江淮汽车	13,300	214,795.00	0.11
128	603338	浙江鼎力	4,100	209,797.00	0.10
129	603218	日月股份	15,500	191,735.00	0.09
130	002032	苏泊尔	3,400	180,234.00	0.09
131	300474	景嘉微	2,500	176,775.00	0.09
132	600707	彩虹股份	23,800	160,650.00	0.08
133	600663	陆家嘴	18,000	157,500.00	0.08
134	000402	金融街	39,300	142,659.00	0.07
135	601077	渝农商行	33,700	137,496.00	0.07
136	300012	华测检测	9,300	132,060.00	0.07
137	601098	中南传媒	12,200	124,074.00	0.06
138	002195	岩山科技	40,300	123,721.00	0.06
139	603305	旭升集团	5,900	116,407.00	0.06
140	002791	坚朗五金	2,800	113,372.00	0.06
141	601156	东航物流	5,300	78,334.00	0.04

142	002064	华峰化学	9,300	62,403.00	0.03
143	003031	中瓷电子	700	61,761.00	0.03
144	002463	沪电股份	1,500	33,180.00	0.02
145	001286	陕西能源	3,767	32,207.85	0.02
146	688063	派能科技	184	19,504.00	0.01
147	688220	翱捷科技	81	5,705.64	0.00
148	601061	中信金属	565	4,356.15	0.00
149	689009	九号公司	25	741.50	0.00

8.3.2 期末积极投资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	300122	智飞生物	26,400	1,613,304.00	0.79
2	300695	兆丰股份	26,900	1,424,624.00	0.70
3	603730	岱美股份	78,800	1,141,812.00	0.56
4	688466	金科环境	64,311	1,141,520.25	0.56
5	002436	兴森科技	72,100	1,062,033.00	0.52
6	300870	欧陆通	23,900	1,058,053.00	0.52
7	603112	华翔股份	86,700	1,053,405.00	0.52
8	300286	安科瑞	40,100	1,039,793.00	0.51
9	300851	交大思诺	28,300	882,111.00	0.43
10	600746	江苏索普	113,300	829,356.00	0.41
11	688077	大地熊	34,376	819,867.60	0.40
12	688015	交控科技	39,200	735,392.00	0.36
13	605158	华达新材	94,800	720,480.00	0.35
14	300965	恒宇信通	13,300	705,964.00	0.35
15	600276	恒瑞医药	15,400	696,542.00	0.34
16	688232	新点软件	18,600	673,320.00	0.33
17	603277	银都股份	25,100	673,182.00	0.33
18	601169	北京银行	148,100	670,893.00	0.33
19	603093	南华期货	54,600	655,200.00	0.32
20	002790	瑞尔特	60,700	633,708.00	0.31
21	601019	山东出版	64,500	605,010.00	0.30
22	688231	隆达股份	24,780	545,407.80	0.27
23	000403	派林生物	19,734	537,554.16	0.26
24	600675	中华企业	160,800	506,520.00	0.25
25	300905	宝丽迪	25,300	490,314.00	0.24
26	002811	郑中设计	48,700	479,695.00	0.24
27	688580	伟思医疗	7,400	473,082.00	0.23
28	301015	百洋医药	13,100	469,766.00	0.23
29	603551	奥普家居	43,800	463,842.00	0.23
30	688357	建龙微纳	8,600	444,534.00	0.22
31	601702	华峰铝业	24,300	436,185.00	0.21
32	600015	华夏银行	76,700	431,054.00	0.21

33	000963	华东医药	10,000	414,600.00	0.20
34	688569	铁科轨道	14,200	392,062.00	0.19
35	603221	爱丽家居	38,900	386,666.00	0.19
36	300455	航天智装	32,200	384,468.00	0.19
37	002946	新乳业	33,400	383,432.00	0.19
38	601698	中国卫通	22,000	380,820.00	0.19
39	600016	民生银行	94,800	354,552.00	0.17
40	603823	百合花	35,700	351,288.00	0.17
41	301121	紫建电子	7,900	328,324.00	0.16
42	688226	威腾电气	16,600	312,080.00	0.15
43	688682	霍莱沃	6,400	305,344.00	0.15
44	300337	银邦股份	37,600	304,184.00	0.15
45	300765	新诺威	8,300	303,946.00	0.15
46	603192	汇得科技	15,300	300,645.00	0.15
47	688420	美腾科技	11,200	289,408.00	0.14
48	688717	艾罗能源	5,137	285,925.42	0.14
49	605369	拱东医疗	4,900	273,518.00	0.13
50	603699	纽威股份	19,600	271,656.00	0.13
51	300657	弘信电子	13,800	267,582.00	0.13
52	000863	三湘印象	66,300	261,885.00	0.13
53	300705	九典制药	7,800	259,194.00	0.13
54	002880	卫光生物	7,100	249,423.00	0.12
55	688300	联瑞新材	4,573	242,140.35	0.12
56	603926	铁流股份	18,500	231,435.00	0.11
57	688055	龙腾光电	45,400	221,552.00	0.11
58	688347	华虹公司	5,122	215,431.32	0.11
59	688020	方邦股份	4,200	203,616.00	0.10
60	601138	工业富联	13,100	198,072.00	0.10
61	603897	长城科技	9,600	196,608.00	0.10
62	603108	润达医疗	9,200	187,220.00	0.09
63	300291	百纳千成	27,600	177,744.00	0.09
64	603800	道森股份	6,600	174,240.00	0.09
65	600186	莲花健康	27,900	168,795.00	0.08
66	300580	贝斯特	5,300	160,484.00	0.08
67	300709	精研科技	5,100	159,069.00	0.08
68	688003	天准科技	4,200	157,584.00	0.08
69	688191	智洋创新	6,600	122,100.00	0.06
70	688128	中国电研	5,843	119,898.36	0.06
71	603489	八方股份	1,900	104,405.00	0.05
72	603612	索通发展	6,700	103,113.00	0.05
73	688258	卓易信息	2,000	99,000.00	0.05
74	603283	赛腾股份	1,300	94,328.00	0.05
75	601858	中国科传	3,800	93,746.00	0.05

76	000617	中油资本	16,900	91,260.00	0.04
77	300621	维业股份	6,700	76,983.00	0.04
78	300823	建科机械	3,300	70,983.00	0.03
79	601086	国芳集团	13,300	69,958.00	0.03
80	688622	禾信仪器	1,011	36,345.45	0.02
81	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
82	000950	重药控股	5,500	27,335.00	0.01
83	688235	百济神州	182	25,305.28	0.01
84	601800	中国交建	2,700	20,520.00	0.01
85	000534	万泽股份	1,500	19,635.00	0.01
86	601339	百隆东方	3,600	17,532.00	0.01
87	002957	科瑞技术	900	17,289.00	0.01
88	301526	国际复材	3,506	15,601.70	0.01
89	688443	智翔金泰	364	14,541.80	0.01
90	301383	天键股份	215	13,975.00	0.01
91	301510	固高科技	393	13,758.93	0.01
92	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.01
93	688629	华丰科技	571	12,504.90	0.01
94	688621	阳光诺和	175	12,206.25	0.01
95	301421	波长光电	205	12,170.85	0.01
96	301488	豪恩汽电	165	11,399.85	0.01
97	002015	协鑫能科	900	11,142.00	0.01
98	301558	三态股份	830	11,122.00	0.01
99	688469	芯联集成	2,174	10,913.48	0.01
100	688048	长光华芯	173	10,841.91	0.01
101	301320	豪江智能	557	10,287.79	0.01
102	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
103	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
104	688592	司南导航	184	9,297.52	0.00
105	688472	阿特斯	731	9,232.53	0.00
106	688652	京仪装备	176	9,196.00	0.00
107	688548	广钢气体	711	9,065.25	0.00
108	688562	航天软件	369	8,856.00	0.00
109	688549	中巨芯	1,082	8,753.38	0.00
110	301508	中机认检	327	8,724.36	0.00
111	688653	康希通信	542	8,666.58	0.00
112	688377	迪威尔	318	8,528.76	0.00
113	301315	威士顿	158	8,351.88	0.00
114	301141	中科磁业	178	8,284.12	0.00
115	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
116	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
117	688582	芯动联科	205	7,927.35	0.00
118	301382	蜂助手	216	7,693.92	0.00

119	301262	海看股份	245	7,631.75	0.00
120	301489	思泉新材	118	7,564.98	0.00
121	688543	国科军工	134	7,490.60	0.00
122	688591	泰凌微	261	7,313.22	0.00
123	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
124	301578	辰奕智能	106	7,241.92	0.00
125	301568	思泰克	203	7,222.74	0.00
126	301225	恒勃股份	200	7,160.00	0.00
127	688217	睿昂基因	200	7,156.00	0.00
128	301310	鑫宏业	147	7,151.55	0.00
129	301459	丰茂股份	176	7,011.84	0.00
130	601096	宏盛华源	1,698	6,893.88	0.00
131	301517	陕西华达	155	6,771.95	0.00
132	688593	新相微	460	6,771.20	0.00
133	688523	航天环宇	252	6,758.64	0.00
134	301291	明阳电气	238	6,749.68	0.00
135	301295	美硕科技	202	6,704.38	0.00
136	301429	森泰股份	327	6,683.88	0.00
137	301509	金凯生科	107	6,658.61	0.00
138	688576	西山科技	69	6,632.97	0.00
139	301507	民生健康	406	6,435.10	0.00
140	688716	中研股份	176	6,404.64	0.00
141	301533	威马农机	186	6,167.76	0.00
142	301397	溯联股份	136	6,144.48	0.00
143	603296	华勤技术	79	6,142.25	0.00
144	301362	民爆光电	158	6,086.16	0.00
145	688719	爱科赛博	101	6,070.10	0.00
146	301251	威尔高	174	6,018.66	0.00
147	301498	乖宝宠物	155	6,015.55	0.00
148	688273	麦澜德	180	5,995.80	0.00
149	301399	英特科技	153	5,855.31	0.00
150	688581	安杰思	46	5,741.26	0.00
151	688458	美芯晟	74	5,695.04	0.00
152	688552	航天南湖	239	5,614.11	0.00
153	301469	恒达新材	169	5,592.21	0.00
154	301210	金杨股份	122	5,548.56	0.00
155	301376	致欧科技	231	5,525.52	0.00
156	688570	天玛智控	200	5,442.00	0.00
157	688512	慧智微	278	5,418.22	0.00
158	301203	国泰环保	139	5,404.32	0.00
159	301511	德福科技	234	5,304.78	0.00
160	301528	多浦乐	76	5,237.16	0.00
161	301418	协昌科技	104	5,220.80	0.00

162	688433	华曙高科	167	5,218.75	0.00
163	301559	中集环科	286	5,216.64	0.00
164	688519	南亚新材	200	5,152.00	0.00
165	688631	莱斯信息	145	5,111.25	0.00
166	301518	长华化学	221	5,085.21	0.00
167	688066	航天宏图	119	5,026.56	0.00
168	301355	南王科技	327	4,954.05	0.00
169	300804	广康生化	160	4,937.60	0.00
170	001287	中电港	237	4,936.71	0.00
171	301305	朗坤环境	272	4,909.60	0.00
172	301520	万邦医药	93	4,904.82	0.00
173	301395	仁信新材	260	4,859.40	0.00
174	688683	莱尔科技	187	4,783.46	0.00
175	688693	锆威特	107	4,644.87	0.00
176	301332	德尔玛	380	4,643.60	0.00
177	688657	浩辰软件	58	4,537.34	0.00
178	688646	逸飞激光	122	4,400.54	0.00
179	301529	福赛科技	112	4,242.56	0.00
180	301525	儒竞科技	52	4,235.92	0.00
181	301232	飞沃科技	87	4,218.63	0.00
182	301170	锡南科技	138	4,199.34	0.00
183	688429	时创能源	195	4,132.05	0.00
184	601083	锦江航运	373	4,129.11	0.00
185	301337	亚华电子	134	4,101.74	0.00
186	301500	飞南资源	195	4,073.55	0.00
187	301371	敷尔佳	106	3,983.48	0.00
188	301323	新莱福	106	3,920.94	0.00
189	001380	华纬科技	112	3,902.08	0.00
190	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
191	688623	双元科技	52	3,690.96	0.00
192	603004	鼎龙科技	117	3,649.23	0.00
193	301548	崇德科技	61	3,598.39	0.00
194	688028	沃尔德	140	3,484.60	0.00
195	001306	夏厦精密	46	3,466.56	0.00
196	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
197	688081	兴图新科	193	3,321.53	0.00
198	603107	上海汽配	172	3,128.68	0.00
199	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
200	603270	金帝股份	100	2,958.00	0.00
201	688192	迪哲医药	61	2,918.85	0.00
202	001358	兴欣新材	64	2,826.24	0.00
203	603119	浙江荣泰	106	2,530.22	0.00
204	688323	瑞华泰	117	2,511.99	0.00

205	603193	润本股份	150	2,499.00	0.00
206	688352	颀中科技	149	2,296.09	0.00
207	603275	众辰科技	55	2,183.50	0.00
208	603172	万丰股份	122	2,150.86	0.00
209	603231	索宝蛋白	98	2,109.94	0.00
210	603075	热威股份	75	1,748.25	0.00
211	688146	中船特气	31	1,054.31	0.00
212	002755	奥赛康	2	21.64	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603228	景旺电子	9,384,446.00	70.21
2	300308	中际旭创	8,293,465.36	62.05
3	600131	国网信通	8,019,548.00	60.00
4	603737	三棵树	7,991,113.87	59.79
5	603259	药明康德	7,586,218.00	56.76
6	600901	江苏金租	7,326,354.00	54.81
7	600871	石化油服	7,268,035.00	54.38
8	603355	莱克电气	7,245,439.63	54.21
9	601958	金钼股份	6,948,255.00	51.98
10	000987	越秀资本	6,906,821.60	51.67
11	601555	东吴证券	6,763,458.00	50.60
12	601928	凤凰传媒	6,736,095.00	50.40
13	000739	普洛药业	6,467,615.00	48.39
14	002299	圣农发展	6,331,070.00	47.37
15	600276	恒瑞医药	6,187,120.00	46.29
16	000553	安道麦 A	6,155,304.00	46.05
17	601598	中国外运	6,143,538.00	45.96
18	300896	爱美客	6,047,561.00	45.24
19	603056	德邦股份	6,031,036.00	45.12
20	000423	东阿阿胶	6,019,336.00	45.03
21	000630	铜陵有色	5,967,070.00	44.64
22	600637	东方明珠	5,904,086.00	44.17
23	601869	长飞光纤	5,820,790.00	43.55
24	600498	烽火通信	5,789,401.00	43.31
25	600927	永安期货	5,759,665.00	43.09
26	002262	恩华药业	5,743,387.00	42.97
27	600655	豫园股份	5,683,347.64	42.52
28	002273	水晶光电	5,647,504.00	42.25
29	002192	融捷股份	5,624,556.00	42.08
30	002563	森马服饰	5,623,822.00	42.07

31	300015	爱尔眼科	5,585,641.00	41.79
32	600566	济川药业	5,537,620.00	41.43
33	600373	中文传媒	5,506,142.00	41.19
34	601611	中国核建	5,465,777.00	40.89
35	002373	千方科技	5,429,541.00	40.62
36	601139	深圳燃气	5,419,099.00	40.54
37	000997	新大陆	5,384,501.00	40.28
38	600167	联美控股	5,373,340.06	40.20
39	600299	安迪苏	5,368,628.00	40.17
40	601231	环旭电子	5,254,637.00	39.31
41	688006	杭可科技	5,211,785.91	38.99
42	000988	华工科技	5,152,614.00	38.55
43	600079	人福医药	5,067,256.00	37.91
44	002518	科士达	5,011,293.69	37.49
45	000959	首钢股份	4,969,575.00	37.18
46	002244	滨江集团	4,910,630.00	36.74
47	600517	国网英大	4,879,167.00	36.50
48	002384	东山精密	4,824,353.00	36.09
49	000513	丽珠集团	4,803,064.00	35.93
50	688772	珠海冠宇	4,780,495.80	35.77
51	300741	华宝股份	4,699,215.98	35.16
52	603225	新凤鸣	4,697,577.00	35.14
53	600398	海澜之家	4,693,882.91	35.12
54	002368	太极股份	4,671,762.00	34.95
55	601098	中南传媒	4,641,462.00	34.72
56	600129	太极集团	4,630,960.00	34.65
57	600967	内蒙一机	4,576,886.00	34.24
58	603517	绝味食品	4,564,674.00	34.15
59	002925	盈趣科技	4,447,997.00	33.28
60	002080	中材科技	4,426,208.00	33.11
61	002926	华西证券	4,415,320.00	33.03
62	601336	新华保险	4,414,120.24	33.02
63	600489	中金黄金	4,319,773.00	32.32
64	601966	玲珑轮胎	4,316,450.00	32.29
65	300682	朗新集团	4,285,114.00	32.06
66	688208	道通科技	4,267,886.24	31.93
67	603650	彤程新材	4,230,658.00	31.65
68	000898	鞍钢股份	4,202,976.30	31.44
69	603317	天味食品	4,196,154.40	31.39
70	600160	巨化股份	4,175,825.00	31.24
71	600663	陆家嘴	4,170,807.57	31.20
72	002372	伟星新材	4,156,328.60	31.10
73	002739	万达电影	4,116,389.00	30.80

74	603712	七一二	4,099,836.00	30.67
75	600027	华电国际	4,091,718.12	30.61
76	601168	西部矿业	4,085,527.00	30.57
77	603338	浙江鼎力	4,058,700.00	30.37
78	002423	中粮资本	4,044,284.00	30.26
79	688256	寒武纪	4,031,210.60	30.16
80	002463	沪电股份	3,997,946.60	29.91
81	688276	百克生物	3,971,625.07	29.71
82	002653	海思科	3,939,886.00	29.48
83	603688	石英股份	3,906,867.00	29.23
84	300418	昆仑万维	3,895,652.00	29.15
85	000975	银泰黄金	3,893,720.00	29.13
86	688273	麦澜德	3,876,077.63	29.00
87	000060	中金岭南	3,847,755.00	28.79
88	600707	彩虹股份	3,841,213.00	28.74
89	600642	申能股份	3,840,863.00	28.74
90	000932	华菱钢铁	3,785,616.00	28.32
91	600415	小商品城	3,780,529.00	28.28
92	603026	胜华新材	3,777,057.00	28.26
93	002250	联化科技	3,765,706.00	28.17
94	002138	顺络电子	3,733,628.00	27.93
95	002399	海普瑞	3,708,661.00	27.75
96	000869	张裕 A	3,705,819.92	27.72
97	002532	天山铝业	3,700,150.00	27.68
98	002938	鹏鼎控股	3,698,922.00	27.67
99	688234	天岳先进	3,679,012.26	27.52
100	000960	锡业股份	3,671,251.00	27.47
101	600535	天士力	3,670,605.00	27.46
102	603638	艾迪精密	3,666,383.00	27.43
103	600038	中直股份	3,657,791.00	27.37
104	603786	科博达	3,642,766.00	27.25
105	600764	中国海防	3,642,539.00	27.25
106	000967	盈峰环境	3,637,827.00	27.22
107	688390	固德威	3,620,366.58	27.09
108	603927	中科软	3,565,803.80	26.68
109	601003	柳钢股份	3,565,718.51	26.68
110	000776	广发证券	3,553,961.00	26.59
111	002439	启明星辰	3,534,207.00	26.44
112	600339	中油工程	3,529,619.00	26.41
113	002608	江苏国信	3,528,704.00	26.40
114	300396	迪瑞医疗	3,512,624.73	26.28
115	002600	领益智造	3,511,427.00	26.27
116	688510	航亚科技	3,507,130.48	26.24

117	002409	雅克科技	3,485,720.00	26.08
118	000708	中信特钢	3,480,852.00	26.04
119	601077	渝农商行	3,463,181.00	25.91
120	600970	中材国际	3,423,590.00	25.61
121	600066	宇通客车	3,415,590.00	25.55
122	002867	周大生	3,413,397.00	25.54
123	600109	国金证券	3,376,326.00	25.26
124	688029	南微医学	3,345,945.01	25.03
125	002081	金螳螂	3,318,566.00	24.83
126	600482	中国动力	3,317,690.00	24.82
127	600582	天地科技	3,317,307.00	24.82
128	601699	潞安环能	3,316,532.00	24.81
129	603221	爱丽家居	3,303,130.00	24.71
130	600390	五矿资本	3,296,011.00	24.66
131	688215	瑞晟智能	3,277,121.43	24.52
132	601187	厦门银行	3,239,400.00	24.24
133	688196	卓越新能	3,192,862.97	23.89
134	300558	贝达药业	3,187,241.00	23.85
135	600968	海油发展	3,168,162.00	23.70
136	600008	首创环保	3,160,463.00	23.64
137	300001	特锐德	3,141,322.00	23.50
138	002155	湖南黄金	3,133,964.53	23.45
139	000031	大悦城	3,107,397.00	23.25
140	603596	伯特利	3,105,007.00	23.23
141	603379	三美股份	3,099,798.00	23.19
142	002937	兴瑞科技	3,088,067.00	23.10
143	688009	中国通号	3,081,491.50	23.05
144	600399	抚顺特钢	3,075,191.00	23.01
145	600153	建发股份	3,061,741.00	22.91
146	603580	艾艾精工	3,044,567.00	22.78
147	300724	捷佳伟创	3,039,509.00	22.74
148	002670	国盛金控	3,024,564.00	22.63
149	002444	巨星科技	3,004,024.00	22.47
150	603901	永创智能	2,998,421.00	22.43
151	002153	石基信息	2,970,276.02	22.22
152	600909	华安证券	2,942,512.00	22.01
153	002568	百润股份	2,908,164.60	21.76
154	600737	中粮糖业	2,905,381.00	21.74
155	688219	会通股份	2,896,738.41	21.67
156	688345	博力威	2,894,645.79	21.66
157	600271	航天信息	2,892,779.00	21.64
158	688385	复旦微电	2,883,929.53	21.58
159	600409	三友化工	2,873,287.00	21.50

160	002025	航天电器	2,862,431.00	21.42
161	600623	华谊集团	2,855,472.00	21.36
162	600862	中航高科	2,835,329.00	21.21
163	000937	冀中能源	2,825,582.00	21.14
164	601179	中国西电	2,802,123.00	20.96
165	603898	好莱客	2,787,863.00	20.86
166	600015	华夏银行	2,779,628.00	20.80
167	002032	苏泊尔	2,759,690.00	20.65
168	002531	天顺风能	2,757,676.00	20.63
169	600667	太极实业	2,741,328.00	20.51
170	600765	中航重机	2,712,421.00	20.29
171	300633	开立医疗	2,710,019.00	20.27
172	002128	电投能源	2,709,035.00	20.27
173	000683	远兴能源	2,700,784.00	20.21
174	002791	坚朗五金	2,683,630.00	20.08
175	600350	山东高速	2,679,951.70	20.05
176	000878	云南铜业	2,678,228.00	20.04
177	603876	鼎胜新材	2,677,994.26	20.04
178	600563	法拉电子	2,647,796.00	19.81
179	688312	燕麦科技	2,639,080.35	19.74
180	601800	中国交建	2,624,731.00	19.64
181	002683	广东宏大	2,620,174.00	19.60
182	600845	宝信软件	2,615,183.00	19.57
183	603893	瑞芯微	2,599,089.00	19.44
184	600675	中华企业	2,596,236.00	19.42
185	603613	国联股份	2,576,813.00	19.28
186	601778	晶科科技	2,576,320.00	19.27
187	300058	蓝色光标	2,570,038.00	19.23
188	000027	深圳能源	2,567,888.99	19.21
189	688002	睿创微纳	2,567,265.62	19.21
190	688466	金科环境	2,566,819.28	19.20
191	000048	京基智农	2,566,464.00	19.20
192	600985	淮北矿业	2,530,291.00	18.93
193	603823	百合花	2,519,108.22	18.85
194	002880	卫光生物	2,489,260.50	18.62
195	300144	宋城演艺	2,485,563.00	18.60
196	002625	光启技术	2,484,294.00	18.59
197	688728	格科微	2,479,421.39	18.55
198	300115	长盈精密	2,477,324.00	18.53
199	603093	南华期货	2,472,656.00	18.50
200	603305	旭升集团	2,471,978.00	18.49
201	688210	统联精密	2,456,932.92	18.38
202	300253	卫宁健康	2,449,915.00	18.33

203	600699	均胜电子	2,442,512.00	18.27
204	002203	海亮股份	2,441,121.00	18.26
205	002511	中顺洁柔	2,440,349.00	18.26
206	300251	光线传媒	2,438,782.00	18.25
207	600529	山东药玻	2,405,061.76	17.99
208	603444	吉比特	2,399,733.00	17.95
209	000156	华数传媒	2,397,174.00	17.93
210	600557	康缘药业	2,390,555.00	17.88
211	600161	天坛生物	2,382,580.80	17.83
212	000050	深天马 A	2,378,370.00	17.79
213	688072	拓荆科技	2,370,529.10	17.74
214	688161	威高骨科	2,369,377.38	17.73
215	300866	安克创新	2,360,803.00	17.66
216	300136	信维通信	2,358,777.00	17.65
217	600528	中铁工业	2,351,435.00	17.59
218	603711	香飘飘	2,348,559.00	17.57
219	000778	新兴铸管	2,344,299.00	17.54
220	002745	木林森	2,321,411.00	17.37
221	603256	宏和科技	2,292,395.00	17.15
222	601086	国芳集团	2,290,676.00	17.14
223	600378	昊华科技	2,283,638.08	17.08
224	601288	农业银行	2,277,890.00	17.04
225	600329	达仁堂	2,274,159.00	17.01
226	000636	风华高科	2,271,671.00	17.00
227	688099	晶晨股份	2,268,978.15	16.98
228	688246	嘉和美康	2,260,302.37	16.91
229	600369	西南证券	2,260,250.00	16.91
230	300695	兆丰股份	2,253,252.00	16.86
231	301029	怡合达	2,251,963.88	16.85
232	000785	居然之家	2,245,443.00	16.80
233	002981	朝阳科技	2,235,576.00	16.73
234	300621	维业股份	2,233,493.00	16.71
235	002065	东华软件	2,227,204.00	16.66
236	688571	杭华股份	2,198,232.96	16.45
237	000729	燕京啤酒	2,171,360.00	16.24
238	601567	三星医疗	2,169,062.00	16.23
239	603218	日月股份	2,168,497.00	16.22
240	601997	贵阳银行	2,156,650.00	16.13
241	000963	华东医药	2,149,919.64	16.08
242	688517	金冠电气	2,138,832.62	16.00
243	601298	青岛港	2,138,152.00	16.00
244	300474	景嘉微	2,135,665.00	15.98
245	688060	云涌科技	2,118,295.87	15.85

246	600801	华新水泥	2,117,125.00	15.84
247	002901	大博医疗	2,117,037.00	15.84
248	600487	亨通光电	2,101,964.00	15.73
249	600885	宏发股份	2,081,567.00	15.57
250	600546	山煤国际	2,079,741.00	15.56
251	603515	欧普照明	2,070,984.00	15.49
252	300146	汤臣倍健	2,066,564.00	15.46
253	601969	海南矿业	2,056,359.00	15.38
254	002242	九阳股份	2,044,549.00	15.30
255	603866	桃李面包	2,013,249.00	15.06
256	601456	国联证券	2,010,464.00	15.04
257	600372	中航机载	2,007,878.00	15.02
258	603160	汇顶科技	2,000,969.00	14.97
259	688225	亚信安全	1,998,903.92	14.95
260	688105	诺唯赞	1,997,138.00	14.94
261	600026	中远海能	1,990,742.00	14.89
262	688625	呈和科技	1,987,974.91	14.87
263	600155	华创云信	1,976,712.00	14.79
264	688111	金山办公	1,961,666.20	14.68
265	301015	百洋医药	1,954,405.00	14.62
266	688169	石头科技	1,945,723.33	14.56
267	300168	万达信息	1,939,081.00	14.51
268	688267	中触媒	1,927,006.13	14.42
269	603707	健友股份	1,902,543.00	14.23
270	601058	赛轮轮胎	1,893,025.00	14.16
271	300760	迈瑞医疗	1,890,461.00	14.14
272	300711	广哈通信	1,887,004.00	14.12
273	000537	中绿电	1,881,346.00	14.08
274	603006	黎明股份	1,879,512.00	14.06
275	688036	传音控股	1,878,591.36	14.05
276	300679	电连技术	1,877,245.00	14.04
277	603800	道森股份	1,874,594.00	14.02
278	688621	阳光诺和	1,867,735.12	13.97
279	603456	九洲药业	1,852,774.00	13.86
280	002939	长城证券	1,848,326.00	13.83
281	603000	人民网	1,842,627.00	13.79
282	00700	腾讯控股	1,837,710.86	13.75
283	603556	海兴电力	1,834,905.00	13.73
284	603378	亚士创能	1,832,505.68	13.71
285	603267	鸿远电子	1,828,926.00	13.68
286	688718	唯赛勃	1,823,858.95	13.65
287	603320	迪贝电气	1,821,171.00	13.63
288	688551	科威尔	1,816,200.75	13.59

289	601991	大唐发电	1,802,791.00	13.49
290	688779	长远锂科	1,794,837.10	13.43
291	002430	杭氧股份	1,793,410.00	13.42
292	002905	金逸影视	1,775,573.00	13.28
293	002275	桂林三金	1,761,361.00	13.18
294	688310	迈得医疗	1,745,649.44	13.06
295	688173	希荻微	1,733,347.33	12.97
296	600316	洪都航空	1,711,902.00	12.81
297	600036	招商银行	1,711,566.00	12.81
298	002465	海格通信	1,707,694.00	12.78
299	605577	龙版传媒	1,706,664.00	12.77
300	688082	盛美上海	1,699,071.26	12.71
301	603826	坤彩科技	1,697,861.00	12.70
302	300604	长川科技	1,678,252.00	12.56
303	688198	佰仁医疗	1,678,172.59	12.56
304	601698	中国卫通	1,673,664.00	12.52
305	600085	同仁堂	1,668,321.00	12.48
306	600587	新华医疗	1,660,440.00	12.42
307	301153	中科江南	1,658,878.00	12.41
308	601838	成都银行	1,657,462.00	12.40
309	002389	航天彩虹	1,655,544.00	12.39
310	600536	中国软件	1,649,880.00	12.34
311	688077	大地熊	1,647,329.05	12.32
312	600352	浙江龙盛	1,633,786.00	12.22
313	600061	国投资本	1,617,676.00	12.10
314	300122	智飞生物	1,617,369.00	12.10
315	300788	中信出版	1,607,776.00	12.03
316	300212	易华录	1,598,969.00	11.96
317	600705	中航产融	1,585,018.00	11.86
318	688325	赛微微电	1,582,019.55	11.84
319	300383	光环新网	1,574,832.00	11.78
320	688777	中控技术	1,573,058.92	11.77
321	688281	华秦科技	1,562,022.06	11.69
322	000021	深科技	1,555,697.00	11.64
323	688521	芯原股份	1,553,219.02	11.62
324	000066	中国长城	1,550,121.00	11.60
325	002738	中矿资源	1,526,904.00	11.42
326	000728	国元证券	1,523,320.00	11.40
327	601162	天风证券	1,522,546.00	11.39
328	301239	普瑞眼科	1,515,753.00	11.34
329	000703	恒逸石化	1,510,365.00	11.30
330	688622	禾信仪器	1,509,032.94	11.29
331	688301	奕瑞科技	1,496,077.76	11.19

332	688177	百奥泰	1,493,207.79	11.17
333	600095	湘财股份	1,486,357.00	11.12
334	603568	伟明环保	1,486,145.00	11.12
335	002281	光迅科技	1,474,663.00	11.03
336	603933	睿能科技	1,471,329.40	11.01
337	603661	恒林股份	1,471,279.00	11.01
338	688188	柏楚电子	1,465,806.38	10.97
339	000807	云铝股份	1,461,766.00	10.94
340	688248	南网科技	1,459,382.90	10.92
341	603090	宏盛股份	1,454,449.00	10.88
342	688252	天德钰	1,445,185.42	10.81
343	688682	霍莱沃	1,440,709.46	10.78
344	000415	渤海租赁	1,436,940.00	10.75
345	600353	旭光电子	1,436,110.00	10.74
346	600418	江淮汽车	1,432,040.00	10.71
347	688536	思瑞浦	1,431,133.20	10.71
348	600548	深高速	1,430,137.00	10.70
349	002422	科伦药业	1,422,415.00	10.64
350	688116	天奈科技	1,421,532.69	10.64
351	603217	元利科技	1,419,092.00	10.62
352	300181	佐力药业	1,415,341.00	10.59
353	601319	中国人保	1,410,088.00	10.55
354	002955	鸿合科技	1,405,529.00	10.52
355	688395	正弦电气	1,405,176.13	10.51
356	300296	利亚德	1,403,503.00	10.50
357	601801	皖新传媒	1,401,909.00	10.49
358	000581	威孚高科	1,391,188.00	10.41
359	688616	西力科技	1,380,799.10	10.33
360	002811	郑中设计	1,376,689.00	10.30
361	600500	中化国际	1,374,461.00	10.28
362	001203	大中矿业	1,365,898.00	10.22
363	600928	西安银行	1,359,903.00	10.17
364	002322	理工能科	1,346,716.00	10.08
365	688020	方邦股份	1,342,352.68	10.04
366	688707	振华新材	1,338,681.46	10.02
367	601020	华钰矿业	1,338,044.00	10.01
368	002396	星网锐捷	1,332,106.00	9.97
369	688226	威腾电气	1,327,383.09	9.93
370	000539	粤电力 A	1,325,722.00	9.92
371	603236	移远通信	1,321,725.00	9.89
372	603983	丸美股份	1,308,430.00	9.79
373	300438	鹏辉能源	1,299,495.16	9.72
374	603730	岱美股份	1,292,861.00	9.67

375	000030	富奥股份	1,291,943.00	9.67
376	300759	康龙化成	1,289,032.00	9.64
377	688058	宝兰德	1,287,334.09	9.63
378	002019	亿帆医药	1,284,703.00	9.61
379	603569	长久物流	1,283,692.80	9.60
380	300559	佳发教育	1,283,590.00	9.60
381	600062	华润双鹤	1,278,681.00	9.57
382	688118	普元信息	1,272,922.66	9.52
383	300927	江天化学	1,263,618.00	9.45
384	600897	厦门空港	1,263,531.20	9.45
385	600583	海油工程	1,259,609.00	9.42
386	300286	安科瑞	1,257,207.00	9.41
387	600998	九州通	1,256,197.00	9.40
388	002890	弘宇股份	1,255,909.00	9.40
389	601577	长沙银行	1,255,621.00	9.39
390	601992	金隅集团	1,253,831.00	9.38
391	000563	陕国投 A	1,244,125.00	9.31
392	600572	康恩贝	1,235,071.00	9.24
393	002557	洽洽食品	1,233,959.00	9.23
394	000999	华润三九	1,230,734.00	9.21
395	600060	海信视像	1,229,088.00	9.20
396	603885	吉祥航空	1,226,309.00	9.17
397	688566	吉贝尔	1,218,530.99	9.12
398	301026	浩通科技	1,217,909.00	9.11
399	600348	华阳股份	1,217,834.00	9.11
400	601666	平煤股份	1,217,149.00	9.11
401	002756	永兴材料	1,211,442.00	9.06
402	002963	豪尔赛	1,211,385.00	9.06
403	002152	广电运通	1,204,730.00	9.01
404	603719	良品铺子	1,199,339.00	8.97
405	600481	双良节能	1,197,314.00	8.96
406	688360	德马科技	1,196,137.45	8.95
407	002156	通富微电	1,195,636.00	8.95
408	300965	恒宇信通	1,190,486.00	8.91
409	600673	东阳光	1,187,282.00	8.88
410	002395	双象股份	1,179,316.00	8.82
411	300554	三超新材	1,177,472.00	8.81
412	601881	中国银河	1,163,037.00	8.70
413	603551	奥普家居	1,157,553.36	8.66
414	002294	信立泰	1,147,728.00	8.59
415	002541	鸿路钢构	1,140,313.00	8.53
416	300870	欧陆通	1,138,782.00	8.52
417	688021	奥福环保	1,136,098.75	8.50

418	002850	科达利	1,135,846.00	8.50
419	000617	中油资本	1,133,831.00	8.48
420	688448	磁谷科技	1,132,904.65	8.48
421	688247	宣泰医药	1,129,775.50	8.45
422	688127	蓝特光学	1,128,249.92	8.44
423	002690	美亚光电	1,113,367.00	8.33
424	600435	北方导航	1,111,190.00	8.31
425	688185	康希诺	1,110,336.84	8.31
426	688227	品高股份	1,108,037.95	8.29
427	601100	恒立液压	1,105,761.00	8.27
428	688190	云路股份	1,105,605.21	8.27
429	688109	品茗科技	1,099,971.51	8.23
430	601828	美凯龙	1,094,768.00	8.19
431	603699	纽威股份	1,094,173.00	8.19
432	688425	铁建重工	1,093,854.09	8.18
433	603958	哈森股份	1,093,766.00	8.18
434	688236	春立医疗	1,089,829.33	8.15
435	688357	建龙微纳	1,084,601.16	8.11
436	603895	天永智能	1,083,106.00	8.10
437	603499	翔港科技	1,082,623.00	8.10
438	002436	兴森科技	1,080,978.00	8.09
439	603311	金海高科	1,080,754.00	8.09
440	002429	兆驰股份	1,079,791.00	8.08
441	603676	卫信康	1,077,734.00	8.06
442	688231	隆达股份	1,075,947.42	8.05
443	605158	华达新材	1,074,991.34	8.04
444	688052	纳芯微	1,073,991.07	8.04
445	688420	美腾科技	1,070,299.76	8.01
446	002558	巨人网络	1,067,716.00	7.99
447	600301	华锡有色	1,065,774.00	7.97
448	688302	海创药业	1,063,377.71	7.96
449	300689	澄天伟业	1,051,291.90	7.87
450	603112	华翔股份	1,044,808.00	7.82
451	000930	中粮科技	1,042,479.00	7.80
452	001979	招商蛇口	1,036,122.00	7.75
453	688081	兴图新科	1,033,058.57	7.73
454	000603	盛达资源	1,027,121.00	7.68
455	300515	三德科技	1,026,407.00	7.68
456	688097	博众精工	1,022,114.99	7.65
457	688066	航天宏图	1,019,474.88	7.63
458	300832	新产业	1,017,066.14	7.61
459	002674	兴业科技	1,009,058.00	7.55
460	688655	迅捷兴	1,008,864.60	7.55

461	688579	山大地纬	995,838.22	7.45
462	688101	三达膜	993,947.80	7.44
463	688767	博拓生物	992,524.80	7.43
464	603868	飞科电器	987,953.00	7.39
465	688030	山石网科	981,474.91	7.34
466	300699	光威复材	980,078.00	7.33
467	600215	派斯林	977,408.00	7.31
468	603915	国茂股份	975,780.00	7.30
469	002637	赞宇科技	973,832.00	7.29
470	688778	厦钨新能	972,758.72	7.28
471	002416	爱施德	968,769.61	7.25
472	002782	可立克	965,242.00	7.22
473	601566	九牧王	964,104.00	7.21
474	002946	新乳业	963,210.00	7.21
475	000032	深桑达 A	953,894.00	7.14
476	601898	中煤能源	948,678.00	7.10
477	600376	首开股份	945,530.00	7.07
478	300822	贝仕达克	940,705.00	7.04
479	688092	爱科科技	935,987.78	7.00
480	688398	赛特新材	921,321.73	6.89
481	601001	晋控煤业	919,437.00	6.88
482	300445	康斯特	917,478.00	6.86
483	601872	招商轮船	911,603.80	6.82
484	301070	开勒股份	911,128.00	6.82
485	603897	长城科技	910,008.00	6.81
486	301051	信濠光电	909,404.00	6.80
487	300886	华业香料	908,448.00	6.80
488	300684	中石科技	905,260.00	6.77
489	688697	纽威数控	901,489.07	6.74
490	002266	浙富控股	896,968.00	6.71
491	603587	地素时尚	893,563.00	6.69
492	600511	国药股份	891,976.00	6.67
493	601228	广州港	889,351.00	6.65
494	603277	银都股份	888,370.00	6.65
495	688670	金迪克	887,705.23	6.64
496	002142	宁波银行	884,057.00	6.61
497	301180	万祥科技	882,787.00	6.60
498	600315	上海家化	876,208.00	6.56
499	600961	株冶集团	871,966.00	6.52
500	601137	博威合金	868,336.00	6.50
501	002415	海康威视	852,612.00	6.38
502	603606	东方电缆	852,139.00	6.38
503	002434	万里扬	849,380.00	6.35

504	601138	工业富联	849,241.00	6.35
505	002487	大金重工	846,690.00	6.33
506	603928	兴业股份	841,255.00	6.29
507	301236	软通动力	837,390.00	6.26
508	300851	交大思诺	832,624.00	6.23
509	002408	齐翔腾达	831,480.00	6.22
510	000933	神火股份	831,368.00	6.22
511	300274	阳光电源	828,424.00	6.20
512	000831	中国稀土	827,197.00	6.19
513	002056	横店东磁	826,914.00	6.19
514	600988	赤峰黄金	821,061.00	6.14
515	600746	江苏索普	820,413.00	6.14
516	002508	老板电器	819,239.00	6.13
517	002096	易普力	814,036.00	6.09
518	688003	天准科技	813,493.21	6.09
519	300972	万辰集团	812,209.00	6.08
520	002866	传艺科技	810,919.80	6.07
521	300395	菲利华	808,924.00	6.05
522	600170	上海建工	808,099.00	6.05
523	688015	交控科技	804,572.02	6.02
524	605151	西上海	800,335.00	5.99
525	600588	用友网络	797,851.00	5.97
526	000738	航发控制	797,339.00	5.97
527	688229	博睿数据	792,248.88	5.93
528	300717	华信新材	791,649.00	5.92
529	603889	新澳股份	791,578.00	5.92
530	601689	拓普集团	789,804.00	5.91
531	600475	华光环能	782,721.00	5.86
532	603609	禾丰股份	782,152.00	5.85
533	603081	大丰实业	776,705.00	5.81
534	601106	中国一重	776,062.00	5.81
535	601019	山东出版	775,279.00	5.80
536	688063	派能科技	774,482.80	5.79
537	601717	郑煤机	773,654.00	5.79
538	603199	九华旅游	772,499.00	5.78
539	600986	浙文互联	766,859.00	5.74
540	688139	海尔生物	764,094.41	5.72
541	603790	雅运股份	762,748.00	5.71
542	601608	中信重工	758,055.46	5.67
543	600486	扬农化工	755,732.00	5.65
544	603178	圣龙股份	749,606.00	5.61
545	000951	中国重汽	749,047.00	5.60
546	605218	伟时电子	746,601.00	5.59

547	000400	许继电气	742,565.00	5.56
548	603879	永悦科技	739,896.50	5.54
549	600197	伊力特	737,369.00	5.52
550	000950	重药控股	734,040.00	5.49
551	688013	天臣医疗	731,751.17	5.47
552	002645	华宏科技	731,517.00	5.47
553	688569	铁科轨道	724,985.16	5.42
554	600507	方大特钢	724,471.00	5.42
555	688676	金盘科技	722,463.30	5.41
556	300017	网宿科技	722,399.00	5.40
557	002500	山西证券	721,478.00	5.40
558	002338	奥普光电	719,148.36	5.38
559	301076	新瀚新材	716,835.00	5.36
560	600266	城建发展	713,127.00	5.34
561	605123	派克新材	712,773.00	5.33
562	688314	康拓医疗	711,475.20	5.32
563	300881	盛德鑫泰	704,345.00	5.27
564	300750	宁德时代	702,661.00	5.26
565	300390	天华新能	702,138.40	5.25
566	000062	深圳华强	697,358.05	5.22
567	000883	湖北能源	693,763.00	5.19
568	688055	龙腾光电	693,496.31	5.19
569	603605	珀莱雅	691,932.00	5.18
570	688197	首药控股	686,136.84	5.13
571	002865	钧达股份	685,683.00	5.13
572	688358	祥生医疗	680,631.37	5.09
573	688191	智洋创新	680,418.26	5.09
574	600820	隧道股份	680,195.00	5.09
575	688292	浩瀚深度	679,400.63	5.08
576	300492	华图山鼎	675,162.00	5.05
577	300618	寒锐钴业	672,013.00	5.03
578	300705	九典制药	668,927.00	5.00
579	300800	力合科技	666,262.00	4.98
580	603787	新日股份	663,922.00	4.97
581	002044	美年健康	663,717.00	4.97
582	688232	新点软件	662,861.60	4.96
583	300980	祥源新材	661,786.00	4.95
584	002790	瑞尔特	661,276.00	4.95
585	002572	索菲亚	660,109.00	4.94
586	689009	九号公司	660,026.49	4.94
587	002223	鱼跃医疗	657,088.00	4.92
588	601169	北京银行	656,542.00	4.91
589	601107	四川成渝	652,535.00	4.88

590	688186	广大特材	641,375.87	4.80
591	603535	嘉诚国际	639,837.00	4.79
592	000887	中鼎股份	638,933.00	4.78
593	600223	福瑞达	638,424.00	4.78
594	000938	紫光股份	636,901.00	4.76
595	000429	粤高速 A	633,312.00	4.74
596	300850	新强联	633,036.00	4.74
597	603055	台华新材	632,590.00	4.73
598	603192	汇得科技	625,614.00	4.68
599	688581	安杰思	619,191.88	4.63
600	600826	兰生股份	618,410.00	4.63
601	300502	新易盛	618,272.00	4.63
602	600895	张江高科	616,371.00	4.61
603	600839	四川长虹	615,940.00	4.61
604	603127	昭衍新药	612,413.00	4.58
605	002988	豪美新材	609,431.00	4.56
606	000089	深圳机场	608,964.00	4.56
607	605598	上海港湾	608,523.00	4.55
608	000629	钒钛股份	608,062.00	4.55
609	688155	先惠技术	604,558.01	4.52
610	603197	保隆科技	601,961.00	4.50
611	603099	长白山	598,618.00	4.48
612	300394	天孚通信	598,044.00	4.47
613	300795	米奥会展	592,252.00	4.43
614	600416	湘电股份	590,606.00	4.42
615	688665	四方光电	586,895.52	4.39
616	002497	雅化集团	584,910.00	4.38
617	603489	八方股份	577,898.00	4.32
618	003031	中瓷电子	574,949.00	4.30
619	688050	爱博医疗	571,841.22	4.28
620	000800	一汽解放	569,651.00	4.26
621	603185	弘元绿能	567,334.00	4.24
622	601233	桐昆股份	567,043.00	4.24
623	300114	中航电测	564,736.00	4.23
624	300765	新诺威	560,059.00	4.19
625	603345	安井食品	558,373.00	4.18
626	688222	成都先导	557,889.35	4.17
627	002912	中新赛克	557,354.00	4.17
628	688567	孚能科技	556,621.94	4.16
629	688088	虹软科技	554,140.37	4.15
630	002466	天齐锂业	552,190.00	4.13
631	300257	开山股份	551,812.00	4.13
632	688012	中微公司	550,438.01	4.12

633	002577	雷柏科技	547,496.00	4.10
634	601900	南方传媒	547,098.00	4.09
635	601998	中信银行	546,493.00	4.09
636	000012	南玻 A	544,980.00	4.08
637	688106	金宏气体	542,969.36	4.06
638	688580	伟思医疗	539,491.95	4.04
639	688053	思科瑞	531,875.47	3.98
640	601601	中国太保	530,048.00	3.97
641	000403	派林生物	524,583.95	3.92
642	600809	山西汾酒	524,124.00	3.92
643	002324	普利特	521,543.00	3.90
644	601658	邮储银行	513,000.00	3.84
645	300884	狄耐克	511,045.00	3.82
646	300155	安居宝	509,657.00	3.81
647	601066	中信建投	506,080.00	3.79
648	300580	贝斯特	505,571.00	3.78
649	000028	国药一致	501,058.00	3.75
650	688100	威胜信息	501,055.51	3.75
651	300926	博俊科技	500,070.00	3.74
652	603948	建业股份	498,252.00	3.73
653	300428	立中集团	496,827.00	3.72
654	002320	海峡股份	496,621.00	3.72
655	002678	珠江钢琴	495,879.00	3.71
656	688150	莱特光电	494,594.61	3.70
657	688323	瑞华泰	492,254.01	3.68
658	603567	珍宝岛	492,146.00	3.68
659	688061	灿瑞科技	491,156.17	3.67
660	601636	旗滨集团	490,336.00	3.67
661	601225	陕西煤业	485,788.00	3.63
662	002131	利欧股份	483,905.00	3.62
663	603032	德新科技	480,485.00	3.59
664	601665	齐鲁银行	479,880.00	3.59
665	002468	申通快递	478,825.00	3.58
666	600941	中国移动	477,300.00	3.57
667	603530	神马电力	476,887.00	3.57
668	603877	太平鸟	474,967.00	3.55
669	002916	深南电路	474,700.00	3.55
670	600497	驰宏锌锗	474,199.00	3.55
671	300905	宝丽迪	474,109.00	3.55
672	300068	南都电源	466,108.00	3.49
673	003006	百亚股份	462,490.00	3.46
674	002428	云南锗业	457,285.00	3.42
675	600325	华发股份	456,716.00	3.42

676	300226	上海钢联	456,301.00	3.41
677	688258	卓易信息	445,987.40	3.34
678	002755	奥赛康	445,360.08	3.33
679	300314	戴维医疗	441,986.00	3.31
680	600118	中国卫星	441,363.00	3.30
681	605178	时空科技	440,412.80	3.29
682	002885	京泉华	438,801.00	3.28
683	002634	棒杰股份	438,198.00	3.28
684	002017	东信和平	438,085.00	3.28
685	000063	中兴通讯	437,358.00	3.27
686	001207	联科科技	435,268.00	3.26
687	002268	电科网安	432,998.00	3.24
688	300092	科新机电	432,388.00	3.23
689	301309	万得凯	430,447.00	3.22
690	002050	三花智控	429,110.00	3.21
691	002942	新农股份	428,077.00	3.20
692	605058	澳弘电子	427,386.00	3.20
693	688087	英科再生	426,966.45	3.19
694	603363	傲农生物	425,575.00	3.18
695	688233	神工股份	424,073.68	3.17
696	300511	雪榕生物	423,372.00	3.17
697	688596	正帆科技	423,240.08	3.17
698	688076	诺泰生物	420,646.65	3.15
699	603037	凯众股份	420,496.00	3.15
700	603657	春光科技	419,579.00	3.14
701	603706	东方环宇	417,176.00	3.12
702	002068	黑猫股份	414,183.00	3.10
703	600633	浙数文化	412,934.00	3.09
704	001288	运机集团	412,325.00	3.08
705	001313	粤海饲料	411,756.00	3.08
706	301227	森鹰窗业	411,491.00	3.08
707	605189	富春染织	411,431.00	3.08
708	605580	恒盛能源	411,366.66	3.08
709	603816	顾家家居	410,981.00	3.07
710	605086	龙高股份	410,774.00	3.07
711	688368	晶丰明源	409,703.20	3.07
712	003008	开普检测	408,025.00	3.05
713	002318	久立特材	406,919.00	3.04
714	601702	华峰铝业	405,541.00	3.03
715	688520	神州细胞	404,869.10	3.03
716	003041	真爱美家	404,778.60	3.03
717	301039	中集车辆	403,495.00	3.02
718	688798	艾为电子	403,404.82	3.02

719	002544	普天科技	402,708.00	3.01
720	002066	瑞泰科技	400,412.00	3.00
721	603992	松霖科技	400,118.00	2.99
722	300321	同大股份	399,315.00	2.99
723	300031	宝通科技	399,293.00	2.99
724	601326	秦港股份	399,065.00	2.99
725	688217	睿昂基因	398,590.28	2.98
726	300697	电工合金	394,299.00	2.95
727	300337	银邦股份	393,758.00	2.95
728	300452	山河药辅	393,185.00	2.94
729	688200	华峰测控	391,516.07	2.93
730	600665	天地源	391,324.00	2.93
731	603505	金石资源	391,262.00	2.93
732	603323	苏农银行	390,595.00	2.92
733	002472	双环传动	390,455.00	2.92
734	600011	华能国际	390,309.00	2.92
735	600089	特变电工	390,203.00	2.92
736	002807	江阴银行	388,342.00	2.91
737	603516	淳中科技	388,330.00	2.91
738	600012	皖通高速	387,988.00	2.90
739	001914	招商积余	386,343.00	2.89
740	002968	新大正	385,693.00	2.89
741	688300	联瑞新材	384,111.14	2.87
742	300218	安利股份	381,940.00	2.86
743	002949	华阳国际	381,665.00	2.86
744	688347	华虹公司	380,484.00	2.85
745	000425	徐工机械	380,097.00	2.84
746	688166	博瑞医药	379,573.90	2.84
747	688377	迪威尔	378,929.68	2.83
748	603208	江山欧派	378,863.00	2.83
749	601012	隆基绿能	378,537.00	2.83
750	300638	广和通	376,795.00	2.82
751	300455	航天智装	376,205.00	2.81
752	301068	大地海洋	374,810.00	2.80
753	002906	华阳集团	374,607.00	2.80
754	600917	重庆燃气	373,381.00	2.79
755	688230	芯导科技	368,135.40	2.75
756	688819	天能股份	367,336.34	2.75
757	002254	泰和新材	364,912.00	2.73
758	600703	三安光电	364,700.00	2.73
759	301042	安联锐视	362,802.00	2.71
760	001286	陕西能源	361,603.20	2.71
761	600016	民生银行	361,540.00	2.70

762	603767	中马传动	360,408.00	2.70
763	002915	中欣氟材	358,166.60	2.68
764	600295	鄂尔多斯	357,358.00	2.67
765	688220	翱捷科技	356,901.30	2.67
766	688468	科美诊断	355,702.42	2.66
767	688350	富淼科技	355,291.18	2.66
768	000977	浪潮信息	354,894.00	2.66
769	603658	安图生物	353,411.00	2.64
770	300360	炬华科技	351,323.00	2.63
771	688259	创耀科技	350,046.67	2.62
772	688590	新致软件	349,249.72	2.61
773	601198	东兴证券	348,699.00	2.61
774	688165	埃夫特	347,444.45	2.60
775	603993	洛阳钼业	347,365.00	2.60
776	601000	唐山港	346,948.00	2.60
777	000783	长江证券	346,355.00	2.59
778	603508	思维列控	345,809.00	2.59
779	603466	风语筑	340,907.00	2.55
780	002958	青农商行	340,753.00	2.55
781	605005	合兴股份	338,775.00	2.53
782	605162	新中港	336,148.00	2.51
783	603880	ST 南卫	335,916.00	2.51
784	605118	力鼎光电	334,427.00	2.50
785	605255	天普股份	333,211.00	2.49
786	688786	悦安新材	332,921.07	2.49
787	605300	佳禾食品	332,723.00	2.49
788	605588	冠石科技	331,916.00	2.48
789	001211	双枪科技	331,428.00	2.48
790	605028	世茂能源	331,080.00	2.48
791	605169	洪通燃气	330,518.00	2.47
792	603976	正川股份	329,782.00	2.47
793	605488	福莱新材	329,223.35	2.46
794	603238	诺邦股份	329,008.00	2.46
795	603813	原尚股份	328,997.00	2.46
796	300594	朗进科技	328,979.00	2.46
797	603038	华立股份	328,095.00	2.45
798	605566	福莱茵特	326,618.00	2.44
799	603353	和顺石油	326,468.00	2.44
800	605318	法狮龙	326,276.00	2.44
801	688696	极米科技	325,316.76	2.43
802	603297	永新光学	325,307.00	2.43
803	605179	一鸣食品	324,718.00	2.43
804	003018	金富科技	324,150.00	2.43

805	600977	中国电影	323,949.00	2.42
806	605228	神通科技	323,184.00	2.42
807	605155	西大门	322,896.00	2.42
808	300054	鼎龙股份	320,747.00	2.40
809	600148	长春一东	320,533.00	2.40
810	605099	共创草坪	319,347.00	2.39
811	002966	苏州银行	318,618.00	2.38
812	000534	万泽股份	318,181.00	2.38
813	688260	昀冢科技	316,452.31	2.37
814	605500	森林包装	316,436.00	2.37
815	301121	紫建电子	316,328.00	2.37
816	688295	中复神鹰	313,225.60	2.34
817	688501	青达环保	313,007.45	2.34
818	300977	深圳瑞捷	311,974.00	2.33
819	301045	天禄科技	310,527.00	2.32
820	603511	爱慕股份	308,565.00	2.31
821	300211	亿通科技	308,374.00	2.31
822	001308	康冠科技	308,032.00	2.30
823	603969	银龙股份	307,665.00	2.30
824	603728	鸣志电器	304,992.00	2.28
825	603216	梦天家居	304,938.00	2.28
826	001229	魅视科技	304,144.00	2.28
827	600657	信达地产	302,692.00	2.26
828	688084	晶品特装	302,228.36	2.26
829	000906	浙商中拓	302,211.00	2.26
830	603960	克来机电	300,824.00	2.25
831	688382	益方生物	299,153.09	2.24
832	603212	赛伍技术	298,512.00	2.23
833	688400	凌云光	294,248.43	2.20
834	688617	惠泰医疗	293,216.00	2.19
835	688680	海优新材	287,126.45	2.15
836	300423	昇辉科技	286,774.00	2.15
837	601858	中国科传	286,579.00	2.14
838	688717	艾罗能源	285,925.42	2.14
839	600521	华海药业	285,030.00	2.13
840	600132	重庆啤酒	282,478.00	2.11
841	002387	维信诺	281,588.00	2.11
842	300285	国瓷材料	280,622.00	2.10
843	002897	意华股份	280,173.00	2.10
844	002673	西部证券	279,676.00	2.09
845	300915	海融科技	278,737.00	2.09
846	300908	仲景食品	276,694.00	2.07
847	688981	中芯国际	276,005.63	2.06

848	603685	晨丰科技	275,323.00	2.06
849	300953	震裕科技	274,672.00	2.05
850	000034	神州数码	273,817.00	2.05
851	002891	中宠股份	271,805.00	2.03
852	600755	厦门国贸	268,475.00	2.01
853	600028	中国石化	267,882.00	2.00
854	002907	华森制药	267,830.00	2.00

注：上述买入金额为买入成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	9,486,608.30	70.97
2	603228	景旺电子	8,099,085.00	60.59
3	600871	石化油服	7,378,393.00	55.20
4	600131	国网信通	7,341,516.00	54.93
5	603259	药明康德	7,230,261.44	54.09
6	603355	莱克电气	6,755,816.00	50.54
7	601928	凤凰传媒	6,436,579.00	48.16
8	601598	中国外运	5,983,704.00	44.77
9	603737	三棵树	5,757,204.20	43.07
10	002262	恩华药业	5,682,165.00	42.51
11	000630	铜陵有色	5,639,789.00	42.19
12	601555	东吴证券	5,629,645.00	42.12
13	600373	中文传媒	5,586,725.00	41.80
14	300896	爱美客	5,583,355.00	41.77
15	600276	恒瑞医药	5,545,345.00	41.49
16	000423	东阿阿胶	5,535,853.00	41.42
17	601869	长飞光纤	5,476,534.00	40.97
18	002192	融捷股份	5,329,742.00	39.87
19	000997	新大陆	5,291,251.00	39.59
20	002273	水晶光电	5,284,029.00	39.53
21	600655	豫园股份	5,225,026.48	39.09
22	603225	新凤鸣	5,124,743.00	38.34
23	600901	江苏金租	5,070,440.00	37.93
24	601139	深圳燃气	5,061,889.00	37.87
25	300015	爱尔眼科	5,024,920.30	37.59
26	600129	太极集团	4,998,412.00	37.40
27	002373	千方科技	4,982,014.00	37.27
28	300741	华宝股份	4,957,637.00	37.09
29	000739	普洛药业	4,931,939.00	36.90
30	600398	海澜之家	4,852,213.00	36.30
31	601231	环旭电子	4,848,652.98	36.28

32	002384	东山精密	4,845,411.00	36.25
33	601336	新华保险	4,833,586.54	36.16
34	688006	杭可科技	4,771,967.47	35.70
35	002926	华西证券	4,684,088.00	35.04
36	002244	滨江集团	4,612,350.00	34.51
37	002299	圣农发展	4,601,300.00	34.42
38	600079	人福医药	4,527,681.00	33.87
39	002563	森马服饰	4,522,659.00	33.84
40	000513	丽珠集团	4,511,998.00	33.76
41	000988	华工科技	4,485,405.58	33.56
42	603056	德邦股份	4,441,389.00	33.23
43	600498	烽火通信	4,370,227.00	32.70
44	601098	中南传媒	4,331,084.00	32.40
45	002518	科士达	4,325,005.12	32.36
46	600167	联美控股	4,233,837.00	31.68
47	002925	盈趣科技	4,233,443.99	31.67
48	000987	越秀资本	4,222,246.00	31.59
49	600027	华电国际	4,214,614.96	31.53
50	600566	济川药业	4,206,519.00	31.47
51	600489	中金黄金	4,162,834.00	31.14
52	002080	中材科技	4,099,858.00	30.67
53	688256	寒武纪	4,066,898.78	30.43
54	688772	珠海冠宇	4,065,926.33	30.42
55	002739	万达电影	4,049,779.00	30.30
56	000898	鞍钢股份	4,018,077.00	30.06
57	601966	玲珑轮胎	3,985,832.00	29.82
58	002938	鹏鼎控股	3,978,258.00	29.76
59	603712	七一二	3,945,391.00	29.52
60	600707	彩虹股份	3,940,354.66	29.48
61	600160	巨化股份	3,932,586.00	29.42
62	603688	石英股份	3,912,227.00	29.27
63	000975	银泰黄金	3,899,876.00	29.18
64	300418	昆仑万维	3,885,599.59	29.07
65	688273	麦澜德	3,881,659.51	29.04
66	600663	陆家嘴	3,879,347.63	29.02
67	002463	沪电股份	3,862,433.00	28.90
68	002372	伟星新材	3,826,883.30	28.63
69	000869	张裕 A	3,800,695.00	28.43
70	002368	太极股份	3,773,494.00	28.23
71	600535	天士力	3,739,748.84	27.98
72	603638	艾迪精密	3,674,363.00	27.49
73	603338	浙江鼎力	3,649,202.00	27.30
74	603927	中科软	3,611,961.80	27.02

75	002409	雅克科技	3,579,796.00	26.78
76	002138	顺络电子	3,569,374.83	26.70
77	000553	安道麦 A	3,562,212.00	26.65
78	002532	天山铝业	3,542,332.00	26.50
79	688029	南微医学	3,540,673.95	26.49
80	000960	锡业股份	3,502,765.00	26.21
81	601958	金钼股份	3,492,225.00	26.13
82	603317	天味食品	3,461,945.72	25.90
83	600764	中国海防	3,408,499.00	25.50
84	000776	广发证券	3,404,750.00	25.47
85	300396	迪瑞医疗	3,402,928.80	25.46
86	600970	中材国际	3,396,710.00	25.41
87	688215	瑞晟智能	3,393,205.93	25.39
88	000967	盈峰环境	3,344,567.00	25.02
89	600038	中直股份	3,332,838.24	24.93
90	601003	柳钢股份	3,325,251.00	24.88
91	600968	海油发展	3,324,760.00	24.87
92	002439	启明星辰	3,323,311.00	24.86
93	688196	卓越新能	3,314,361.47	24.80
94	600109	国金证券	3,312,269.00	24.78
95	300558	贝达药业	3,311,598.00	24.78
96	688510	航亚科技	3,286,755.72	24.59
97	601187	厦门银行	3,260,787.00	24.40
98	002423	中粮资本	3,221,016.00	24.10
99	601077	渝农商行	3,192,645.00	23.89
100	002081	金螳螂	3,164,661.00	23.68
101	688208	道通科技	3,148,281.83	23.55
102	600008	首创环保	3,142,268.00	23.51
103	300724	捷佳伟创	3,132,090.00	23.43
104	603650	彤程新材	3,128,940.00	23.41
105	002250	联化科技	3,122,896.00	23.36
106	600399	抚顺特钢	3,121,042.00	23.35
107	601699	潞安环能	3,114,296.00	23.30
108	002670	国盛金控	3,098,687.00	23.18
109	688390	固德威	3,093,661.57	23.15
110	000708	中信特钢	3,088,525.00	23.11
111	603580	艾艾精工	3,078,390.00	23.03
112	002155	湖南黄金	3,063,297.21	22.92
113	002937	兴瑞科技	3,007,993.00	22.50
114	000031	大悦城	2,983,836.00	22.32
115	688385	复旦微电	2,973,643.42	22.25
116	600927	永安期货	2,924,609.00	21.88
117	688219	会通股份	2,923,867.52	21.87

118	600390	五矿资本	2,895,996.00	21.67
119	600623	华谊集团	2,886,033.00	21.59
120	002568	百润股份	2,802,757.00	20.97
121	603379	三美股份	2,787,198.00	20.85
122	603901	永创智能	2,784,694.00	20.83
123	688345	博力威	2,782,316.14	20.82
124	300682	朗新集团	2,781,455.00	20.81
125	603786	科博达	2,772,947.00	20.75
126	600845	宝信软件	2,771,245.60	20.73
127	300115	长盈精密	2,763,707.00	20.68
128	603596	伯特利	2,751,563.00	20.59
129	600909	华安证券	2,728,684.00	20.41
130	600299	安迪苏	2,727,924.00	20.41
131	601611	中国核建	2,726,136.00	20.40
132	002128	电投能源	2,715,720.00	20.32
133	600409	三友化工	2,711,358.00	20.28
134	600582	天地科技	2,701,407.00	20.21
135	600637	东方明珠	2,685,002.00	20.09
136	300633	开立医疗	2,675,748.00	20.02
137	600517	国网英大	2,669,529.00	19.97
138	000878	云南铜业	2,651,946.00	19.84
139	600667	太极实业	2,651,827.00	19.84
140	002867	周大生	2,648,504.00	19.81
141	002032	苏泊尔	2,640,691.00	19.76
142	002531	天顺风能	2,632,170.00	19.69
143	600557	康缘药业	2,624,064.81	19.63
144	600015	华夏银行	2,611,239.00	19.54
145	000027	深圳能源	2,608,982.60	19.52
146	601800	中国交建	2,607,871.00	19.51
147	688312	燕麦科技	2,593,540.75	19.40
148	600339	中油工程	2,580,570.00	19.31
149	688210	统联精密	2,578,595.70	19.29
150	603256	宏和科技	2,573,484.00	19.25
151	603933	睿能科技	2,571,723.68	19.24
152	000937	冀中能源	2,564,630.00	19.19
153	002880	卫光生物	2,562,544.80	19.17
154	600862	中航高科	2,560,367.00	19.16
155	002153	石基信息	2,547,669.50	19.06
156	002791	坚朗五金	2,546,028.00	19.05
157	603898	好莱客	2,536,851.00	18.98
158	002625	光启技术	2,532,075.00	18.94
159	601179	中国西电	2,518,777.00	18.84
160	601086	国芳集团	2,503,936.00	18.73

161	603876	鼎胜新材	2,502,033.00	18.72
162	601778	晶科科技	2,486,209.00	18.60
163	603221	爱丽家居	2,471,741.95	18.49
164	603711	香飘飘	2,443,651.00	18.28
165	600563	法拉电子	2,436,245.68	18.23
166	688009	中国通号	2,434,545.23	18.21
167	603613	国联股份	2,425,622.00	18.15
168	688002	睿创微纳	2,407,787.07	18.01
169	600415	小商品城	2,399,778.00	17.95
170	600271	航天信息	2,380,910.00	17.81
171	300058	蓝色光标	2,354,692.00	17.62
172	002444	巨星科技	2,346,554.00	17.56
173	002203	海亮股份	2,340,406.00	17.51
174	000778	新兴铸管	2,331,098.00	17.44
175	600529	山东药玻	2,329,623.00	17.43
176	600699	均胜电子	2,326,472.00	17.41
177	688161	威高骨科	2,324,920.16	17.39
178	002511	中顺洁柔	2,324,579.00	17.39
179	002683	广东宏大	2,321,380.00	17.37
180	600528	中铁工业	2,320,088.00	17.36
181	688517	金冠电气	2,314,525.81	17.32
182	002981	朝阳科技	2,311,181.00	17.29
183	688099	晶晨股份	2,303,724.84	17.24
184	300001	特锐德	2,288,287.00	17.12
185	002065	东华软件	2,272,898.00	17.00
186	300866	安克创新	2,263,175.00	16.93
187	603444	吉比特	2,259,432.00	16.90
188	601456	国联证券	2,244,568.00	16.79
189	600967	内蒙一机	2,236,552.00	16.73
190	601567	三星医疗	2,233,829.00	16.71
191	300621	维业股份	2,231,241.00	16.69
192	000683	远兴能源	2,228,326.00	16.67
193	002901	大博医疗	2,224,136.00	16.64
194	000959	首钢股份	2,192,776.00	16.41
195	600487	亨通光电	2,181,707.00	16.32
196	603707	健友股份	2,179,506.00	16.31
197	688246	嘉和美康	2,171,948.14	16.25
198	603305	旭升集团	2,167,691.00	16.22
199	002745	木林森	2,153,938.00	16.11
200	600378	昊华科技	2,153,320.84	16.11
201	000048	京基智农	2,150,026.00	16.09
202	300168	万达信息	2,131,165.00	15.94
203	601298	青岛港	2,120,400.00	15.86

204	603823	百合花	2,118,367.70	15.85
205	600066	宇通客车	2,117,457.00	15.84
206	603515	欧普照明	2,108,778.93	15.78
207	002905	金逸影视	2,102,920.00	15.73
208	688571	杭华股份	2,095,963.22	15.68
209	601288	农业银行	2,087,302.00	15.62
210	601997	贵阳银行	2,082,642.00	15.58
211	601168	西部矿业	2,064,304.00	15.44
212	688225	亚信安全	2,044,573.78	15.30
213	600155	华创云信	2,030,129.00	15.19
214	601969	海南矿业	2,010,151.00	15.04
215	688267	中触媒	2,009,294.01	15.03
216	688276	百克生物	2,009,026.99	15.03
217	300144	宋城演艺	1,987,639.48	14.87
218	300474	景嘉微	1,981,457.00	14.82
219	688111	金山办公	1,965,526.32	14.71
220	603556	海兴电力	1,964,209.00	14.70
221	603456	九洲药业	1,963,364.00	14.69
222	00700	腾讯控股	1,958,079.31	14.65
223	688625	呈和科技	1,953,963.81	14.62
224	301029	怡合达	1,946,572.00	14.56
225	601058	赛轮轮胎	1,941,153.00	14.52
226	688060	云涌科技	1,939,324.19	14.51
227	600985	淮北矿业	1,937,913.00	14.50
228	300788	中信出版	1,929,333.00	14.43
229	300253	卫宁健康	1,920,570.00	14.37
230	600329	达仁堂	1,914,411.00	14.32
231	603093	南华期货	1,895,513.00	14.18
232	300711	广哈通信	1,889,634.00	14.14
233	600026	中远海能	1,886,623.00	14.11
234	603006	黎明股份	1,881,060.00	14.07
235	002242	九阳股份	1,880,344.16	14.07
236	000636	风华高科	1,873,632.00	14.02
237	600675	中华企业	1,864,373.00	13.95
238	300760	迈瑞医疗	1,853,567.00	13.87
239	002025	航天电器	1,836,960.00	13.74
240	300146	汤臣倍健	1,827,504.00	13.67
241	600372	中航机载	1,811,974.00	13.56
242	688036	传音控股	1,788,721.97	13.38
243	603320	迪贝电气	1,786,321.00	13.36
244	002939	长城证券	1,772,362.00	13.26
245	688173	希荻微	1,771,899.30	13.26
246	605577	龙版传媒	1,764,427.72	13.20

247	002430	杭氧股份	1,743,800.00	13.05
248	301153	中科江南	1,731,503.00	12.95
249	688779	长远锂科	1,723,240.22	12.89
250	688621	阳光诺和	1,721,114.35	12.88
251	688325	赛微微电	1,716,766.76	12.84
252	688310	迈得医疗	1,712,355.22	12.81
253	600061	国投资本	1,700,354.00	12.72
254	603267	鸿远电子	1,694,541.00	12.68
255	603826	坤彩科技	1,684,849.00	12.61
256	688551	科威尔	1,683,840.17	12.60
257	688198	佰仁医疗	1,679,741.53	12.57
258	688082	盛美上海	1,679,484.83	12.56
259	300679	电连技术	1,668,322.00	12.48
260	688718	唯赛勃	1,663,341.51	12.44
261	603378	亚士创能	1,661,958.00	12.43
262	600085	同仁堂	1,658,360.00	12.41
263	603218	日月股份	1,619,491.00	12.12
264	002389	航天彩虹	1,610,757.00	12.05
265	600036	招商银行	1,609,212.00	12.04
266	603800	道森股份	1,607,685.00	12.03
267	000963	华东医药	1,607,541.00	12.03
268	688301	奕瑞科技	1,603,776.80	12.00
269	301015	百洋医药	1,587,132.02	11.87
270	300604	长川科技	1,583,714.00	11.85
271	601838	成都银行	1,580,034.00	11.82
272	600316	洪都航空	1,568,610.00	11.74
273	301239	普瑞眼科	1,553,305.00	11.62
274	688777	中控技术	1,549,093.26	11.59
275	688521	芯原股份	1,544,475.24	11.55
276	600353	旭光电子	1,544,099.00	11.55
277	600705	中航产融	1,541,864.00	11.54
278	688281	华秦科技	1,538,490.27	11.51
279	000728	国元证券	1,529,144.00	11.44
280	688177	百奥泰	1,521,540.53	11.38
281	688188	柏楚电子	1,521,414.99	11.38
282	600482	中国动力	1,521,103.00	11.38
283	600548	深高速	1,518,548.00	11.36
284	688448	磁谷科技	1,508,075.77	11.28
285	688622	禾信仪器	1,506,983.57	11.27
286	601319	中国人保	1,498,371.00	11.21
287	000807	云铝股份	1,493,645.00	11.17
288	688118	普元信息	1,485,433.58	11.11
289	000703	恒逸石化	1,484,926.00	11.11

290	002275	桂林三金	1,484,142.00	11.10
291	000066	中国长城	1,481,743.00	11.09
292	601991	大唐发电	1,479,557.00	11.07
293	002955	鸿合科技	1,474,080.00	11.03
294	600587	新华医疗	1,473,261.00	11.02
295	002422	科伦药业	1,467,451.00	10.98
296	603568	伟明环保	1,464,473.00	10.96
297	603661	恒林股份	1,458,010.00	10.91
298	601698	中国卫通	1,448,257.00	10.84
299	000932	华菱钢铁	1,448,206.00	10.83
300	688252	天德钰	1,442,807.08	10.79
301	600352	浙江龙盛	1,431,224.00	10.71
302	688248	南网科技	1,427,513.88	10.68
303	688395	正弦电气	1,425,511.97	10.66
304	600536	中国软件	1,420,980.00	10.63
305	601162	天风证券	1,418,548.00	10.61
306	688169	石头科技	1,416,638.86	10.60
307	603517	绝味食品	1,415,815.00	10.59
308	600998	九州通	1,409,317.42	10.54
309	688116	天奈科技	1,398,740.64	10.46
310	000581	威孚高科	1,398,192.00	10.46
311	300296	利亚德	1,396,745.00	10.45
312	688616	西力科技	1,381,133.01	10.33
313	600095	湘财股份	1,372,448.00	10.27
314	002738	中矿资源	1,369,647.80	10.25
315	688566	吉贝尔	1,369,341.08	10.24
316	688536	思瑞浦	1,365,126.89	10.21
317	601801	皖新传媒	1,363,816.00	10.20
318	000030	富奥股份	1,363,662.00	10.20
319	601881	中国银河	1,358,960.00	10.17
320	688466	金科环境	1,357,811.33	10.16
321	600369	西南证券	1,351,984.00	10.11
322	603236	移远通信	1,350,514.00	10.10
323	000785	居然之家	1,348,381.00	10.09
324	300181	佐力药业	1,342,228.00	10.04
325	000415	渤海租赁	1,326,580.00	9.92
326	000060	中金岭南	1,325,314.00	9.92
327	603983	丸美股份	1,310,216.00	9.80
328	300927	江天化学	1,309,382.00	9.80
329	603217	元利科技	1,306,585.00	9.78
330	001203	大中矿业	1,297,522.00	9.71
331	600500	中化国际	1,296,570.81	9.70
332	000021	深科技	1,295,250.00	9.69

333	300559	佳发教育	1,289,498.00	9.65
334	002653	海思科	1,279,560.00	9.57
335	603026	胜华新材	1,272,444.00	9.52
336	600897	厦门空港	1,270,739.00	9.51
337	601992	金隅集团	1,270,671.00	9.51
338	002890	弘宇股份	1,269,462.20	9.50
339	688707	振华新材	1,267,640.91	9.48
340	002281	光迅科技	1,257,291.00	9.41
341	603090	宏盛股份	1,250,653.00	9.36
342	002395	双象股份	1,246,383.00	9.32
343	688682	霍莱沃	1,241,782.38	9.29
344	002963	豪尔赛	1,240,654.00	9.28
345	300212	易华录	1,240,614.00	9.28
346	688020	方邦股份	1,240,216.75	9.28
347	600418	江淮汽车	1,232,329.00	9.22
348	002156	通富微电	1,226,045.00	9.17
349	600546	山煤国际	1,217,028.00	9.11
350	600060	海信视像	1,216,993.00	9.10
351	300554	三超新材	1,216,886.00	9.10
352	601020	华钰矿业	1,216,394.00	9.10
353	002152	广电运通	1,215,907.00	9.10
354	688058	宝兰德	1,209,481.74	9.05
355	002396	星网锐捷	1,207,240.00	9.03
356	000729	燕京啤酒	1,206,431.00	9.03
357	000999	华润三九	1,198,198.00	8.96
358	603499	翔港科技	1,188,587.00	8.89
359	688360	德马科技	1,187,967.11	8.89
360	000539	粤电力 A	1,184,727.00	8.86
361	002558	巨人网络	1,182,961.00	8.85
362	603885	吉祥航空	1,175,937.00	8.80
363	000563	陕国投 A	1,175,517.00	8.79
364	300759	康龙化成	1,173,945.00	8.78
365	688190	云路股份	1,169,320.38	8.75
366	600435	北方导航	1,168,487.00	8.74
367	600348	华阳股份	1,161,950.00	8.69
368	603569	长久物流	1,161,699.00	8.69
369	688030	山石网科	1,161,559.97	8.69
370	600583	海油工程	1,157,532.00	8.66
371	688127	蓝特光学	1,150,653.67	8.61
372	688185	康希诺	1,149,798.07	8.60
373	688021	奥福环保	1,148,557.97	8.59
374	688247	宣泰医药	1,138,676.32	8.52
375	002322	理工能科	1,132,336.00	8.47

376	002600	领益智造	1,126,362.00	8.43
377	300438	鹏辉能源	1,126,117.00	8.42
378	603895	天永智能	1,124,865.00	8.42
379	600642	申能股份	1,124,203.00	8.41
380	002756	永兴材料	1,109,297.00	8.30
381	688072	拓荆科技	1,109,046.39	8.30
382	603719	良品铺子	1,108,256.00	8.29
383	688425	铁建重工	1,106,720.83	8.28
384	688109	品茗科技	1,103,665.21	8.26
385	300689	澄天伟业	1,102,802.00	8.25
386	001979	招商蛇口	1,096,448.00	8.20
387	000603	盛达资源	1,092,353.00	8.17
388	002850	科达利	1,090,256.00	8.16
389	300832	新产业	1,088,656.00	8.14
390	000617	中油资本	1,078,988.00	8.07
391	601100	恒立液压	1,078,487.00	8.07
392	688579	山大地纬	1,074,118.43	8.04
393	688302	海创药业	1,072,259.31	8.02
394	002465	海格通信	1,070,953.00	8.01
395	301026	浩通科技	1,067,802.00	7.99
396	600928	西安银行	1,064,693.00	7.97
397	000537	中绿电	1,061,476.00	7.94
398	688066	航天宏图	1,054,484.15	7.89
399	300251	光线传媒	1,053,628.00	7.88
400	688052	纳芯微	1,048,773.26	7.85
401	600215	派斯林	1,046,985.00	7.83
402	688105	诺唯赞	1,042,333.53	7.80
403	300822	贝仕达克	1,038,605.00	7.77
404	600301	华锡有色	1,037,743.00	7.76
405	688227	品高股份	1,032,343.04	7.72
406	603000	人民网	1,031,363.00	7.72
407	600572	康恩贝	1,028,266.00	7.69
408	688236	春立医疗	1,026,902.88	7.68
409	002399	海普瑞	1,024,348.00	7.66
410	002637	赞宇科技	1,020,629.00	7.64
411	300515	三德科技	1,019,805.00	7.63
412	603893	瑞芯微	1,018,094.00	7.62
413	002541	鸿路钢构	1,014,958.00	7.59
414	002674	兴业科技	1,013,402.00	7.58
415	603958	哈森股份	1,010,772.00	7.56
416	300717	华信新材	1,009,616.00	7.55
417	688234	天岳先进	1,008,559.53	7.55
418	688081	兴图新科	1,000,080.50	7.48

419	688655	迅捷兴	998,483.66	7.47
420	688226	威腾电气	998,318.47	7.47
421	603915	国茂股份	992,520.00	7.43
422	603311	金海高科	987,839.00	7.39
423	300684	中石科技	983,888.00	7.36
424	600885	宏发股份	982,181.00	7.35
425	603866	桃李面包	979,967.80	7.33
426	688101	三达膜	978,532.99	7.32
427	603868	飞科电器	977,139.00	7.31
428	603676	卫信康	970,467.00	7.26
429	301070	开勒股份	968,360.00	7.24
430	601566	九牧王	966,723.00	7.23
431	601898	中煤能源	959,582.00	7.18
432	002416	爱施德	956,074.00	7.15
433	688767	博拓生物	955,602.09	7.15
434	688670	金迪克	951,958.53	7.12
435	300699	光威复材	951,357.00	7.12
436	300445	康斯特	948,605.00	7.10
437	601001	晋控煤业	946,196.00	7.08
438	603699	纽威股份	941,706.00	7.05
439	688097	博众精工	937,222.74	7.01
440	301180	万祥科技	935,599.00	7.00
441	600170	上海建工	932,774.00	6.98
442	688092	爱科科技	925,650.01	6.93
443	600961	株冶集团	919,401.00	6.88
444	600376	首开股份	909,081.00	6.80
445	301051	信濠光电	907,572.00	6.79
446	600988	赤峰黄金	903,523.00	6.76
447	002811	郑中设计	897,387.00	6.71
448	002487	大金重工	891,521.00	6.67
449	688697	纽威数控	885,130.81	6.62
450	605151	西上海	882,887.00	6.61
451	688778	厦钨新能	875,640.71	6.55
452	300886	华业香料	873,264.00	6.53
453	600315	上海家化	871,516.00	6.52
454	600511	国药股份	871,510.00	6.52
455	603928	兴业股份	864,919.00	6.47
456	601228	广州港	858,026.00	6.42
457	300972	万辰集团	855,792.00	6.40
458	002690	美亚光电	854,498.85	6.39
459	688398	赛特新材	851,991.47	6.37
460	603606	东方电缆	851,585.00	6.37
461	000933	神火股份	848,418.00	6.35

462	603587	地素时尚	845,874.99	6.33
463	002782	可立克	843,688.00	6.31
464	002434	万里扬	828,210.00	6.20
465	000032	深桑达 A	827,719.00	6.19
466	002142	宁波银行	826,087.00	6.18
467	601137	博威合金	825,535.00	6.18
468	603199	九华旅游	820,600.00	6.14
469	002415	海康威视	819,662.00	6.13
470	603609	禾丰股份	816,476.00	6.11
471	300695	兆丰股份	814,456.00	6.09
472	000831	中国稀土	810,749.00	6.07
473	600475	华光环能	800,274.00	5.99
474	002645	华宏科技	796,373.00	5.96
475	601872	招商轮船	792,342.00	5.93
476	300274	阳光电源	791,850.00	5.92
477	603889	新澳股份	790,584.00	5.91
478	002608	江苏国信	789,981.00	5.91
479	603879	永悦科技	788,680.00	5.90
480	603605	珀莱雅	785,888.00	5.88
481	688292	浩瀚深度	784,719.67	5.87
482	300017	网宿科技	782,865.00	5.86
483	000062	深圳华强	779,681.75	5.83
484	600986	浙文互联	775,081.00	5.80
485	603790	雅运股份	772,668.00	5.78
486	002096	易普力	771,638.00	5.77
487	601717	郑煤机	770,349.00	5.76
488	000738	航发控制	759,532.00	5.68
489	600197	伊力特	758,410.00	5.67
490	688229	博睿数据	754,947.90	5.65
491	000400	许继电气	754,853.00	5.65
492	002508	老板电器	753,486.00	5.64
493	605218	伟时电子	743,864.00	5.57
494	000951	中国重汽	741,827.00	5.55
495	688013	天臣医疗	741,189.38	5.55
496	002338	奥普光电	740,975.15	5.54
497	603178	圣龙股份	739,576.00	5.53
498	002056	横店东磁	739,181.00	5.53
499	601828	美凯龙	737,216.00	5.52
500	601689	拓普集团	736,908.00	5.51
501	002500	山西证券	733,983.90	5.49
502	600266	城建发展	732,671.55	5.48
503	688197	首药控股	730,639.88	5.47
504	002866	传艺科技	723,508.00	5.41

505	688139	海尔生物	716,804.55	5.36
506	603551	奥普家居	715,860.48	5.36
507	600820	隧道股份	712,333.00	5.33
508	605123	派克新材	711,595.00	5.32
509	300492	华图山鼎	711,400.00	5.32
510	300800	力合科技	709,505.00	5.31
511	000950	重药控股	709,182.00	5.31
512	600507	方大特钢	699,990.00	5.24
513	601608	中信重工	699,459.00	5.23
514	600486	扬农化工	696,001.00	5.21
515	600826	兰生股份	691,475.00	5.17
516	002223	鱼跃医疗	684,368.00	5.12
517	603897	长城科技	679,855.00	5.09
518	600588	用友网络	676,688.00	5.06
519	603787	新日股份	673,956.00	5.04
520	000883	湖北能源	667,090.00	4.99
521	000938	紫光股份	667,062.00	4.99
522	002865	钧达股份	665,125.00	4.98
523	301076	新瀚新材	664,021.63	4.97
524	300980	祥源新材	663,823.00	4.97
525	688314	康拓医疗	661,501.19	4.95
526	688063	派能科技	660,964.20	4.94
527	689009	九号公司	659,805.58	4.94
528	600895	张江高科	659,199.00	4.93
529	688003	天准科技	657,769.90	4.92
530	300390	天华新能	656,692.00	4.91
531	688676	金盘科技	656,604.14	4.91
532	688358	祥生医疗	656,507.20	4.91
533	603197	保隆科技	653,878.00	4.89
534	603055	台华新材	651,118.00	4.87
535	601998	中信银行	648,937.00	4.85
536	300750	宁德时代	644,470.00	4.82
537	002044	美年健康	637,515.00	4.77
538	688186	广大特材	637,179.00	4.77
539	688077	大地熊	636,271.40	4.76
540	002988	豪美新材	634,928.00	4.75
541	300881	盛德鑫泰	634,880.00	4.75
542	603081	大丰实业	634,625.00	4.75
543	600673	东阳光	633,771.00	4.74
544	603535	嘉诚国际	632,558.00	4.73
545	601107	四川成渝	631,185.00	4.72
546	000887	中鼎股份	628,943.00	4.71
547	603127	昭衍新药	627,525.40	4.69

548	601138	工业富联	624,841.00	4.67
549	688581	安杰思	624,746.91	4.67
550	300618	寒锐钴业	622,114.00	4.65
551	603160	汇顶科技	621,675.00	4.65
552	300850	新强联	620,720.00	4.64
553	002572	索菲亚	614,943.00	4.60
554	688357	建龙微纳	614,432.35	4.60
555	300257	开山股份	613,514.00	4.59
556	688420	美腾科技	611,195.44	4.57
557	605598	上海港湾	610,165.79	4.56
558	603345	安井食品	602,099.00	4.50
559	000429	粤高速 A	600,979.00	4.50
560	000089	深圳机场	600,339.00	4.49
561	600350	山东高速	600,223.00	4.49
562	603099	长白山	599,927.00	4.49
563	300155	安居宝	599,358.00	4.48
564	688222	成都先导	599,024.55	4.48
565	600223	福瑞达	598,625.00	4.48
566	688155	先惠技术	594,143.51	4.45
567	688191	智洋创新	590,042.03	4.41
568	002266	浙富控股	589,877.00	4.41
569	000800	一汽解放	584,512.00	4.37
570	001286	陕西能源	576,227.00	4.31
571	300795	米奥会展	574,497.00	4.30
572	688665	四方光电	571,574.34	4.28
573	601666	平煤股份	571,099.00	4.27
574	300114	中航电测	570,722.00	4.27
575	601900	南方传媒	559,821.00	4.19
576	002497	雅化集团	556,099.00	4.16
577	002912	中新赛克	555,203.00	4.15
578	688088	虹软科技	552,600.37	4.13
579	601233	桐昆股份	544,599.00	4.07
580	002466	天齐锂业	540,237.00	4.04
581	002577	雷柏科技	536,871.00	4.02
582	688050	爱博医疗	536,004.28	4.01
583	300383	光环新网	535,434.00	4.01
584	003031	中瓷电子	533,534.00	3.99
585	601601	中国太保	530,516.00	3.97
586	688106	金宏气体	529,564.26	3.96
587	000629	钒钛股份	529,500.00	3.96
588	000012	南玻 A	528,982.00	3.96
589	300428	立中集团	528,665.00	3.96
590	600153	建发股份	523,575.00	3.92

591	002320	海峡股份	518,490.00	3.88
592	601577	长沙银行	512,208.00	3.83
593	688053	思科瑞	510,580.34	3.82
594	002268	电科网安	505,514.00	3.78
595	688055	龙腾光电	503,748.44	3.77
596	603530	神马电力	502,365.00	3.76
597	002916	深南电路	501,705.00	3.75
598	600497	驰宏锌锗	498,892.00	3.73
599	601066	中信建投	498,454.00	3.73
600	300926	博俊科技	495,386.00	3.71
601	300765	新诺威	495,044.00	3.70
602	300884	狄耐克	494,840.00	3.70
603	688012	中微公司	493,692.96	3.69
604	300965	恒宇信通	492,770.00	3.69
605	002678	珠江钢琴	492,190.00	3.68
606	603948	建业股份	492,165.00	3.68
607	603032	德新科技	490,378.00	3.67
608	601658	邮储银行	487,458.00	3.65
609	600809	山西汾酒	487,203.00	3.64
610	000028	国药一致	486,270.60	3.64
611	603567	珍宝岛	485,906.00	3.64
612	601225	陕西煤业	484,927.00	3.63
613	688323	瑞华泰	483,894.78	3.62
614	600161	天坛生物	482,663.00	3.61
615	688087	英科再生	480,771.18	3.60
616	601106	中国一重	478,965.00	3.58
617	688150	莱特光电	478,739.21	3.58
618	600941	中国移动	477,473.00	3.57
619	002428	云南锗业	476,826.00	3.57
620	601665	齐鲁银行	474,137.00	3.55
621	002017	东信和平	473,122.00	3.54
622	688100	威胜信息	471,610.85	3.53
623	688061	灿瑞科技	471,265.07	3.53
624	605178	时空科技	470,334.00	3.52
625	002131	利欧股份	467,446.00	3.50
626	600118	中国卫星	467,006.00	3.49
627	300068	南都电源	464,142.00	3.47
628	601636	旗滨集团	464,032.00	3.47
629	300580	贝斯特	460,427.00	3.44
630	603208	江山欧派	460,290.00	3.44
631	603489	八方股份	458,441.00	3.43
632	600765	中航重机	458,029.00	3.43
633	600917	重庆燃气	457,721.00	3.42

634	300031	宝通科技	454,113.00	3.40
635	002324	普利特	452,944.00	3.39
636	002755	奥赛康	450,558.00	3.37
637	002942	新农股份	447,511.00	3.35
638	600325	华发股份	444,520.00	3.33
639	002468	申通快递	444,323.00	3.32
640	000063	中兴通讯	443,255.00	3.32
641	300511	雪榕生物	438,795.00	3.28
642	688596	正帆科技	438,338.64	3.28
643	301236	软通动力	436,312.00	3.26
644	688165	埃夫特	435,273.68	3.26
645	003006	百亚股份	435,270.00	3.26
646	600633	浙数文化	435,177.67	3.26
647	300226	上海钢联	435,056.00	3.25
648	301227	森鹰窗业	434,632.00	3.25
649	688520	神州细胞	434,281.94	3.25
650	000156	华数传媒	428,076.00	3.20
651	603657	春光科技	425,077.00	3.18
652	301309	万得凯	424,813.00	3.18
653	688231	隆达股份	424,431.88	3.18
654	001313	粤海饲料	424,406.00	3.18
655	002885	京泉华	423,130.00	3.17
656	605058	澳弘电子	422,200.00	3.16
657	603363	傲农生物	421,197.00	3.15
658	301042	安联锐视	420,917.00	3.15
659	603037	凯众股份	419,167.00	3.14
660	001207	联科科技	416,804.00	3.12
661	601326	秦港股份	414,923.00	3.10
662	688076	诺泰生物	414,498.22	3.10
663	300092	科新机电	413,375.00	3.09
664	001288	运机集团	411,735.00	3.08
665	600416	湘电股份	409,617.00	3.06
666	603992	松霖科技	409,451.00	3.06
667	603816	顾家家居	408,266.00	3.05
668	002068	黑猫股份	407,495.00	3.05
669	003041	真爱美家	407,002.00	3.04
670	605580	恒盛能源	402,866.24	3.01
671	002066	瑞泰科技	402,815.00	3.01
672	002634	棒杰股份	402,529.00	3.01
673	603706	东方环宇	402,083.00	3.01
674	300314	戴维医疗	401,709.00	3.01
675	600089	特变电工	400,806.00	3.00
676	688233	神工股份	400,649.71	3.00

677	603658	安图生物	399,609.00	2.99
678	603516	淳中科技	399,574.00	2.99
679	300705	九典制药	398,465.00	2.98
680	002050	三花智控	396,229.00	2.96
681	605189	富春染织	395,427.00	2.96
682	002318	久立特材	394,861.00	2.95
683	688368	晶丰明源	394,794.87	2.95
684	003008	开普检测	394,538.00	2.95
685	002544	普天科技	393,600.00	2.94
686	688166	博瑞医药	392,692.21	2.94
687	002946	新乳业	392,637.00	2.94
688	688230	芯导科技	391,284.00	2.93
689	603297	永新光学	390,645.00	2.92
690	300452	山河药辅	390,532.60	2.92
691	000425	徐工机械	390,197.00	2.92
692	603767	中马传动	389,632.00	2.92
693	603323	苏农银行	388,827.00	2.91
694	603877	太平鸟	387,614.00	2.90
695	001914	招商积余	387,561.00	2.90
696	688590	新致软件	386,703.67	2.89
697	300218	安利股份	384,823.00	2.88
698	002807	江阴银行	384,511.00	2.88
699	600012	皖通高速	382,076.00	2.86
700	688798	艾为电子	380,803.32	2.85
701	300638	广和通	380,617.00	2.85
702	688200	华峰测控	379,565.67	2.84
703	688377	迪威尔	377,352.15	2.82
704	300321	同大股份	377,199.00	2.82
705	300697	电工合金	375,239.00	2.81
706	688468	科美诊断	372,976.30	2.79
707	688259	创耀科技	372,367.95	2.79
708	000977	浪潮信息	372,061.00	2.78
709	688217	睿昂基因	371,127.54	2.78
710	688220	翱捷科技	366,595.41	2.74
711	002906	华阳集团	363,939.00	2.72
712	002254	泰和新材	363,708.00	2.72
713	600295	鄂尔多斯	363,259.00	2.72
714	002968	新大正	361,037.00	2.70
715	600011	华能国际	360,564.00	2.70
716	301039	中集车辆	360,044.00	2.69
717	605086	龙高股份	359,373.00	2.69
718	688786	悦安新材	358,876.06	2.68
719	688819	天能股份	357,782.78	2.68

720	688350	富淼科技	357,516.62	2.67
721	600737	中粮糖业	354,286.00	2.65
722	601000	唐山港	353,190.00	2.64
723	002949	华阳国际	353,102.00	2.64
724	688258	卓易信息	352,818.75	2.64
725	601198	东兴证券	347,797.00	2.60
726	600755	厦门国贸	347,765.36	2.60
727	605588	冠石科技	345,400.00	2.58
728	000783	长江证券	343,440.00	2.57
729	603505	金石资源	343,258.00	2.57
730	605118	力鼎光电	342,730.00	2.56
731	601012	隆基绿能	342,209.00	2.56
732	002472	双环传动	342,053.00	2.56
733	002915	中欣氟材	341,736.00	2.56
734	300360	炬华科技	341,157.00	2.55
735	603728	鸣志电器	340,667.00	2.55
736	603192	汇得科技	338,776.00	2.53
737	002958	青农商行	338,327.00	2.53
738	603993	洛阳钼业	335,127.00	2.51
739	688228	开普云	334,081.61	2.50
740	600703	三安光电	334,062.00	2.50
741	600665	天地源	333,873.00	2.50
742	688696	极米科技	331,872.00	2.48
743	688260	昀冢科技	331,089.97	2.48
744	301068	大地海洋	329,113.00	2.46
745	688382	益方生物	328,772.50	2.46
746	300977	深圳瑞捷	326,971.00	2.45
747	605179	一鸣食品	322,460.00	2.41
748	605162	新中港	322,087.00	2.41
749	001308	康冠科技	321,738.00	2.41
750	600657	信达地产	321,308.00	2.40
751	605300	佳禾食品	319,374.00	2.39
752	605028	世茂能源	319,054.00	2.39
753	001211	双枪科技	318,282.05	2.38
754	605169	洪通燃气	317,702.56	2.38
755	601163	三角轮胎	317,636.00	2.38
756	603353	和顺石油	317,582.00	2.38
757	605005	合兴股份	317,245.00	2.37
758	300594	朗进科技	316,325.00	2.37
759	688084	晶品特装	315,149.06	2.36
760	688295	中复神鹰	314,782.86	2.36
761	301045	天禄科技	314,182.00	2.35
762	688400	凌云光	314,153.87	2.35

763	603508	思维列控	313,806.00	2.35
764	605228	神通科技	312,627.00	2.34
765	603466	风语筑	312,417.00	2.34
766	688501	青达环保	311,780.88	2.33
767	603038	华立股份	311,524.00	2.33
768	002952	亚世光电	311,409.00	2.33
769	605155	西大门	311,394.00	2.33
770	300285	国瓷材料	310,822.00	2.33
771	300054	鼎龙股份	310,062.00	2.32
772	300211	亿通科技	309,923.00	2.32
773	603813	原尚股份	309,650.00	2.32
774	002966	苏州银行	307,942.00	2.30
775	605255	天普股份	307,689.00	2.30
776	605500	森林包装	307,348.00	2.30
777	001229	魅视科技	307,001.00	2.30
778	603238	诺邦股份	303,552.00	2.27
779	605158	华达新材	303,370.00	2.27
780	600148	长春一东	303,054.00	2.27
781	603976	正川股份	302,876.00	2.27
782	003018	金富科技	302,621.00	2.26
783	605318	法狮龙	301,027.00	2.25
784	605488	福莱新材	300,970.90	2.25
785	605099	共创草坪	300,857.00	2.25
786	603511	爱慕股份	300,461.00	2.25
787	300423	昇辉科技	300,428.00	2.25
788	605566	福莱蒽特	299,889.00	2.24
789	603969	银龙股份	298,552.46	2.23
790	000534	万泽股份	295,872.00	2.21
791	300908	仲景食品	294,914.00	2.21
792	603216	梦天家居	292,460.00	2.19
793	688617	惠泰医疗	291,152.00	2.18
794	601999	出版传媒	290,232.00	2.17
795	002429	兆驰股份	289,230.00	2.16
796	603880	ST 南卫	286,402.00	2.14
797	600028	中国石化	285,361.00	2.13
798	000034	神州数码	282,041.00	2.11
799	000906	浙商中拓	279,048.00	2.09
800	600132	重庆啤酒	278,478.00	2.08
801	603685	晨丰科技	278,477.00	2.08
802	300953	震裕科技	278,101.00	2.08
803	002673	西部证券	278,049.00	2.08
804	002371	北方华创	274,714.00	2.06
805	002387	维信诺	273,834.00	2.05

806	001210	金房能源	272,303.00	2.04
807	301099	雅创电子	270,936.00	2.03
808	688484	南芯科技	270,102.47	2.02
809	002891	中宠股份	268,865.00	2.01

注：上述卖出金额为卖出成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,486,760,847.68
卖出股票收入（成交）总额	1,282,174,589.26

注：上述买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 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，以套期保值为主要目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，同时兼顾基差的变化，以达到有效跟踪并力争超越标的指数的目的。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体未披露被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	282,624.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	381,463.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	664,087.62

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人	户均持有的基	持有人结构
------	-----	--------	-------

	户数 (户)	金份额	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 (%)
建信中证 500 指数 量化增强 发起 A	2,801	45,139.60	15,542,230.15	12.29	110,893,796.23	87.71
建信中证 500 指数 量化增强 发起 C	2,956	29,833.41	2,198,774.19	2.49	85,988,779.87	97.51
合计	5,757	37,280.46	17,741,004.34	8.27	196,882,576.10	91.73

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所 有从业 人员持 有本基 金	建信中证 500 指数量化增强发 起 A	9,004.33	0.01
	建信中证 500 指数量化增强发 起 C	-	-
	合计	9,004.33	0.00

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

截至本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及本基金基金经理未持有本基金。

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

9.5 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	10,001,889.08	4.66	10,001,889.08	4.66	3 年

金					
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	10,001,889.08	4.66	10,001,889.08	4.66	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	建信中证 500 指数量化增强发起 A	建信中证 500 指数量化增强发起 C
基金合同生效日 (2022 年 12 月 23 日) 基金份额总额	12,099,599.84	1,238,351.04
本报告期期初基金份额总额	12,099,599.84	1,238,351.04
本报告期基金总申购份额	275,453,985.67	317,944,897.30
减：本报告期基金总赎回份额	161,117,559.13	230,995,694.28
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,436,026.38	88,187,554.06

注：如有相应情况，申购含红利再投、转换入份额及金额，赎回含转换出份额及金额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 19 日发布公告，自 2023 年 1 月 17 日起吴灵玲女士不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起刘军先生不再担任建信基金管理有限责任公司董事长，暂由总裁张军红先生代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 2 月 18 日发布公告，自 2023 年 2 月 17 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司副总裁；基金管理人于 2023 年 3 月 18 日发布公

告，自 2023 年 3 月 17 日起聘任张力铮先生担任建信基金管理有限责任公司副总裁，张威威先生不再担任建信基金管理有限责任公司副总裁、首席信息官；基金管理人于 2023 年 9 月 28 日发布公告，自 2023 年 9 月 26 日起聘任生柳荣先生担任建信基金管理有限责任公司董事长，张军红先生不再代为履行董事长职务；基金管理人于 2023 年 12 月 9 日发布公告，自 2023 年 12 月 7 日起聘任宫永媛女士担任建信基金管理有限责任公司财务负责人。上述事项均已按相关规定报中国证券监督管理委员会北京监管局和中国证券投资基金业协会备案。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金的审计机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内会计师事务所未发生改变。本年度审计费用为人民币 40000 元。该会计师事务所自 2019 年起为本公司旗下所有公募基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	建信基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 7 月 14 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	公司个别业务内部控制机制和风险管理工作不完善。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	截止本报告期末，公司已按照法律法规和监管要求及时完成整改工作，并将整改报告报送至监管机构。
其他	无

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国信证券	3	1,448,117,734.00	52.45	1,092,179.43	49.24	-
中信证券	3	435,528,927.43	15.78	392,708.33	17.70	-
开源证券	1	233,950,042.26	8.47	171,087.95	7.71	-
华创证券	1	229,998,826.60	8.33	214,200.87	9.66	-
光大证券	1	106,635,203.10	3.86	98,255.29	4.43	-
华泰证券	5	90,425,985.54	3.28	73,528.30	3.31	-
东北证券	1	89,428,472.76	3.24	64,503.13	2.91	-
中泰证券	3	70,803,232.31	2.56	65,229.23	2.94	-
国泰君安	2	27,272,968.98	0.99	19,945.12	0.90	-
太平洋证券	1	25,840,354.00	0.94	24,065.94	1.08	-
高盛（中国）证券	1	2,711,243.57	0.10	2,524.62	0.11	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基

金字[2007]48号)的规定及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

(1) 财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格，能够满足基金运作高度保密的要求，在最近一年内没有重大违规行为；

(2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

(3) 具备较强的研究能力，有固定的研究机构和专门的研究人员，能够对宏观经济、证券市场、行业、个券等进行深入、全面的研究，能够积极、有效地将研究成果及时传递给基金管理人，能够根据基金管理人所管理基金的特定要求进行专项研究服务；

(4) 佣金费率合理。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

3、本基金本报告期内无新增和剔除交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
高盛(中 国)证券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于调整旗下部分基金申购金额起点（包括转换转入、定投）及赎回份额下限（包括转换转出）的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 12 月 20 日
2	关于新增上海基煜为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 11 月 16 日
3	关于新增深圳前海微众银行股份有限公司为建信创新中国混合型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 9 月 26 日
4	建信基金管理有限责任公司关于新增宁波银行易管家平台为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 8 月 29 日
5	关于新增东方财富证券股份有限公司为建信旗下部分基金产品销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 8 月 23 日

6	关于新增长江证券股份有限公司为建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 8 月 14 日
7	关于新增兴业证券股份有限公司为建信中证 500 量化指数增强型发起式证券投资基金销售机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 7 月 31 日
8	关于新增平安银行为公司旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 7 月 25 日
9	关于新增腾安基金销售（深圳）有限公司为建信现代服务业股票型证券投资基金等基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 6 月 29 日
10	关于更新建信基金旗下公募基金产品适当性风险等级评定结果的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 2 月 15 日
11	关于新增泰信财富基金销售有限公司为建信弘利灵活配置混合型证券投资基金等代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 1 月 11 日
12	建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2023 年 1 月 3 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

单位：份

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2023 年 01 月 01 日-2023 年 02 月 08 日	10,001,889.08	-	-	10,001,889.08	4.66

注：本基金本报告期末不存在单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金基金合同》；

- 3、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信中证 500 指数量化增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

2024 年 3 月 28 日