

信澳量化多因子混合型证券投资基金
(LOF)
2023 年年度报告
2023 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	7
3.3 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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	90
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	90

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	90
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	90
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	90
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	90
8.12	投资组合报告附注	90
§9	基金份额持有人信息	91
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	91
9.2	期末上市基金前十名持有人	92
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	92
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	92
§10	开放式基金份额变动	93
§11	重大事件揭示	93
11.1	基金份额持有人大会决议	93
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	93
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	93
11.4	基金投资策略的改变	94
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	94
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	94
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	94
11.8	其他重大事件	95
§12	影响投资者决策的其他重要信息	98
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	98
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	99
§13	备查文件目录	99
13.1	备查文件目录	99
13.2	存放地点	99
13.3	查阅方式	99

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	信澳量化多因子混合 (LOF)	
场内简称	多因子 LOF	
基金主代码	166107	
交易代码	166107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	91,005,599.27 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2019 年 11 月 28 日	
下属分级基金的基金简称	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	多因子 LOF	-
下属分级基金的交易代码	166107	166108
报告期末下属分级基金的份额总额	8,267,162.68 份	82,738,436.59 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳亚基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黄晖	许俊
	联系电话	0755-83172666	010-66596688

电子邮箱	service@fscinda.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-8888-118	95566
传真	0755-83196151	010-66594942
注册地址	广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	朱永强	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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		2021 年	
	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C
本期已实现收益	-3,488,822.88	-13,019,008.46	-778,129.87	-48,425.29	318,233.88	39,468.44
本期利润	-3,323,931.21	-13,899,623.20	-955,629.74	-172,041.59	-58,969.11	-10,587.91
加权平均基金	-0.2079	-0.2015	-0.3055	-0.5093	-0.0185	-0.0220

份额本期利润						
本期加权平均净值利润率	-20.27%	-20.28%	-26.38%	-46.87%	-1.33%	-1.61%
本期基金份额净值增长率	-6.77%	-7.51%	-25.55%	-26.25%	-0.06%	-0.86%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C
期末可供分配利润	-200,718.97	-4,765,467.48	209,497.89	138,134.18	930,686.60	37,595.86
期末可供分配基金份额利润	-0.0243	-0.0576	0.0466	0.0189	0.4058	0.3816
期末基金资产净值	8,066,443.71	77,972,969.11	4,701,593.20	7,448,270.28	3,223,914.33	136,127.17
期末基金份额净值	0.9757	0.9424	1.0466	1.0189	1.4058	1.3816
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C
基金份额累计净值增长率	-2.43%	-5.76%	4.66%	1.89%	40.58%	38.16%

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、上述业绩指标不包括持有人交易投资组合的各项费用，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

信澳量化多因子混合（LOF）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	-4.36%	0.82%	-4.36%	0.82%	0.00%	0.00%
过去六个月	-10.69%	0.82%	-9.01%	0.81%	-1.68%	0.01%
过去一年	-6.77%	0.74%	-7.01%	0.78%	0.24%	-0.04%
过去三年	-30.64%	1.18%	-13.83%	1.03%	-16.81%	0.15%
自基金合同生效起至今	-2.43%	1.29%	8.10%	1.17%	-10.53%	0.12%

信澳量化多因子混合（LOF）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	-4.55%	0.82%	-4.36%	0.82%	-0.19%	0.00%
过去六个月	-11.04%	0.82%	-9.01%	0.81%	-2.03%	0.01%
过去一年	-7.51%	0.74%	-7.01%	0.78%	-0.50%	-0.04%
过去三年	-32.38%	1.18%	-13.83%	1.03%	-18.55%	0.15%
自基金合同生效起至今	-5.76%	1.29%	8.10%	1.17%	-13.86%	0.12%

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

信澳量化多因子混合（LOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2019年11月6日至2023年12月31日）



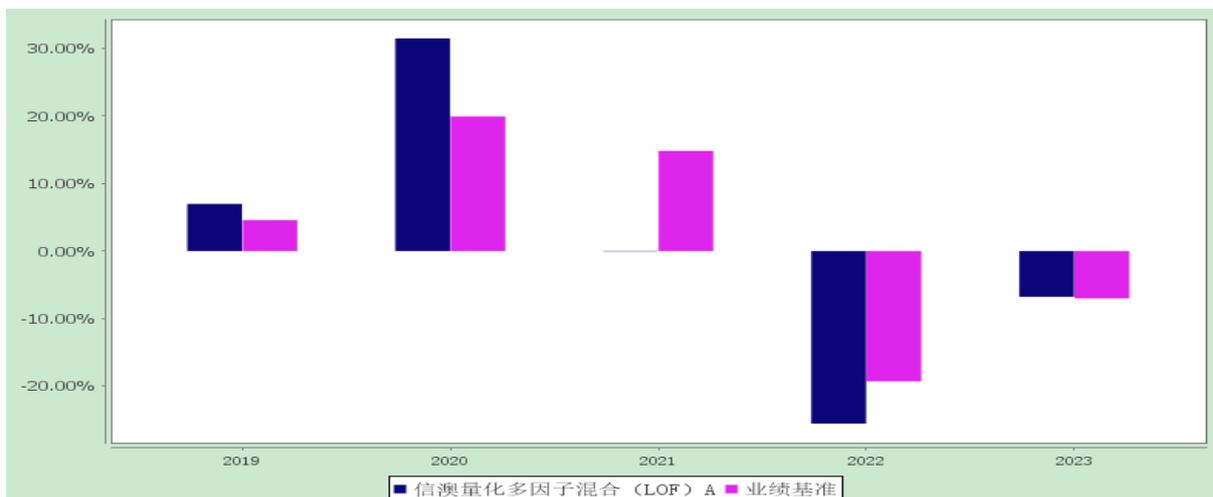
信澳量化多因子混合（LOF）C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势
对比图

（2019 年 11 月 6 日至 2023 年 12 月 31 日）

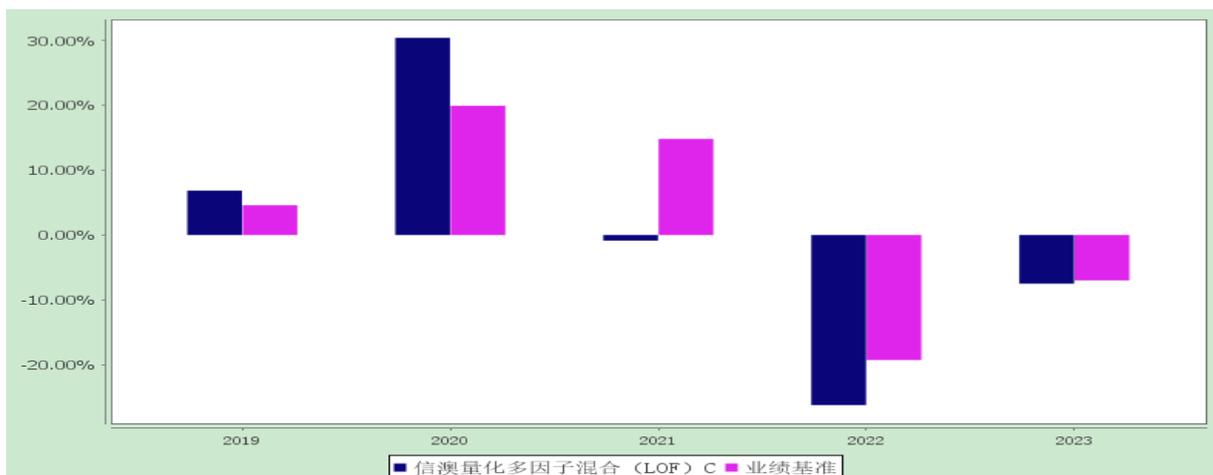


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图
信澳量化多因子混合（LOF）A



信澳量化多因子混合 (LOF) C



注：本基金基金合同于 2019 年 11 月 6 日生效，因此 2019 年的净值增长率是按照基金合同生效后的实际存续期计算的。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年基金无利润分配情况。

§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

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）成立于 2006 年 6 月 5 日，注册资本 1 亿元人民币，公司总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司，是经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金

字[2006]71号文)设立的国内首家由国有资产管理公司控股的基金管理公司。2015年5月22日,信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权,与East Topco Limited共同持有公司股份,持股比例分别为54%和46%。2022年3月21日,由于公司外方股东的实控人变更,以及公司国际化发展战略需要,公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。截至2023年12月31日,公司共管理66只公募基金产品。

公司建立了健全的法人治理结构,根据《中华人民共和国公司法》的规定设立了股东会、董事会和执行监事。董事会层面设立风险控制委员会和薪酬考核委员会两个专门委员会,并建立了独立董事制度。公司实行董事会领导下的总经理负责制,由总经理负责公司的日常运作,并由各委员会包括经营管理委员会、投资审议委员会、风险管理委员会、产品审议委员会、IT治理委员会、运营委员会、市场销售管理委员会、问责委员会等协助其议事决策。

公司建立了完善的组织架构,设立了权益投资总部、混合资产投资部、固收投资总部、智能量化与全球投资部、市场销售部、机构销售总部、银行机构总部、互联网金融部、战略客户部、市场支持部、投资管理部、产品创新部、运营管理总部、风险控制部、行政人事部、财务会计部、监察稽核部、董事会办公室等部门,各部门分工协作,职责明确。

报告期内,公司第六届董事会独立董事宋若冰先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责,报告期内累计履职时间达到法定要求;独立董事杨棉之先生以参加董事会会议、邮件、现场与管理层邮件沟通、通讯表决董事会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责,报告期内累计履职时间达到法定要求;独立董事屈文洲先生以参加董事会会议、通讯表决董事会决议和风险控制委员会决议、审阅公司重要报告和提交工作报告等方式履行职责,报告期内累计履职时间达到法定要求。

报告期内,公司及基金运作未发生重大利益冲突事件,独立董事在履职过程中未发现公司存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
张琦	本基金的基	2022-03-2	-	7年	莱斯特大学应用数学博士。

	金经理	3			2016 年至 2017 年于鹏华基金任金融工程师, 2018 年加入信达澳亚基金管理有限公司任投资经理, 基金经理助理。现任信澳量化多因子基金基金经理(2022 年 3 月 23 日至今)。
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-03-15	-	3.5 年	北京大学理学硕士。2020 年 2 月至 2022 年 9 月于桐昇通惠资产管理有限公司负责管理指数增强类产品。2022 年 10 月加入信达澳亚基金。现任信澳量化多因子基金基金经理(2023 年 3 月 15 日至今)、信澳星耀智选混合基金基金经理(2023 年 8 月 22 日至今)、信澳双创智选混合基金基金经理(2023 年 10 月 16 日至今)、信澳宁隼智选混合基金基金经理(2023 年 12 月 19 日至今)、信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理(2023 年 12 月 22 日起至今)、信澳星亮智选混合基金基金经理(2024 年 1 月 30 日起至今)。

注: 1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

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《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定, 依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产, 在严格控制投资风险的基础上, 为基金持有人谋求最大利益, 没有发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《信达澳亚

基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的 5% 的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

回顾 2023 年，A 股市场经历了较大的波动和频繁的调整，在年初冲高后回落，并随后呈现震荡下行的格局。在上半年，市场受到经济复苏乐观预期的影响，持续上行；然而到了下半年，经济复苏步伐放缓，市场情绪发生转变，各大指数开始回调，并步入震荡区间。全年行业轮动较快，TMT、中特估、高股息策略、低估值风格等均有出现阶段性行情。具体来看，在强预期与强现实的第一阶段，顺周期行业普涨，海外 AIGC 技术也掀起了投资人工智能的浪潮，TMT 迎来一轮上涨行情；在强预期与弱现实的第二阶段，TMT 与中特估逐步走强，成为当时市场的两大主线；在弱预期与弱现实的第三阶段，市场出现多段主题行情：（1）4 月底至 6 月，中特估持续走强，TMT 转为调整，（2）6 月底到 8 月初，随着市场风险偏好的不断下降，低估值与高股息风格表现突出，同时从 7 月 24 日政治局会议提出“活跃资本市场”后随着多项政策的出台，金融、地产有明显的阶段性上涨，（3）8 月到 10 月，同样是偏防御的低估值与高股息风格占优，同时北上资金大幅流出，指数下行明显（4）步入 11 月，TMT 在经历前期调整后再次上行，市场更为关注产业主题投资，同时，具备反转预期的低估值风格同样有不俗表现。

指数上来说，2023 全年沪深 300 指数-11.38%，中证 500 指数-7.42%，中证 1000 指数-6.28%，创业板指-19.41%，双创 50 指数-18.84%。行业上来说，全年通信、传媒、计算机、电子、石油石化涨幅居前，美容护理、商贸零售、房地产、电力设备和建筑材料跌幅居前。

风格上来看，小盘成长指数-10.59%，小盘价值指数-2.92%，中盘成长指数-22.05%，中盘价值指数-3.21%，大盘成长指数-20.09%，大盘价值指数-2.15%。总的来说，本报告期内，中盘成长表现最差，大盘价值表现最优。另外无论是在大盘还是在小盘，价值风格整体表现优于成长风格。

本产品践行多因子的量化选股框架，主要依托逻辑清晰、长期表现稳定的因子来对股票进行打分，同时结合风险模型来构建一篮子股票组合。基本面因子层面，我们在对公司的成长潜力和经营质量进行精细化评估的同时也会控制组合整体的估值；在技术面因子的使用上，我们则更为谨慎和严格。在组合管理方面，本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合市场宏观环境，依靠严格的投资纪律和风险控制，追

求在控制风险的前提下获得超越基准的回报。本报告期内，在市场预期不明，投资者情绪波动较大的市场环境中，情绪类、估值类因子表现靠前，预期类、成长类因子表现居后。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A类基金份额：基金份额净值为0.9757元，份额累计净值为0.9757元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-6.77%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

截至报告期末，C类基金份额：基金份额净值为0.9424元，份额累计净值为0.9424元，本报告期内，本基金份额净值增长率为-7.51%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在高质量发展的要求下，目前国内经济处于新旧动能转换的阵痛期，同时疫情以来居民资产负债表有所受损，其预期和信心仍需修复，部分行业产能存在过剩问题。相对有利的是，中央经济工作会议确定了偏积极的政策基调，去年四季度以来，地方再融资债重启发行、国债增发1万亿元，财政政策转向积极，货币政策预计稳健偏松，有望形成实物总量。同时稳增长基调下，2024年的财政支出力度和减税降费力度有望超过去年。通胀层面，全年有望由筑底走向企稳。

全A的盈利业绩底在2023中报有所确认，根据三季报披露的数据，全A归母净利润增速-1.0%，较中报改善2.28%，边际上显示出全A盈利正历经回暖，盈利触底反弹的拐点已经出现。随着全球新一轮库存周期启动，预计在2024年A股市场的盈利有望进一步实现温和的复苏。另外，当前市场指数与估值已经都处于一个相对较低的水平，市场风险有所释放，叠加经济数据的边际改善，大盘有望逐步企稳回升。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在内部监察稽核工作中一切从规范运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的监察稽核部对公司日常经营、投资交易、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题，敦促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司管理层和监管机构。报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

- (1) 进一步完善公司管理及业务制度。

(2) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统，履行反洗钱义务。

(3) 监督市场营销、基金销售的合规性，落实执行投资者适用性原则。

(4) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员合规风险的有关措施，规避不正当交易行为的发生。

(5) 对业务部门进行相关法律培训，提高员工遵规守法意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值工作严格按照相关法律法规、基金合同以及《信达澳亚基金管理有限公司估值委员会议事规则》进行。

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由分管运营的公司领导担任；估值委员会成员由权益投资总部、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金运营部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。参与估值流程各方包括基金托管人和会计师事务所，各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票流动性折扣、预期信用损失等估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行

利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，截至本报告期末本基金资产净值已达到五千万元。

§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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2024）审字第 70013104_H24 号

信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)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，公允反映了信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)，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。

6.3 其他信息

信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)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。

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。

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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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。

在编制财务报表时，管理层负责评估信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)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。

治理层负责监督信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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。

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：

(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。

(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。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(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，就可能导致对信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)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信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)不能持续经营。

(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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

高鹤 邓雯

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

2024年3月28日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

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	9,254,683.13	5,486,639.05
结算备付金		623,046.73	33,839.44
存出保证金		96,457.84	1,288.88
交易性金融资产	7.4.7.2	78,304,350.29	4,178,986.00
其中：股票投资		78,304,350.29	4,178,986.00
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,182,830.63	2,509,099.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		89,461,368.62	12,209,853.22
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		2,786,044.16	17,417.46
应付管理人报酬		93,266.79	7,261.31
应付托管费		15,544.47	1,210.24
应付销售服务费		53,246.73	605.20
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	7.4.7.6	473,853.65	33,495.53
负债合计		3,421,955.80	59,989.74
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	91,005,599.27	11,802,231.41
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-4,966,186.45	347,632.07
净资产合计		86,039,412.82	12,149,863.48
负债和净资产总计		89,461,368.62	12,209,853.22

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 91,005,599.27 份。其中信澳量化多因子混合（LOF）A 基金份额净值 0.9757 元，A 基金份额总额 8,267,162.68 份；信澳量化多因子混合（LOF）C 基金份额净值 0.9424 元，C 基金份额总额 82,738,436.59 份。

7.2 利润表

会计主体：信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-15,195,049.21	-1,031,184.02
1. 利息收入		53,419.38	3,520.12
其中：存款利息收入	7.4.7.9	51,460.75	3,520.12
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,958.63	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-14,871,117.41	-734,925.68
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-15,802,364.47	-768,372.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,926.08	528.90
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	929,320.98	32,918.41
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-715,723.07	-301,116.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	338,371.89	1,337.71
减：二、营业总支出		2,028,505.20	96,487.31
1. 管理人报酬	7.4.10.2	1,153,391.18	61,054.17
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2	192,231.81	10,175.74
3. 销售服务费	7.4.10.2	537,054.23	3,718.36
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	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.17	145,827.98	21,539.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-17,223,554.41	-1,127,671.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-17,223,554.41	-1,127,671.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-17,223,554.41	-1,127,671.33

7.3 净资产变动表

会计主体：信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,802,231.41	347,632.07	12,149,863.48

二、本期期初净资产	11,802,231.41	347,632.07	12,149,863.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	79,203,367.86	-5,313,818.52	73,889,549.34
（一）、综合收益总额	-	-17,223,554.41	-17,223,554.41
（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）	79,203,367.86	11,909,735.89	91,113,103.75
其中：1.基金申购款	553,984,315.00	19,338,557.23	573,322,872.23
2.基金赎回款	-474,780,947.14	-7,428,821.34	-482,209,768.48
（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、本期期末净资产	91,005,599.27	-4,966,186.45	86,039,412.82
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,391,759.04	968,282.46	3,360,041.50
二、本期期初净资产	2,391,759.04	968,282.46	3,360,041.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,410,472.37	-620,650.39	8,789,821.98
（一）、综合收益总额	-	-1,127,671.33	-1,127,671.33
（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）	9,410,472.37	507,020.94	9,917,493.31
其中：1.基金申购款	20,951,655.04	1,368,916.52	22,320,571.56

2. 基金赎回款	-11,541,182.67	-861,895.58	-12,403,078.25
(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、本期期末净资产	11,802,231.41	347,632.07	12,149,863.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

朱永强

方敬

刘玉兰

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

信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(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[2019]第 503 号《关于准予信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2019)验字第 60467227_H05 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2019 年 11 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币 332,223,354.35 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 107,414.46 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 332,330,768.81 元,折合 332,330,768.81 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。2022 年 3 月 21 日,基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 06 月 01 日,本基金名称变更为“信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)”。

根据 2019 年 11 月 6 日生效的《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称"基金合同")及《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》(以下简称"招募说明书"),信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金的投资组合比例为:股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资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*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 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

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，所有公允价值变动计入当期损益。

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。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、红利再投资所引起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、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时,申购、转入、红利再投资或赎回、转出款项中包含的按累计未分配的已实现利得/(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、转入、红利再投资或赎回、转出基金份额时,申购、转入、红利再投资或赎回、转出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、转入、红利再投资确认日或基金赎回、转出确认日确认。

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) 对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债权投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外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的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1) 基金收取股利的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入企业；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致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确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(2) 本基金场外份额的收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；本基金场内份额的收益分配方式仅能为现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、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》的规定确定。

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 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

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。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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。

7.4.7 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	上年度末
	2023年12月31日	2022年12月31日
活期存款	9,254,683.13	5,486,639.05
等于：本金	9,253,846.04	5,486,468.53
加：应计利息	837.09	170.52
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	9,254,683.13	5,486,639.05

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	79,325,652.93	-	78,304,350.29	-1,021,302.64
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		79,325,652.93	-	78,304,350.29	-1,021,302.64
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		4,484,565.57	-	4,178,986.00	-305,579.57
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		4,484,565.57	-	4,178,986.00	-305,579.57

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 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	40.10	8.17
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	453,813.55	13,487.36
其中：交易所市场	453,813.55	13,487.36
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	20,000.00	20,000.00
合计	473,853.65	33,495.53

7.4.7.7 实收基金**信澳量化多因子混合（LOF）A**

金额单位：人民币元

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	4,492,095.31	4,492,095.31
本期申购	61,908,924.03	61,908,924.03
本期赎回（以“-”号填列）	-58,133,856.66	-58,133,856.66
本期末	8,267,162.68	8,267,162.68

信澳量化多因子混合（LOF）C

金额单位：人民币元

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	7,310,136.10	7,310,136.10
本期申购	492,075,390.97	492,075,390.97
本期赎回(以“-”号填列)	-416,647,090.48	-416,647,090.48
本期末	82,738,436.59	82,738,436.59

注：截至2023年12月31日止，信澳量化多因子混合(LOF)基金总份额为91,005,599.27份，其中，于深圳证券交易所上市的份额为1,209,428.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为89,796,171.27份。

7.4.7.8 未分配利润

信澳量化多因子混合(LOF) A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	922,722.09	-713,224.20	209,497.89
本期期初	922,722.09	-713,224.20	209,497.89
本期利润	-3,488,822.88	164,891.67	-3,323,931.21
本期基金份额交易产生的变动数	3,195,924.33	-282,209.98	2,913,714.35
其中：基金申购款	12,646,294.48	-8,132,796.87	4,513,497.61
基金赎回款	-9,450,370.15	7,850,586.89	-1,599,783.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	629,823.54	-830,542.51	-200,718.97

信澳量化多因子混合(LOF) C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,285,566.36	-1,147,432.18	138,134.18
本期期初	1,285,566.36	-1,147,432.18	138,134.18
本期利润	-13,019,008.46	-880,614.74	-13,899,623.20
本期基金份额交易产生的变动数	15,279,265.66	-6,283,244.12	8,996,021.54
其中：基金申购款	75,228,783.70	-60,403,724.08	14,825,059.62
基金赎回款	-59,949,518.04	54,120,479.96	-5,829,038.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,545,823.56	-8,311,291.04	-4,765,467.48

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日

活期存款利息收入	32,090.75	2,914.45
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	16,145.50	486.05
其他	3,224.50	119.62
合计	51,460.75	3,520.12

注：其他为直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.10 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1月1日至2022 年12月31日
卖出股票成交总额	952,361,082.98	41,162,268.20
减：卖出股票成本总额	965,823,753.28	41,820,876.45
减：交易费用	2,339,694.17	109,764.74
买卖股票差价收入	-15,802,364.47	-768,372.99

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	2.80	0.32
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,923.28	528.58
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,926.08	528.90

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	7,926.40	2,529.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	6,000.00	2,000.00
减：应计利息总额	2.80	0.32
减：交易费用	0.32	0.10
买卖债券差价收入	1,923.28	528.58

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.13 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1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	929,320.98	32,918.41
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	929,320.98	32,918.41

7.4.7.14 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1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-715,723.07	-301,116.17
——股票投资	-715,723.07	-301,116.17
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-

合计	-715,723.07	-301,116.17
----	-------------	-------------

7.4.7.15 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1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	338,371.89	1,337.71
合计	338,371.89	1,337.71

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产即为基金赎回费收入。

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

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1月1日至2022年12月31日
审计费用	20,000.00	20,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行结算费用	5,827.98	1,539.04
上市费	-	0.00
交易费用	-	0.00
合计	145,827.98	21,539.04

7.4.7.18 分部报告

截至本报告期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信达澳亚基金管理有限公司（“信达澳亚基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司（“信达证券”）	基金管理人的控股股东、基金代销机构
East Topco Limited	基金管理人的股东
信达新兴财富（北京）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20% 以上的股东

注：1、本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

2、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

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,153,391.18	61,054.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	160,672.60	12,569.89
应支付基金管理人的净管理费	992,718.58	48,484.28

注：（1）自 2023 年 9 月 20 日起，本基金管理费由 1.50% 调低到 1.20%。

（2）支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 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1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	192,231.81	10,175.74

注：（1）自2023年9月20日起，本基金托管费由0.25%调低到0.20%。

（2）支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C	合计
	中国银行股份有限公司	-	268.51
信达澳亚基金管理有限公司	-	128,931.17	128,931.17
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	129,199.68	129,199.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C	合计
	中国银行股份有限公司	0.00	306.86
信达澳亚基金管理有限公司	0.00	992.16	992.16
信达证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	-	1,299.02	1,299.02

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，本基金C类份额的年销售服务费率0.80%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给注册登记机构，再由注册登记机构计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日C类份额的基金资产净值×0.80%/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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

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		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日	
	信澳量化多因 子混合(LOF) A	信澳量化多因 子混合(LOF) C	信澳量化多因 子混合(LOF) A	信澳量化多因 子混合(LOF) C
期初持有的基金份额	1,823,396.73	-	-	-
期间申购/买入 总份额	-	-	1,823,396.73	-
期间因拆分变动 份额	-	-	-	-
减：期间赎回/ 卖出总份额	1,823,396.73	-	-	-
期末持有的基金 份额	-	-	1,823,396.73	-
期末持有的基金 份额占基金总份 额比例	-	-	15.45%	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本年度末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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1月1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
中国银行 股份有限 公司	9,254,683.13	32,090.75	5,486,639.05	2,914.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300096	易联众	2023-12-29	重大事项停牌	6.82	2024-01-02	5.46	3,900	26,936.30	26,598.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的股票投资和债券投资等。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的

银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，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。

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基

金持有的债券资产的公允价值。除本报告“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”章节中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外（如有），本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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	9,254,683.13	-	-	-	9,254,683.13
结算备付金	623,046.73	-	-	-	623,046.73
存出保证金	96,457.84	-	-	-	96,457.84
交易性金融资产	-	-	-	78,304,350.29	78,304,350.29
应收申购款	-	-	-	1,182,830.63	1,182,830.63
资产总计	9,974,187.70	-	-	79,487,180.92	89,461,368.62
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,786,044.16	2,786,044.16
应付管理人报酬	-	-	-	93,266.79	93,266.79
应付托管费	-	-	-	15,544.47	15,544.47
应付销售服务费	-	-	-	53,246.73	53,246.73
其他负债	-	-	-	473,853.65	473,853.65

负债总计	-	-	-	3,421,955.80	3,421,955.80
利率敏感度缺口	9,974,187.70	-	-	76,065,225.12	86,039,412.82
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	5,486,639.05	-	-	-	5,486,639.05
结算备付金	33,839.44	-	-	-	33,839.44
存出保证金	1,288.88	-	-	-	1,288.88
交易性金融资产	-	-	-	4,178,986.00	4,178,986.00
应收申购款	-	-	-	2,509,099.85	2,509,099.85
资产总计	5,521,767.37	-	-	6,688,085.85	12,209,853.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	17,417.46	17,417.46
应付管理人报酬	-	-	-	7,261.31	7,261.31
应付托管费	-	-	-	1,210.24	1,210.24
应付销售服务费	-	-	-	605.20	605.20
其他负债	-	-	-	33,495.53	33,495.53
负债总计	-	-	-	59,989.74	59,989.74
利率敏感度缺口	5,521,767.37	-	-	6,628,096.11	12,149,863.48

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本年度末，本基金持有的债券资产公允价值占基金资产净值的比例为0.00%，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行

跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	78,304,350.29	91.01	4,178,986.00	34.40
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	78,304,350.29	91.01	4,178,986.00	34.40

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	中证 500 指数上升 5%	3,791,105.12	9,959,211.93
中证 500 指数下降 5%	-3,791,105.12	-9,959,211.93	

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	78,277,752.29	4,178,986.00
第二层次	26,598.00	-
第三层次	-	-
合计	78,304,350.29	4,178,986.00

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、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的重要意义的输入所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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 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

本基金于本期初及上年度期初均未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金于本期及上年度可比期间亦均未发生第三层次公允价值转入转出情况。

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于2024年03月28日经本基金的基金管理人批准报出。

§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	78,304,350.29	87.53
	其中：股票	78,304,350.29	87.53
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	9,877,729.86	11.04
8	其他各项资产	1,279,288.47	1.43
9	合计	89,461,368.62	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	77,761.00	0.09
B	采矿业	1,484,689.00	1.73
C	制造业	51,667,612.13	60.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,259,215.80	2.63
E	建筑业	2,650,728.00	3.08
F	批发和零售业	4,148,430.00	4.82
G	交通运输、仓储和邮政业	1,094,481.00	1.27
H	住宿和餐饮业	251,482.00	0.29

I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,832,428.36	5.62
J	金融业	2,030,369.00	2.36
K	房地产业	1,880,554.00	2.19
L	租赁和商务服务业	1,277,455.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	895,038.00	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	1,888,080.00	2.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	79,982.00	0.09
Q	卫生和社会工作	145,632.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	1,640,413.00	1.91
S	综合	-	-
	合计	78,304,350.29	91.01

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002133	广宇集团	164,800	575,152.00	0.67
2	000612	焦作万方	99,000	569,250.00	0.66
3	300743	天地数码	40,800	566,304.00	0.66
4	600066	宇通客车	41,200	545,900.00	0.63
5	600655	豫园股份	83,900	521,019.00	0.61
6	601137	博威合金	32,500	504,725.00	0.59
7	601500	通用股份	121,500	503,010.00	0.58
8	000589	贵州轮胎	80,400	492,048.00	0.57
9	688589	力合微	12,242	488,578.22	0.57
10	002249	大洋电机	97,900	486,563.00	0.57
11	000823	超声电子	50,800	486,156.00	0.57
12	600362	江西铜业	27,200	485,792.00	0.56
13	600741	华域汽车	29,400	478,632.00	0.56
14	002788	鹭燕医药	53,200	478,268.00	0.56
15	603699	纽威股份	34,500	478,170.00	0.56
16	002048	宁波华翔	36,700	477,467.00	0.55
17	002004	华邦健康	102,200	476,252.00	0.55
18	600502	安徽建工	101,900	473,835.00	0.55
19	000338	潍柴动力	34,700	473,655.00	0.55
20	002462	嘉事堂	33,300	473,193.00	0.55
21	002382	蓝帆医疗	70,800	472,944.00	0.55

22	600104	上汽集团	34,900	472,197.00	0.55
23	600120	浙江东方	131,100	470,649.00	0.55
24	601688	华泰证券	33,700	470,115.00	0.55
25	600094	大名城	155,500	466,500.00	0.54
26	300724	捷佳伟创	6,300	466,263.00	0.54
27	002381	双箭股份	58,300	441,914.00	0.51
28	000415	渤海租赁	205,300	439,342.00	0.51
29	000090	天健集团	92,700	426,420.00	0.50
30	600529	山东药玻	16,600	424,960.00	0.49
31	688127	蓝特光学	17,571	409,228.59	0.48
32	000027	深圳能源	63,400	408,930.00	0.48
33	600737	中粮糖业	47,500	391,400.00	0.45
34	688556	高测股份	9,823	382,998.77	0.45
35	300719	安达维尔	28,100	374,573.00	0.44
36	002545	东方铁塔	52,100	372,515.00	0.43
37	002027	分众传媒	58,700	370,984.00	0.43
38	300102	乾照光电	50,400	370,440.00	0.43
39	300440	运达科技	49,600	369,520.00	0.43
40	603339	四方科技	30,700	365,023.00	0.42
41	000055	方大集团	79,900	361,148.00	0.42
42	600050	中国联通	82,200	360,036.00	0.42
43	601801	皖新传媒	51,800	360,010.00	0.42
44	600745	闻泰科技	8,500	359,635.00	0.42
45	300043	星辉娱乐	96,700	358,757.00	0.42
46	300872	天阳科技	26,200	358,416.00	0.42
47	002296	辉煌科技	43,400	358,050.00	0.42
48	600054	黄山旅游	32,800	356,864.00	0.41
49	002367	康力电梯	47,400	356,448.00	0.41
50	601766	中国中车	67,700	356,102.00	0.41
51	600284	浦东建设	56,400	355,320.00	0.41
52	300638	广和通	18,600	353,958.00	0.41
53	600894	广日股份	47,700	350,595.00	0.41
54	002394	联发股份	41,900	348,189.00	0.40
55	000517	荣安地产	142,100	348,145.00	0.40
56	000531	穗恒运 A	50,920	340,654.80	0.40
57	300543	朗科智能	30,500	333,060.00	0.39
58	300515	三德科技	28,100	324,274.00	0.38
59	688510	航亚科技	18,053	318,093.86	0.37
60	002998	优彩资源	39,700	315,615.00	0.37
61	688169	石头科技	1,103	312,093.85	0.36
62	002028	思源电气	5,800	301,832.00	0.35
63	300756	金马游乐	18,500	299,700.00	0.35
64	300771	智莱科技	27,500	298,925.00	0.35

65	300622	博士眼镜	15,000	297,450.00	0.35
66	601058	赛轮轮胎	25,200	296,100.00	0.34
67	002273	水晶光电	21,600	292,464.00	0.34
68	600969	郴电国际	44,500	289,250.00	0.34
69	300017	网宿科技	36,800	288,880.00	0.34
70	002056	横店东磁	21,300	288,402.00	0.34
71	300207	欣旺达	19,200	283,392.00	0.33
72	002138	顺络电子	10,400	280,904.00	0.33
73	688147	微导纳米	7,185	280,143.15	0.33
74	002739	万达电影	21,400	278,628.00	0.32
75	300389	艾比森	16,000	277,440.00	0.32
76	300866	安克创新	3,100	274,660.00	0.32
77	600873	梅花生物	28,600	273,130.00	0.32
78	301257	普蕊斯	4,300	273,050.00	0.32
79	600177	雅戈尔	41,500	271,825.00	0.32
80	601128	常熟银行	41,500	265,185.00	0.31
81	601231	环旭电子	17,400	262,914.00	0.31
82	600761	安徽合力	14,400	262,224.00	0.30
83	603897	长城科技	12,800	262,144.00	0.30
84	002557	洽洽食品	7,500	261,150.00	0.30
85	000830	鲁西化工	26,000	260,780.00	0.30
86	603228	景旺电子	11,500	259,440.00	0.30
87	600998	九州通	37,000	259,370.00	0.30
88	600704	物产中大	58,500	259,155.00	0.30
89	300558	贝达药业	5,000	257,750.00	0.30
90	600820	隧道股份	44,500	256,320.00	0.30
91	603611	诺力股份	13,500	255,555.00	0.30
92	600582	天地科技	46,900	255,136.00	0.30
93	002521	齐峰新材	30,700	253,889.00	0.30
94	603298	杭叉集团	10,200	253,776.00	0.29
95	002266	浙富控股	74,400	252,960.00	0.29
96	600258	首旅如家	16,100	251,482.00	0.29
97	002126	银轮股份	13,400	250,178.00	0.29
98	688036	传音控股	1,806	249,950.40	0.29
99	600941	中国移动	2,500	248,700.00	0.29
100	002601	龙佰集团	14,500	248,385.00	0.29
101	300843	胜蓝股份	10,800	248,184.00	0.29
102	605066	天正电气	27,000	247,860.00	0.29
103	601928	凤凰传媒	28,100	247,561.00	0.29
104	600801	华新水泥	19,900	247,357.00	0.29
105	300409	道氏技术	22,200	247,308.00	0.29
106	002745	木林森	28,500	246,810.00	0.29
107	300852	四会富仕	6,400	246,656.00	0.29

108	688676	金盘科技	6,861	245,829.63	0.29
109	603859	能科科技	6,500	245,245.00	0.29
110	601728	中国电信	45,200	244,532.00	0.28
111	603886	元祖股份	13,400	244,282.00	0.28
112	600219	南山铝业	83,000	244,020.00	0.28
113	688819	天能股份	8,737	243,937.04	0.28
114	601222	林洋能源	38,100	243,459.00	0.28
115	002815	崇达技术	25,400	243,332.00	0.28
116	000951	中国重汽	18,200	243,152.00	0.28
117	002991	甘源食品	3,400	242,964.00	0.28
118	002641	公元股份	48,300	242,949.00	0.28
119	600531	豫光金铅	40,100	242,605.00	0.28
120	603700	宁水集团	17,000	242,590.00	0.28
121	603197	保隆科技	4,300	242,520.00	0.28
122	603063	禾望电气	9,700	242,500.00	0.28
123	600959	江苏有线	77,200	242,408.00	0.28
124	601857	中国石油	34,300	242,158.00	0.28
125	300130	新国都	10,000	242,000.00	0.28
126	000426	兴业银锡	26,600	241,528.00	0.28
127	603093	南华期货	20,100	241,200.00	0.28
128	300019	硅宝科技	14,600	241,046.00	0.28
129	688332	中科蓝讯	3,196	241,042.32	0.28
130	603208	江山欧派	8,100	240,489.00	0.28
131	600409	三友化工	43,800	240,462.00	0.28
132	000333	美的集团	4,400	240,372.00	0.28
133	002421	达实智能	74,500	239,890.00	0.28
134	600183	生益科技	13,100	239,861.00	0.28
135	300355	蒙草生态	63,900	239,625.00	0.28
136	002483	润邦股份	45,900	239,598.00	0.28
137	601163	三角轮胎	16,600	239,206.00	0.28
138	000627	天茂集团	84,200	239,128.00	0.28
139	000869	张裕 A	9,900	238,986.00	0.28
140	002091	江苏国泰	30,500	238,815.00	0.28
141	000921	海信家电	11,700	238,680.00	0.28
142	002158	汉钟精机	10,700	238,182.00	0.28
143	603515	欧普照明	13,700	238,106.00	0.28
144	002701	奥瑞金	57,500	238,050.00	0.28
145	001914	招商积余	19,900	238,004.00	0.28
146	002225	濮耐股份	62,900	237,762.00	0.28
147	002376	新北洋	31,200	237,744.00	0.28
148	002563	森马服饰	41,200	237,724.00	0.28
149	603787	新日股份	19,000	237,690.00	0.28
150	002978	安宁股份	7,500	237,450.00	0.28

151	002891	中宠股份	9,000	237,150.00	0.28
152	000950	重药控股	47,700	237,069.00	0.28
153	003012	东鹏控股	28,700	236,775.00	0.28
154	000156	华数传媒	32,100	236,577.00	0.27
155	601952	苏垦农发	23,100	236,544.00	0.27
156	300856	科思股份	3,800	236,474.00	0.27
157	000990	诚志股份	28,800	236,448.00	0.27
158	603871	嘉友国际	14,900	236,314.00	0.27
159	000543	皖能电力	37,700	236,002.00	0.27
160	601021	春秋航空	4,700	235,940.00	0.27
161	600718	东软集团	25,500	235,875.00	0.27
162	600057	厦门象屿	35,100	235,521.00	0.27
163	600694	大商股份	13,900	234,771.00	0.27
164	600612	老凤祥	3,400	234,600.00	0.27
165	600332	白云山	8,200	234,520.00	0.27
166	600551	时代出版	21,500	234,135.00	0.27
167	603979	金诚信	6,200	234,112.00	0.27
168	600011	华能国际	30,400	234,080.00	0.27
169	600323	瀚蓝环境	13,500	233,955.00	0.27
170	002554	惠博普	74,700	233,811.00	0.27
171	601318	中国平安	5,800	233,740.00	0.27
172	000059	华锦股份	42,500	233,325.00	0.27
173	002270	华明装备	16,500	232,980.00	0.27
174	603590	康辰药业	6,100	232,288.00	0.27
175	002081	金螳螂	61,700	231,992.00	0.27
176	600826	兰生股份	26,200	231,608.00	0.27
177	600835	上海机电	19,500	231,465.00	0.27
178	600623	华谊集团	35,900	231,196.00	0.27
179	600548	深高速	25,600	230,144.00	0.27
180	601019	山东出版	24,400	228,872.00	0.27
181	600710	苏美达	32,200	228,298.00	0.27
182	605167	利柏特	23,200	220,168.00	0.26
183	301160	翔楼新材	4,900	206,927.00	0.24
184	002753	永东股份	24,400	201,300.00	0.23
185	601956	东贝集团	33,600	200,592.00	0.23
186	002159	三特索道	12,900	196,854.00	0.23
187	000528	柳工	27,300	184,002.00	0.21
188	688503	聚和材料	3,282	175,915.20	0.20
189	300816	艾可蓝	7,100	175,157.00	0.20
190	002743	富煌钢构	29,200	174,616.00	0.20
191	300084	海默科技	22,700	173,428.00	0.20
192	002384	东山精密	9,400	170,892.00	0.20
193	688329	艾隆科技	6,754	167,904.44	0.20

194	688188	柏楚电子	663	167,811.93	0.20
195	000100	TCL 科技	37,500	161,250.00	0.19
196	002078	太阳纸业	13,100	159,427.00	0.19
197	603688	石英股份	1,800	156,384.00	0.18
198	688772	珠海冠宇	6,897	151,802.97	0.18
199	600707	彩虹股份	22,400	151,200.00	0.18
200	601966	玲珑轮胎	7,800	149,994.00	0.17
201	301004	嘉益股份	3,300	149,985.00	0.17
202	002152	广电运通	12,200	149,572.00	0.17
203	300073	当升科技	3,900	148,980.00	0.17
204	001207	联科科技	8,600	146,630.00	0.17
205	688336	三生国健	6,429	144,716.79	0.17
206	300595	欧普康视	6,400	144,512.00	0.17
207	600153	建发股份	15,000	144,450.00	0.17
208	000513	丽珠集团	4,100	143,541.00	0.17
209	688002	睿创微纳	3,227	142,697.94	0.17
210	600481	双良节能	16,800	142,128.00	0.17
211	600498	烽火通信	8,500	141,440.00	0.16
212	601991	大唐发电	55,700	134,794.00	0.16
213	603885	吉祥航空	11,200	134,400.00	0.16
214	603866	桃李面包	17,400	133,284.00	0.15
215	600480	凌云股份	14,500	132,095.00	0.15
216	002749	国光股份	10,900	130,582.00	0.15
217	688276	百克生物	2,362	129,461.22	0.15
218	600312	平高电气	10,100	128,169.00	0.15
219	688303	大全能源	4,291	126,884.87	0.15
220	003019	宸展光电	5,600	126,560.00	0.15
221	002983	芯瑞达	4,100	126,526.00	0.15
222	688599	天合光能	4,433	126,473.49	0.15
223	603345	安井食品	1,200	125,532.00	0.15
224	603799	华友钴业	3,800	125,134.00	0.15
225	002938	鹏鼎控股	5,600	124,992.00	0.15
226	688386	泛亚微透	3,055	124,644.00	0.14
227	300618	寒锐钴业	4,400	124,476.00	0.14
228	300308	中际旭创	1,100	124,201.00	0.14
229	300433	蓝思科技	9,400	124,080.00	0.14
230	603328	依顿电子	15,200	123,880.00	0.14
231	688159	有方科技	3,284	123,642.60	0.14
232	300274	阳光电源	1,400	122,626.00	0.14
233	605288	凯迪股份	2,600	122,512.00	0.14
234	002282	博深股份	15,100	122,310.00	0.14
234	603681	永冠新材	8,100	122,310.00	0.14
236	600028	中国石化	21,900	122,202.00	0.14

237	603929	亚翔集成	5,100	121,992.00	0.14
238	002870	香山股份	3,400	121,958.00	0.14
239	002860	星帅尔	9,400	121,730.00	0.14
240	600577	精达股份	29,400	121,716.00	0.14
241	002649	博彦科技	9,900	121,473.00	0.14
242	603099	长白山	8,100	121,338.00	0.14
243	002984	森麒麟	4,200	121,170.00	0.14
244	601567	三星医疗	5,900	120,950.00	0.14
245	300739	明阳电路	7,900	120,949.00	0.14
246	000811	冰轮环境	8,900	120,773.00	0.14
247	002960	青鸟消防	8,700	120,408.00	0.14
248	601678	滨化股份	28,600	120,406.00	0.14
249	600496	精工钢构	39,400	120,170.00	0.14
250	002283	天润工业	20,500	119,925.00	0.14
251	300908	仲景食品	2,900	119,683.00	0.14
252	600487	亨通光电	10,000	119,400.00	0.14
253	600774	汉商集团	12,100	119,306.00	0.14
254	300349	金卡智能	9,600	119,232.00	0.14
254	600075	新疆天业	27,600	119,232.00	0.14
256	000910	大亚圣象	14,900	119,200.00	0.14
257	002918	蒙娜丽莎	8,800	119,152.00	0.14
258	000559	万向钱潮	22,900	118,851.00	0.14
259	000690	宝新能源	26,800	118,724.00	0.14
260	002392	北京利尔	31,400	118,692.00	0.14
261	002111	威海广泰	13,100	118,686.00	0.14
262	300015	爱尔眼科	7,500	118,650.00	0.14
263	000685	中山公用	16,200	118,422.00	0.14
264	300259	新天科技	32,600	118,338.00	0.14
265	601668	中国建筑	24,600	118,326.00	0.14
266	688578	艾力斯	2,838	118,231.08	0.14
267	002847	盐津铺子	1,700	118,116.00	0.14
267	601618	中国中冶	38,600	118,116.00	0.14
269	600578	京能电力	39,900	118,104.00	0.14
270	601789	宁波建工	28,500	117,990.00	0.14
271	000488	晨鸣纸业	30,400	117,952.00	0.14
272	603602	纵横通信	8,000	117,920.00	0.14
273	002061	浙江交科	32,300	117,895.00	0.14
274	002479	富春环保	24,700	117,819.00	0.14
275	600755	厦门国贸	16,900	117,793.00	0.14
276	601989	中国重工	28,500	117,705.00	0.14
277	300664	鹏鹞环保	22,000	117,700.00	0.14
278	688439	振华风光	1,320	117,625.20	0.14
279	603012	创力集团	19,900	117,609.00	0.14

280	000949	新乡化纤	36,400	117,572.00	0.14
281	600866	星湖科技	25,200	117,432.00	0.14
282	002062	宏润建设	26,500	117,395.00	0.14
283	002803	吉宏股份	5,700	117,192.00	0.14
284	601607	上海医药	7,000	117,110.00	0.14
285	002067	景兴纸业	34,500	116,955.00	0.14
286	002602	世纪华通	22,600	116,616.00	0.14
287	600308	华泰股份	33,700	116,602.00	0.14
288	600017	日照港	42,400	116,600.00	0.14
289	600512	腾达建设	47,000	116,560.00	0.14
290	603365	水星家纺	8,100	116,478.00	0.14
291	000850	华茂股份	30,500	116,205.00	0.14
292	600622	光大嘉宝	45,000	116,100.00	0.13
293	603992	松霖科技	6,400	116,096.00	0.13
294	600858	银座股份	21,800	115,976.00	0.13
295	600292	远达环保	19,100	115,937.00	0.13
296	600483	福能股份	14,000	115,780.00	0.13
297	002029	七匹狼	20,200	115,746.00	0.13
298	603113	金能科技	14,300	115,401.00	0.13
299	600611	大众交通	38,700	115,326.00	0.13
300	002648	卫星化学	7,800	115,050.00	0.13
301	002390	信邦制药	25,900	114,996.00	0.13
302	600675	中华企业	35,100	110,565.00	0.13
303	601319	中国人保	22,800	110,352.00	0.13
304	002555	三七互娱	5,700	107,217.00	0.12
305	600372	中航机载	7,600	100,168.00	0.12
306	002532	天山铝业	15,800	94,958.00	0.11
307	002705	新宝股份	6,100	88,877.00	0.10
308	300387	富邦股份	10,100	84,234.00	0.10
309	300884	狄耐克	6,200	81,096.00	0.09
310	300243	瑞丰高材	8,300	81,091.00	0.09
311	002817	黄山胶囊	9,200	80,592.00	0.09
312	300922	天秦装备	4,700	80,229.00	0.09
313	300645	正元智慧	4,400	80,036.00	0.09
314	300562	乐心医疗	7,000	79,870.00	0.09
315	603183	建研院	16,700	77,989.00	0.09
316	603214	爱婴室	4,700	76,892.00	0.09
317	002763	汇洁股份	9,100	76,531.00	0.09
318	688580	伟思医疗	907	57,984.51	0.07
319	688618	三旺通信	979	57,369.40	0.07
320	688663	新风光	2,025	56,781.00	0.07
321	603926	铁流股份	4,500	56,295.00	0.07
322	688217	睿昂基因	1,561	55,852.58	0.06

323	300787	海能实业	3,300	55,506.00	0.06
324	300625	三雄极光	3,700	54,834.00	0.06
325	605499	东鹏饮料	300	54,753.00	0.06
326	688330	宏力达	1,925	54,689.25	0.06
327	300860	锋尚文化	1,000	54,630.00	0.06
328	603102	百合股份	1,400	54,292.00	0.06
329	300594	朗进科技	2,600	54,288.00	0.06
330	300535	达威股份	3,100	54,281.00	0.06
331	300153	科泰电源	6,800	54,264.00	0.06
332	688288	鸿泉物联	2,276	54,077.76	0.06
333	603683	晶华新材	4,800	54,048.00	0.06
334	002360	同德化工	7,400	54,020.00	0.06
335	300611	美力科技	4,700	54,003.00	0.06
336	300018	中元股份	8,800	53,768.00	0.06
337	300889	爱克股份	3,200	53,760.00	0.06
338	300717	华信新材	3,200	53,728.00	0.06
339	300126	锐奇股份	7,500	53,625.00	0.06
340	688325	赛微微电	1,360	53,298.40	0.06
341	300640	德艺文创	8,300	53,286.00	0.06
342	002969	嘉美包装	12,900	53,148.00	0.06
343	002054	德美化工	7,800	53,040.00	0.06
344	300694	蠡湖股份	4,200	52,962.00	0.06
345	300642	透景生命	3,000	52,950.00	0.06
346	003003	天元股份	4,600	52,854.00	0.06
347	300818	耐普矿机	1,600	52,816.00	0.06
348	300230	永利股份	13,100	52,793.00	0.06
349	002734	利民股份	6,600	52,602.00	0.06
350	301063	海锅股份	2,300	52,440.00	0.06
351	301033	迈普医学	1,200	52,248.00	0.06
352	002628	成都路桥	15,800	52,140.00	0.06
353	300658	延江股份	7,700	52,129.00	0.06
354	600356	恒丰纸业	6,500	51,870.00	0.06
355	002798	帝欧家居	7,900	51,745.00	0.06
356	600511	国药股份	1,800	51,516.00	0.06
357	688004	博汇科技	1,753	51,485.61	0.06
358	300819	聚杰微纤	3,300	51,315.00	0.06
359	600051	宁波联合	7,100	51,262.00	0.06
360	688058	宝兰德	1,079	50,939.59	0.06
361	688533	上声电子	1,334	50,852.08	0.06
362	603368	柳药集团	2,400	45,408.00	0.05
363	603529	爱玛科技	1,800	45,072.00	0.05
364	603338	浙江鼎力	800	40,936.00	0.05
365	688581	安杰思	284	35,446.04	0.04

366	688366	昊海生科	323	34,977.67	0.04
367	300505	川金诺	2,000	33,500.00	0.04
368	301383	天键股份	500	32,500.00	0.04
369	301061	匠心家居	600	29,850.00	0.03
370	605056	咸亨国际	1,900	29,621.00	0.03
371	688226	威腾电气	1,574	29,591.20	0.03
372	300514	友讯达	1,800	29,340.00	0.03
373	301278	快可电子	500	29,125.00	0.03
374	688499	利元亨	764	29,093.12	0.03
375	688697	纽威数控	1,524	28,696.92	0.03
376	688678	福立旺	1,558	28,682.78	0.03
377	301195	北路智控	700	28,406.00	0.03
378	300407	凯发电气	3,000	28,320.00	0.03
379	002666	德联集团	5,200	28,080.00	0.03
379	301011	华立科技	1,200	28,080.00	0.03
381	002633	申科股份	2,400	28,056.00	0.03
382	603057	紫燕食品	1,300	28,054.00	0.03
383	300851	交大思诺	900	28,053.00	0.03
384	603937	丽岛新材	2,200	27,874.00	0.03
385	688227	品高股份	1,453	27,708.71	0.03
386	300998	宁波方正	1,200	27,696.00	0.03
387	300652	雷迪克	1,000	27,650.00	0.03
388	300582	英飞特	2,300	27,623.00	0.03
389	300894	火星人	1,700	27,608.00	0.03
390	301290	东星医疗	1,000	27,590.00	0.03
391	300281	金明精机	4,600	27,554.00	0.03
392	300963	中洲特材	2,100	27,552.00	0.03
393	003038	鑫铂股份	800	27,480.00	0.03
394	300753	爱朋医疗	1,600	27,472.00	0.03
395	301003	江苏博云	1,100	27,456.00	0.03
396	001323	慕思股份	900	27,450.00	0.03
397	300283	温州宏丰	4,300	27,348.00	0.03
398	600455	博通股份	1,100	27,335.00	0.03
399	300412	迦南科技	4,800	27,312.00	0.03
400	300411	金盾股份	3,900	27,261.00	0.03
401	300981	中红医疗	1,700	27,234.00	0.03
402	300155	安居宝	4,600	27,232.00	0.03
403	301149	隆华新材	2,200	27,214.00	0.03
404	300563	神宇股份	1,700	27,183.00	0.03
405	300626	华瑞股份	2,500	27,125.00	0.03
406	300689	澄天伟业	1,400	27,118.00	0.03
407	688090	瑞松科技	835	27,045.65	0.03
408	605098	行动教育	700	26,985.00	0.03

409	301103	何氏眼科	900	26,982.00	0.03
410	300644	南京聚隆	1,300	26,975.00	0.03
411	301002	崧盛股份	1,300	26,962.00	0.03
412	605196	华通线缆	3,500	26,950.00	0.03
413	300605	恒锋信息	1,800	26,946.00	0.03
414	603041	美思德	2,000	26,920.00	0.03
414	300564	筑博设计	2,000	26,920.00	0.03
416	002835	同为股份	1,500	26,910.00	0.03
417	003000	劲仔食品	2,200	26,884.00	0.03
418	300040	九洲集团	4,800	26,880.00	0.03
418	300616	尚品宅配	1,500	26,880.00	0.03
420	605337	李子园	1,900	26,771.00	0.03
421	603725	天安新材	2,400	26,712.00	0.03
422	002823	凯中精密	2,100	26,670.00	0.03
423	002084	海鸥住工	6,700	26,666.00	0.03
424	603080	新疆火炬	1,600	26,656.00	0.03
425	300976	达瑞电子	500	26,615.00	0.03
426	301150	中一科技	800	26,608.00	0.03
427	605208	永茂泰	2,800	26,600.00	0.03
427	301229	纽泰格	800	26,600.00	0.03
429	300096	易联众	3,900	26,598.00	0.03
430	300306	远方信息	2,200	26,576.00	0.03
431	000880	潍柴重机	2,500	26,575.00	0.03
432	002105	信隆健康	4,100	26,568.00	0.03
433	002949	华阳国际	1,900	26,543.00	0.03
434	300810	中科海讯	1,300	26,520.00	0.03
435	002899	英派斯	1,600	26,480.00	0.03
436	002593	日上集团	6,600	26,466.00	0.03
437	300289	利德曼	4,300	26,445.00	0.03
438	301019	宁波色母	1,100	26,433.00	0.03
439	300621	维业股份	2,300	26,427.00	0.03
440	002278	神开股份	4,500	26,415.00	0.03
441	001215	千味央厨	500	26,405.00	0.03
442	603332	苏州龙杰	2,300	26,358.00	0.03
443	605255	天普股份	1,500	26,325.00	0.03
444	002616	长青集团	5,000	26,250.00	0.03
445	301339	通行宝	1,300	26,234.00	0.03
446	688619	罗普特	1,865	26,221.90	0.03
447	300511	雪榕生物	4,900	26,215.00	0.03
448	603331	百达精工	2,000	26,200.00	0.03
449	688191	智洋创新	1,414	26,159.00	0.03
450	603238	诺邦股份	1,900	26,125.00	0.03
451	605001	威奥股份	3,900	26,091.00	0.03

452	603506	南都物业	2,400	26,088.00	0.03
453	688317	之江生物	1,243	26,078.14	0.03
454	603900	莱绅通灵	3,900	26,052.00	0.03
455	301301	川宁生物	3,100	26,040.00	0.03
455	000430	张家界	4,000	26,040.00	0.03
457	300254	仟源医药	2,700	26,001.00	0.03
458	002551	尚荣医疗	6,400	25,984.00	0.03
459	300970	华绿生物	1,500	25,890.00	0.03
460	002492	恒基达鑫	4,300	25,757.00	0.03
461	605318	法狮龙	1,600	25,712.00	0.03
462	300192	科德教育	2,600	25,662.00	0.03
463	600097	开创国际	2,400	25,656.00	0.03
464	300022	吉峰科技	5,200	25,636.00	0.03
465	603269	海鸥股份	1,900	25,593.00	0.03
466	300030	阳普医疗	3,300	25,575.00	0.03
467	600493	凤竹纺织	3,800	25,536.00	0.03
468	300508	维宏股份	900	25,470.00	0.03
469	688393	安必平	1,019	25,444.43	0.03
470	300103	达刚控股	4,000	25,400.00	0.03
471	688489	三未信安	540	25,390.80	0.03
472	300845	捷安高科	1,400	25,298.00	0.03
473	300546	雄帝科技	1,600	25,232.00	0.03
474	300938	信测标准	700	25,123.00	0.03
475	688486	龙迅股份	207	24,585.39	0.03
476	601615	明阳智能	1,400	17,556.00	0.02
477	603079	圣达生物	1,000	14,570.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000997	新大陆	7,803,864.00	64.23
2	603871	嘉友国际	7,786,970.60	64.09
3	300384	三联虹普	6,746,546.00	55.53
4	002683	广东宏大	6,570,924.00	54.08
5	600060	海信视像	6,311,289.00	51.95
6	300724	捷佳伟创	6,181,351.00	50.88
7	601618	中国中冶	5,447,124.00	44.83
8	002600	领益智造	5,438,411.00	44.76
9	688390	固德威	5,357,071.68	44.09
10	603093	南华期货	5,235,890.00	43.09

11	300389	艾比森	5,229,795.00	43.04
12	300779	惠城环保	5,227,706.00	43.03
13	603368	柳药集团	5,174,550.00	42.59
14	300811	铂科新材	5,169,994.60	42.55
15	002223	鱼跃医疗	5,162,404.00	42.49
16	001914	招商积余	5,091,291.00	41.90
17	688002	睿创微纳	5,058,588.67	41.63
18	002966	苏州银行	4,926,333.00	40.55
19	300622	博士眼镜	4,889,739.00	40.25
20	600612	老凤祥	4,870,935.53	40.09
21	300130	新国都	4,743,340.00	39.04
22	600066	宇通客车	4,739,752.00	39.01
23	300634	彩讯股份	4,709,747.88	38.76
24	002384	东山精密	4,703,853.00	38.72
25	002448	中原内配	4,683,748.00	38.55
26	000055	方大集团	4,680,977.56	38.53
27	603605	珀莱雅	4,637,840.88	38.17
28	601128	常熟银行	4,612,737.00	37.97
29	688019	安集科技	4,588,048.82	37.76
30	002998	优彩资源	4,583,692.00	37.73
31	601567	三星医疗	4,547,992.00	37.43
32	600489	中金黄金	4,476,578.00	36.84
33	002518	科士达	4,458,991.00	36.70
34	600129	太极集团	4,444,396.00	36.58
35	002772	众兴菌业	4,336,545.00	35.69
36	002056	横店东磁	4,331,121.00	35.65
37	603688	石英股份	4,312,910.00	35.50
38	600655	豫园股份	4,300,247.00	35.39
39	605599	菜百股份	4,281,201.00	35.24
40	603129	春风动力	4,279,111.00	35.22
41	300592	华凯易佰	4,260,918.00	35.07
42	688589	力合微	4,226,943.69	34.79
43	600094	大名城	4,185,695.00	34.45
44	000014	沙河股份	4,179,747.00	34.40
45	300697	电工合金	4,176,968.00	34.38
46	600985	淮北矿业	4,109,837.00	33.83
47	300795	米奥会展	4,064,563.00	33.45
48	600570	恒生电子	4,032,198.00	33.19
49	601318	中国平安	4,003,052.00	32.95
50	601336	新华保险	3,948,732.00	32.50
51	002937	兴瑞科技	3,931,854.00	32.36
52	600926	杭州银行	3,915,105.00	32.22
53	301030	仕净科技	3,901,743.00	32.11

54	600480	凌云股份	3,901,534.00	32.11
55	300839	博汇股份	3,889,152.20	32.01
56	002458	益生股份	3,795,390.00	31.24
57	600761	安徽合力	3,780,023.00	31.11
58	603883	老百姓	3,746,211.00	30.83
59	300896	爱美客	3,745,560.00	30.83
60	603298	杭叉集团	3,733,647.00	30.73
61	688219	会通股份	3,731,979.30	30.72
62	688510	航亚科技	3,689,965.24	30.37
63	600438	通威股份	3,677,199.00	30.27
64	600971	恒源煤电	3,640,738.00	29.97
65	002478	常宝股份	3,640,663.00	29.96
66	002422	科伦药业	3,630,238.00	29.88
67	601137	博威合金	3,622,143.00	29.81
68	002981	朝阳科技	3,605,596.00	29.68
69	605158	华达新材	3,597,926.40	29.61
70	601801	皖新传媒	3,578,771.00	29.46
71	300856	科思股份	3,565,657.00	29.35
72	300232	洲明科技	3,557,122.00	29.28
73	603233	大参林	3,554,205.00	29.25
74	600858	银座股份	3,553,008.00	29.24
75	600583	海油工程	3,550,319.00	29.22
76	002233	塔牌集团	3,519,495.00	28.97
77	600362	江西铜业	3,509,325.00	28.88
78	003017	大洋生物	3,476,247.00	28.61
79	688186	广大特材	3,436,253.02	28.28
80	000811	冰轮环境	3,427,759.00	28.21
81	301160	翔楼新材	3,427,031.00	28.21
82	301039	中集车辆	3,409,957.00	28.07
83	002991	甘源食品	3,403,586.00	28.01
84	600508	上海能源	3,394,363.00	27.94
85	688639	华恒生物	3,389,960.67	27.90
86	688036	传音控股	3,371,253.38	27.75
87	002244	滨江集团	3,358,419.00	27.64
88	300545	联得装备	3,347,651.00	27.55
89	600572	康恩贝	3,342,322.00	27.51
90	603859	能科科技	3,336,679.00	27.46
91	688722	同益中	3,330,140.56	27.41
92	003006	百亚股份	3,314,830.00	27.28
93	301367	怡和嘉业	3,267,618.00	26.89
94	600011	华能国际	3,256,447.00	26.80
95	300511	雪榕生物	3,253,113.00	26.77
96	600035	楚天高速	3,237,972.00	26.65

97	600826	兰生股份	3,234,205.03	26.62
98	600211	西藏药业	3,210,991.00	26.43
99	603689	皖天然气	3,195,669.00	26.30
100	002025	航天电器	3,191,576.00	26.27
101	003011	海象新材	3,185,382.00	26.22
102	000783	长江证券	3,171,533.00	26.10
103	688120	华海清科	3,159,569.70	26.00
104	300796	贝斯美	3,149,445.40	25.92
105	603071	物产环能	3,142,327.00	25.86
106	603529	爱玛科技	3,138,628.00	25.83
107	000333	美的集团	3,112,359.00	25.62
108	603345	安井食品	3,112,127.00	25.61
109	002053	云南能投	3,108,071.00	25.58
110	002605	姚记科技	3,104,480.00	25.55
111	603328	依顿电子	3,097,706.00	25.50
112	603309	维力医疗	3,084,444.00	25.39
113	688556	高测股份	3,083,478.03	25.38
114	300532	今天国际	3,071,701.00	25.28
115	000028	国药一致	3,071,044.00	25.28
116	603611	诺力股份	3,051,031.00	25.11
117	002749	国光股份	3,037,732.00	25.00
118	002381	双箭股份	3,029,409.00	24.93
119	688551	科威尔	3,023,810.41	24.89
120	601319	中国人保	3,002,618.00	24.71
121	300308	中际旭创	2,998,720.00	24.68
122	300693	盛弘股份	2,985,118.00	24.57
123	600459	贵研铂业	2,956,427.00	24.33
124	688410	山外山	2,951,509.00	24.29
125	605167	利柏特	2,937,985.00	24.18
126	688599	天合光能	2,925,916.27	24.08
127	300743	天地数码	2,912,325.00	23.97
128	603699	纽威股份	2,902,958.00	23.89
129	000921	海信家电	2,902,144.00	23.89
130	601601	中国太保	2,894,464.00	23.82
131	000589	贵州轮胎	2,871,801.60	23.64
132	300740	水羊股份	2,834,648.00	23.33
133	688398	赛特新材	2,829,489.63	23.29
134	002852	道道全	2,824,381.00	23.25
135	000906	浙商中拓	2,811,744.00	23.14
136	300908	仲景食品	2,802,852.00	23.07
137	603619	中曼石油	2,789,721.00	22.96
138	600512	腾达建设	2,789,022.00	22.96
139	603283	赛腾股份	2,757,266.82	22.69

140	600039	四川路桥	2,753,780.20	22.67
141	002270	华明装备	2,720,817.00	22.39
142	688147	微导纳米	2,682,265.23	22.08
143	300970	华绿生物	2,679,437.00	22.05
144	002138	顺络电子	2,657,165.00	21.87
145	300206	理邦仪器	2,623,713.00	21.59
146	601163	三角轮胎	2,596,402.00	21.37
147	600566	济川药业	2,584,171.00	21.27
148	688106	金宏气体	2,573,665.06	21.18
149	000528	柳工	2,564,031.00	21.10
150	601086	国芳集团	2,558,142.00	21.05
151	002860	星帅尔	2,516,369.00	20.71
152	002028	思源电气	2,512,394.00	20.68
153	688188	柏楚电子	2,507,231.50	20.64
154	300316	晶盛机电	2,505,969.00	20.63
155	002158	汉钟精机	2,504,921.00	20.62
156	002847	盐津铺子	2,488,931.00	20.49
157	601717	郑煤机	2,487,480.00	20.47
158	002727	一心堂	2,476,649.00	20.38
159	688012	中微公司	2,463,606.21	20.28
160	605499	东鹏饮料	2,449,370.00	20.16
161	601058	赛轮轮胎	2,439,627.00	20.08
162	688772	珠海冠宇	2,438,571.29	20.07
163	000521	长虹美菱	2,431,532.00	20.01
164	002891	中宠股份	2,419,288.00	19.91
165	000623	吉林敖东	2,389,345.40	19.67
166	002273	水晶光电	2,379,046.00	19.58
167	688072	拓荆科技	2,375,511.94	19.55
168	300017	网宿科技	2,369,550.00	19.50
169	603063	禾望电气	2,365,630.00	19.47
170	603161	科华控股	2,365,531.00	19.47
171	001979	招商蛇口	2,364,978.00	19.47
172	002732	燕塘乳业	2,360,617.00	19.43
173	600325	华发股份	2,352,712.20	19.36
174	000786	北新建材	2,350,441.00	19.35
175	603979	金诚信	2,349,419.00	19.34
176	603339	四方科技	2,346,058.00	19.31
177	601958	金钼股份	2,345,491.00	19.30
178	300827	上能电气	2,337,395.00	19.24
179	000338	潍柴动力	2,326,779.00	19.15
180	000596	古井贡酒	2,323,922.00	19.13
181	688676	金盘科技	2,321,597.55	19.11
182	601728	中国电信	2,304,517.00	18.97

183	301257	普蕊斯	2,297,483.00	18.91
184	300487	蓝晓科技	2,285,051.00	18.81
185	300274	阳光电源	2,243,711.00	18.47
186	002299	圣农发展	2,237,293.00	18.41
187	300881	盛德鑫泰	2,234,002.00	18.39
188	300866	安克创新	2,231,207.00	18.36
189	002917	金奥博	2,216,472.00	18.24
190	300842	帝科股份	2,209,133.00	18.18
191	600048	保利发展	2,205,669.84	18.15
192	600284	浦东建设	2,198,819.00	18.10
193	002594	比亚迪	2,182,845.00	17.97
194	000058	深赛格	2,164,630.00	17.82
195	603929	亚翔集成	2,163,513.00	17.81
196	688239	航宇科技	2,156,101.60	17.75
197	688029	南微医学	2,153,071.40	17.72
198	300857	协创数据	2,139,923.00	17.61
199	688278	特宝生物	2,139,896.88	17.61
200	000878	云南铜业	2,119,400.00	17.44
201	605300	佳禾食品	2,104,884.00	17.32
202	002737	葵花药业	2,041,299.00	16.80
203	002335	科华数据	2,037,614.00	16.77
204	002959	小熊电器	2,032,875.00	16.73
205	600633	浙数文化	2,027,252.00	16.69
206	600502	安徽建工	2,003,740.00	16.49
207	301256	华融化学	1,994,574.00	16.42
208	603100	川仪股份	1,989,552.00	16.38
209	002459	晶澳科技	1,977,554.00	16.28
210	688111	金山办公	1,976,666.97	16.27
211	002466	天齐锂业	1,961,310.00	16.14
212	603225	新凤鸣	1,942,652.00	15.99
213	003012	东鹏控股	1,941,994.00	15.98
214	002367	康力电梯	1,936,182.00	15.94
215	002017	东信和平	1,923,266.20	15.83
216	603708	家家悦	1,918,883.00	15.79
217	002085	万丰奥威	1,908,507.00	15.71
218	601918	新集能源	1,901,819.00	15.65
219	000417	合肥百货	1,884,484.00	15.51
220	688617	惠泰医疗	1,878,408.05	15.46
221	002371	北方华创	1,855,584.00	15.27
222	688126	沪硅产业	1,827,908.32	15.04
223	300019	硅宝科技	1,825,838.00	15.03
224	000526	学大教育	1,804,466.00	14.85
225	603556	海兴电力	1,803,902.00	14.85

226	002739	万达电影	1,774,456.00	14.60
227	002568	百润股份	1,764,203.00	14.52
228	605066	天正电气	1,705,005.00	14.03
229	688329	艾隆科技	1,669,609.11	13.74
230	603757	大元泵业	1,654,990.00	13.62
231	002918	蒙娜丽莎	1,645,040.00	13.54
232	000517	荣安地产	1,641,423.00	13.51
233	601688	华泰证券	1,604,794.00	13.21
234	000423	东阿阿胶	1,598,945.00	13.16
235	601628	中国人寿	1,581,348.00	13.02
236	002952	亚世光电	1,563,103.00	12.87
237	605117	德业股份	1,527,371.00	12.57
238	688630	芯碁微装	1,518,462.24	12.50
239	600803	新奥股份	1,512,719.00	12.45
240	600535	天士力	1,503,063.00	12.37
241	688625	呈和科技	1,484,483.01	12.22
242	600153	建发股份	1,484,372.00	12.22
243	688063	派能科技	1,479,376.46	12.18
244	603586	金麒麟	1,447,732.00	11.92
245	688080	映翰通	1,429,451.97	11.77
246	002521	齐峰新材	1,417,727.00	11.67
247	603215	比依股份	1,412,654.00	11.63
248	002484	江海股份	1,357,394.00	11.17
249	300452	山河药辅	1,353,963.00	11.14
250	603519	立霸股份	1,351,360.00	11.12
251	300884	狄耐克	1,348,116.00	11.10
252	605287	德才股份	1,342,608.60	11.05
253	688711	宏微科技	1,330,398.59	10.95
254	301076	新瀚新材	1,325,225.00	10.91
255	603516	淳中科技	1,313,870.00	10.81
256	300041	回天新材	1,312,099.00	10.80
257	603878	武进不锈	1,278,462.00	10.52
258	002983	芯瑞达	1,275,697.00	10.50
259	688669	聚石化学	1,265,399.96	10.41
260	688475	萤石网络	1,239,490.53	10.20
261	003019	宸展光电	1,238,560.10	10.19
262	600760	中航沈飞	1,193,033.00	9.82
263	300777	中简科技	1,190,641.54	9.80
264	000951	中国重汽	1,172,473.00	9.65
265	600409	三友化工	1,163,050.00	9.57
266	300638	广和通	1,159,608.00	9.54
267	000612	焦作万方	1,149,797.00	9.46
268	603518	锦泓集团	1,138,057.00	9.37

269	000426	兴业银锡	1,133,135.00	9.33
270	000548	湖南投资	1,133,052.00	9.33
271	688311	盟升电子	1,128,810.09	9.29
272	603103	横店影视	1,128,644.00	9.29
273	600820	隧道股份	1,124,259.00	9.25
274	600737	中粮糖业	1,116,935.00	9.19
275	300349	金卡智能	1,115,483.00	9.18
276	002154	报喜鸟	1,105,766.00	9.10
277	603012	创力集团	1,099,171.00	9.05
278	000937	冀中能源	1,095,472.00	9.02
279	300594	朗进科技	1,093,002.00	9.00
280	600755	厦门国贸	1,090,981.00	8.98
281	600582	天地科技	1,086,360.00	8.94
282	603099	长白山	1,075,680.00	8.85
283	300840	酷特智能	1,068,064.00	8.79
284	002674	兴业科技	1,067,036.00	8.78
285	301051	信濠光电	1,065,861.00	8.77
286	001218	丽臣实业	1,064,771.80	8.76
287	002249	大洋电机	1,062,469.00	8.74
288	603040	新坐标	1,062,304.00	8.74
289	600054	黄山旅游	1,061,535.00	8.74
290	002462	嘉事堂	1,059,021.00	8.72
291	002004	华邦健康	1,051,861.00	8.66
292	300119	瑞普生物	1,051,220.00	8.65
293	300717	华信新材	1,044,221.00	8.59
294	002360	同德化工	1,043,989.00	8.59
295	002126	银轮股份	1,026,881.00	8.45
296	600729	重庆百货	1,019,333.00	8.39
297	603338	浙江鼎力	999,805.00	8.23
298	688138	清溢光电	993,918.42	8.18
299	300729	乐歌股份	993,379.00	8.18
300	600784	鲁银投资	979,333.00	8.06
301	601500	通用股份	969,984.00	7.98
302	002774	快意电梯	961,252.00	7.91
303	301004	嘉益股份	960,476.00	7.91
304	688626	翔宇医疗	957,018.76	7.88
305	002133	广宇集团	956,224.00	7.87
306	002048	宁波华翔	949,234.00	7.81
307	603725	天安新材	946,500.00	7.79
308	688050	爱博医疗	935,271.72	7.70
309	000027	深圳能源	929,473.00	7.65
310	600718	东软集团	906,025.00	7.46
311	000823	超声电子	896,469.00	7.38

312	301087	可孚医疗	876,963.00	7.22
313	600710	苏美达	858,591.00	7.07
314	603214	爱婴室	858,576.00	7.07
315	688212	澳华内镜	858,276.10	7.06
316	601702	华峰铝业	856,476.00	7.05
317	300543	朗科智能	848,577.00	6.98
318	300462	华铭智能	845,732.00	6.96
319	000560	我爱我家	842,395.00	6.93
320	688439	振华风光	842,176.50	6.93
321	600323	瀚蓝环境	839,315.00	6.91
322	605077	华康股份	838,863.00	6.90
323	002179	中航光电	829,710.00	6.83
324	603199	九华旅游	826,573.00	6.80
325	603167	渤海轮渡	822,601.00	6.77
326	600941	中国移动	819,711.00	6.75
327	603365	水星家纺	805,390.00	6.63
328	688628	优利德	804,233.27	6.62
329	300731	科创新源	800,668.00	6.59
330	000100	TCL 科技	799,486.00	6.58
331	603360	百傲化学	798,711.00	6.57
332	600177	雅戈尔	797,484.00	6.56
333	000415	渤海租赁	796,610.00	6.56
334	600551	时代出版	790,181.00	6.50
335	300283	温州宏丰	789,141.00	6.50
336	002641	公元股份	787,845.00	6.48
337	603551	奥普家居	787,036.00	6.48
338	603950	长源东谷	778,227.00	6.41
339	688127	蓝特光学	777,511.08	6.40
340	601231	环旭电子	777,475.00	6.40
341	600050	中国联通	775,602.00	6.38
342	300558	贝达药业	774,653.00	6.38
343	300644	南京聚隆	774,628.00	6.38
344	600051	宁波联合	774,205.00	6.37
345	600026	中远海能	769,050.00	6.33
346	300102	乾照光电	755,924.00	6.22
347	600774	汉商集团	755,180.00	6.22
348	603787	新日股份	752,784.00	6.20
349	600704	物产中大	750,142.00	6.17
350	300185	通裕重工	749,128.00	6.17
351	600104	上汽集团	743,885.00	6.12
352	603661	恒林股份	737,650.00	6.07
353	300043	星辉娱乐	737,476.00	6.07
354	000543	皖能电力	735,765.00	6.06

355	002540	亚太科技	731,077.00	6.02
356	300515	三德科技	729,814.00	6.01
357	600741	华域汽车	729,059.00	6.00
358	000156	华数传媒	728,338.00	5.99
359	002893	京能热力	727,596.00	5.99
360	603179	新泉股份	726,060.00	5.98
361	300440	运达科技	722,570.00	5.95
362	600312	平高电气	722,037.00	5.94
363	603278	大业股份	720,970.00	5.93
364	002443	金洲管道	708,754.00	5.83
365	000856	冀东装备	705,834.00	5.81
366	300910	瑞丰新材	704,053.60	5.79
367	301391	卡莱特	703,963.00	5.79
368	300694	蠡湖股份	700,908.00	5.77
369	601956	东贝集团	698,229.00	5.75
370	000026	飞亚达	697,953.00	5.74
371	301185	鸥玛软件	697,667.00	5.74
372	002743	富煌钢构	694,330.00	5.71
373	000531	穗恒运 A	689,505.40	5.68
374	002215	诺普信	688,505.00	5.67
375	603567	珍宝岛	687,357.00	5.66
376	688013	天臣医疗	687,018.52	5.65
377	600057	厦门象屿	685,909.00	5.65
378	600968	海油发展	685,503.00	5.64
379	601952	苏垦农发	683,369.00	5.62
380	688169	石头科技	680,356.91	5.60
381	002997	瑞鹄模具	675,484.00	5.56
382	603939	益丰药房	673,722.60	5.55
383	600529	山东药玻	663,345.00	5.46
384	002788	鹭燕医药	659,433.00	5.43
385	688569	铁科轨道	648,487.64	5.34
386	600419	天润乳业	641,361.00	5.28
387	000090	天健集团	641,166.00	5.28
388	688578	艾力斯	640,970.05	5.28
389	000990	诚志股份	639,075.00	5.26
390	002746	仙坛股份	638,139.00	5.25
391	688332	中科蓝讯	635,477.47	5.23
392	603778	国晟科技	630,623.00	5.19
393	300833	浩洋股份	630,040.00	5.19
394	603602	纵横通信	629,924.00	5.18
395	600894	广日股份	625,510.00	5.15
396	600694	大商股份	625,179.00	5.15
397	601766	中国中车	624,687.00	5.14

398	603969	银龙股份	624,095.00	5.14
399	002170	芭田股份	620,077.00	5.10
400	600873	梅花生物	609,848.00	5.02
401	605123	派克新材	598,952.00	4.93
402	600120	浙江东方	597,446.00	4.92
403	601607	上海医药	584,979.00	4.81
404	002382	蓝帆医疗	583,321.00	4.80
405	601857	中国石油	582,557.00	4.79
406	688777	中控技术	582,240.70	4.79
407	002554	惠博普	578,972.00	4.77
408	002106	莱宝高科	578,849.00	4.76
409	688033	天宜上佳	575,438.53	4.74
410	002296	辉煌科技	572,403.00	4.71
411	600727	鲁北化工	569,231.00	4.69
412	601668	中国建筑	566,527.00	4.66
413	600455	博通股份	563,787.00	4.64
414	002595	豪迈科技	560,948.00	4.62
415	002345	潮宏基	557,323.00	4.59
416	601101	昊华能源	556,004.00	4.58
417	002919	名臣健康	552,627.00	4.55
418	000973	佛塑科技	549,251.00	4.52
419	002351	漫步者	540,827.00	4.45
420	603639	海利尔	536,530.00	4.42
421	600959	江苏有线	536,119.00	4.41
422	002161	远望谷	534,679.00	4.40
423	688009	中国通号	533,299.46	4.39
424	300872	天阳科技	531,356.00	4.37
425	600230	沧州大化	529,091.00	4.35
426	002563	森马服饰	527,932.00	4.35
427	600531	豫光金铅	522,633.00	4.30
428	605086	龙高股份	517,466.00	4.26
429	300396	迪瑞医疗	513,674.00	4.23
430	688268	华特气体	509,404.65	4.19
431	603700	宁水集团	509,333.00	4.19
432	002545	东方铁塔	509,043.00	4.19
433	603058	永吉股份	507,924.00	4.18
434	603321	梅轮电梯	502,518.00	4.14
435	603102	百合股份	501,607.00	4.13
436	002899	英派斯	498,535.00	4.10
437	300756	金马游乐	493,831.00	4.06
438	002373	千方科技	493,275.00	4.06
439	000030	富奥股份	492,421.00	4.05
440	002753	永东股份	490,219.00	4.03

441	300787	海能实业	486,970.00	4.01
442	300243	瑞丰高材	484,295.00	3.99
443	603600	永艺股份	484,048.00	3.98
444	600835	上海机电	482,489.00	3.97
445	600386	北巴传媒	481,967.00	3.97
446	300719	安达维尔	476,552.00	3.92
447	601021	春秋航空	476,360.00	3.92
448	603885	吉祥航空	475,234.00	3.91
449	300355	蒙草生态	474,005.00	3.90
450	002614	奥佳华	473,117.00	3.89
451	002745	木林森	472,897.00	3.89
452	600745	闻泰科技	468,000.00	3.85
453	600697	欧亚集团	466,212.00	3.84
454	000559	万向钱潮	464,520.00	3.82
455	002394	联发股份	463,521.00	3.82
456	002938	鹏鼎控股	453,874.00	3.74
457	002697	红旗连锁	452,968.00	3.73
458	300409	道氏技术	449,259.00	3.70
459	300739	明阳电路	448,369.00	3.69
460	688336	三生国健	444,489.10	3.66
461	002091	江苏国泰	440,399.00	3.62
462	601966	玲珑轮胎	439,090.00	3.61
463	000672	上峰水泥	433,758.00	3.57
464	000887	中鼎股份	432,657.00	3.56
465	002332	仙琚制药	432,386.00	3.56
466	600801	华新水泥	431,363.00	3.55
467	600258	首旅酒店	427,697.00	3.52
468	603208	江山欧派	425,208.00	3.50
469	603228	景旺电子	423,613.00	3.49
470	000627	天茂集团	423,079.00	3.48
471	603897	长城科技	422,329.00	3.48
472	002984	森麒麟	421,253.00	3.47
473	300394	天孚通信	420,762.00	3.46
474	002078	太阳纸业	419,129.00	3.45
475	000513	丽珠集团	416,810.00	3.43
476	000950	重药控股	413,374.00	3.40
477	688288	鸿泉物联	412,499.67	3.40
478	300621	维业股份	412,127.00	3.39
479	002128	电投能源	411,869.00	3.39
480	600969	郴电国际	410,941.00	3.38
481	002225	濮耐股份	410,051.00	3.37
482	601992	金隅集团	409,858.00	3.37
483	300387	富邦股份	409,642.00	3.37

484	002956	西麦食品	408,971.00	3.37
485	300388	节能国祯	408,335.00	3.36
486	002266	浙富控股	405,189.00	3.33
487	600320	振华重工	403,662.00	3.32
488	603808	歌力思	402,723.00	3.31
489	603681	永冠新材	401,829.00	3.31
490	300843	胜蓝股份	398,174.00	3.28
491	600266	城建发展	397,030.00	3.27
492	002376	新北洋	396,662.00	3.26
493	300358	楚天科技	396,291.00	3.26
494	601991	大唐发电	396,210.00	3.26
495	603313	梦百合	390,176.00	3.21
496	603508	思维列控	390,176.00	3.21
497	603590	康辰药业	388,967.00	3.20
498	002483	润邦股份	386,994.00	3.19
499	600611	大众交通	385,924.00	3.18
500	000059	华锦股份	384,346.00	3.16
501	002701	奥瑞金	383,792.00	3.16
502	002557	洽洽食品	380,778.00	3.13
503	002027	分众传媒	379,367.00	3.12
504	002635	安洁科技	369,264.00	3.04
505	000910	大亚圣象	367,348.00	3.02
506	600675	中华企业	367,107.00	3.02
507	600487	亨通光电	364,239.00	3.00
508	002763	汇洁股份	362,644.00	2.98
509	600075	新疆天业	359,371.00	2.96
510	300771	智莱科技	358,757.00	2.95
511	600219	南山铝业	358,281.00	2.95
512	600874	创业环保	357,775.00	2.94
513	601699	潞安环能	355,574.00	2.93
514	002870	香山股份	354,635.00	2.92
515	000601	韶能股份	354,281.00	2.92
516	600183	生益科技	351,872.00	2.90
517	002833	弘亚数控	351,766.00	2.90
518	600028	中国石化	350,494.00	2.88
519	600469	风神股份	349,081.00	2.87
520	002392	北京利尔	346,475.00	2.85
521	002044	美年健康	345,228.00	2.84
522	002081	金螳螂	342,400.00	2.82
523	600073	上海梅林	342,263.00	2.82
524	600017	日照港	340,420.00	2.80
525	301019	宁波色母	337,218.00	2.78
526	002159	三特索道	329,245.00	2.71

527	002061	浙江交科	328,551.00	2.70
528	300207	欣旺达	328,471.00	2.70
529	600742	一汽富维	324,054.00	2.67
530	603920	世运电路	322,170.00	2.65
531	300652	雷迪克	321,148.00	2.64
532	002479	富春环保	319,041.00	2.63
533	600498	烽火通信	314,168.00	2.59
534	600967	内蒙一机	313,666.00	2.58
535	300073	当升科技	313,255.00	2.58
536	601211	国泰君安	313,046.00	2.58
537	688677	海泰新光	312,542.44	2.57
538	688819	天能股份	311,253.71	2.56
539	600511	国药股份	310,596.00	2.56
540	002532	天山铝业	310,510.00	2.56
541	600356	恒丰纸业	309,879.00	2.55
542	002442	龙星化工	309,841.00	2.55
543	000488	晨鸣纸业	309,301.00	2.55
544	603515	欧普照明	308,730.00	2.54
545	688618	三旺通信	308,575.42	2.54
546	600707	彩虹股份	308,394.00	2.54
547	603458	勘设股份	304,157.00	2.50
548	600998	九州通	303,073.00	2.49
549	600372	中航机载	302,650.00	2.49
550	002601	龙佰集团	302,347.00	2.49
551	605259	绿田机械	302,067.00	2.49
552	601019	山东出版	301,992.00	2.49
553	603197	保隆科技	301,414.00	2.48
554	002421	达实智能	300,804.00	2.48
555	002815	崇达技术	300,286.00	2.47
556	601222	林洋能源	299,320.00	2.46
557	601928	凤凰传媒	299,312.00	2.46
558	600180	瑞茂通	298,353.00	2.46
559	300852	四会富仕	297,647.00	2.45
560	603886	元祖股份	297,321.00	2.45
561	600622	光大嘉宝	296,986.00	2.44
562	600623	华谊集团	296,508.00	2.44
563	600578	京能电力	294,622.00	2.42
564	000830	鲁西化工	292,841.00	2.41
565	603337	杰克股份	291,689.00	2.40
566	300377	赢时胜	291,598.00	2.40
567	603303	得邦照明	291,330.00	2.40
568	688049	炬芯科技	291,220.27	2.40
569	000949	新乡化纤	288,897.00	2.38

570	300470	中密控股	288,282.00	2.37
571	300453	三鑫医疗	288,121.00	2.37
572	300772	运达股份	287,226.00	2.36
573	603386	骏亚科技	287,094.00	2.36
574	300889	爱克股份	286,953.00	2.36
575	600977	中国电影	286,762.00	2.36
576	002302	西部建设	286,146.00	2.36
577	002677	浙江美大	283,659.00	2.33
578	688511	天微电子	282,970.80	2.33
579	000039	中集集团	282,816.00	2.33
580	002933	新兴装备	282,607.00	2.33
581	000882	华联股份	281,799.00	2.32
582	605058	澳弘电子	281,771.00	2.32
583	605088	冠盛股份	281,108.00	2.31
584	000651	格力电器	278,285.00	2.29
585	002152	广电运通	278,091.00	2.29
586	300611	美力科技	276,632.00	2.28
587	601588	北辰实业	275,927.00	2.27
588	600332	白云山	275,721.00	2.27
589	603332	苏州龙杰	274,435.00	2.26
590	002978	安宁股份	274,345.00	2.26
591	300855	图南股份	271,852.00	2.24
592	002955	鸿合科技	270,953.00	2.23
593	601595	上海电影	270,111.00	2.22
594	601800	中国交建	269,950.00	2.22
595	600383	金地集团	268,843.00	2.21
596	600638	新黄浦	268,746.13	2.21
597	300242	佳云科技	268,069.00	2.21
598	002029	七匹狼	267,399.00	2.20
599	600027	华电国际	267,233.00	2.20
600	000157	中联重科	265,839.00	2.19
601	002440	闰土股份	263,733.00	2.17
602	603726	朗迪集团	263,501.00	2.17
603	002390	信邦制药	262,734.00	2.16
604	300259	新天科技	262,268.00	2.16
605	002062	宏润建设	262,204.00	2.16
606	002990	盛视科技	261,949.00	2.16
607	600308	华泰股份	261,705.00	2.15
608	601678	滨化股份	259,433.00	2.14
609	002067	景兴纸业	257,077.00	2.12
610	688257	新锐股份	254,946.22	2.10
611	301026	浩通科技	253,164.00	2.08
612	688190	云路股份	252,759.98	2.08

613	300818	耐普矿机	252,594.00	2.08
614	301061	匠心家居	251,630.00	2.07
615	000869	张裕 A	251,397.00	2.07
616	300015	爱尔眼科	250,137.00	2.06
617	601126	四方股份	249,810.00	2.06
618	603992	松霖科技	249,191.00	2.05
619	600513	联环药业	248,945.00	2.05
620	000498	山东路桥	248,088.00	2.04
621	600496	精工钢构	245,480.00	2.02
622	603096	新经典	245,432.00	2.02
623	002558	巨人网络	245,431.00	2.02
624	688571	杭华股份	243,453.55	2.00
625	600548	深高速	242,697.00	2.00

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603871	嘉友国际	7,800,114.20	64.20
2	000997	新大陆	7,664,322.00	63.08
3	300384	三联虹普	6,835,157.06	56.26
4	600060	海信视像	6,253,000.00	51.47
5	002683	广东宏大	6,230,689.00	51.28
6	300779	惠城环保	5,450,134.00	44.86
7	601618	中国中冶	5,356,780.00	44.09
8	002600	领益智造	5,350,742.00	44.04
9	688390	固德威	5,272,817.17	43.40
10	603368	柳药集团	5,226,189.00	43.01
11	002223	鱼跃医疗	5,140,940.00	42.31
12	603093	南华期货	5,117,790.00	42.12
13	601567	三星医疗	5,056,216.00	41.62
14	002966	苏州银行	5,049,361.00	41.56
15	688002	睿创微纳	5,044,379.71	41.52
16	300724	捷佳伟创	5,033,067.00	41.42
17	002448	中原内配	4,792,311.00	39.44
18	001914	招商积余	4,736,865.00	38.99
19	300811	铂科新材	4,719,962.80	38.85
20	688019	安集科技	4,715,516.04	38.81
21	300634	彩讯股份	4,667,737.00	38.42
22	300389	艾比森	4,654,527.00	38.31

23	603605	珀莱雅	4,615,321.40	37.99
24	300130	新国都	4,575,450.00	37.66
25	600612	老凤祥	4,524,351.95	37.24
26	600489	中金黄金	4,504,312.00	37.07
27	601128	常熟银行	4,444,623.00	36.58
28	605599	菜百股份	4,387,310.00	36.11
29	300622	博士眼镜	4,382,032.75	36.07
30	002384	东山精密	4,375,447.00	36.01
31	002518	科士达	4,358,601.00	35.87
32	601336	新华保险	4,265,004.00	35.10
33	600985	淮北矿业	4,264,361.00	35.10
34	002998	优彩资源	4,257,589.00	35.04
35	002772	众兴菌业	4,257,022.00	35.04
36	000055	方大集团	4,240,828.00	34.90
37	300592	华凯易佰	4,186,058.00	34.45
38	600066	宇通客车	4,154,638.00	34.19
39	000014	沙河股份	4,115,019.00	33.87
40	300697	电工合金	4,101,735.00	33.76
41	600570	恒生电子	4,022,494.04	33.11
42	002937	兴瑞科技	4,010,656.00	33.01
43	603129	春风动力	3,994,487.00	32.88
44	600129	太极集团	3,983,141.00	32.78
45	601318	中国平安	3,939,827.39	32.43
46	600926	杭州银行	3,913,752.00	32.21
47	300795	米奥会展	3,836,674.00	31.58
48	603688	石英股份	3,818,743.00	31.43
49	688589	力合微	3,777,794.42	31.09
50	600971	恒源煤电	3,758,293.00	30.93
51	002981	朝阳科技	3,744,031.00	30.82
52	600583	海油工程	3,742,863.00	30.81
53	600655	豫园股份	3,739,742.83	30.78
54	600438	通威股份	3,714,933.97	30.58
55	002056	横店东磁	3,675,382.00	30.25
56	688219	会通股份	3,669,206.12	30.20
57	600480	凌云股份	3,657,981.00	30.11
58	002458	益生股份	3,645,606.00	30.01
59	002244	滨江集团	3,639,825.00	29.96
60	603233	大参林	3,609,586.00	29.71
61	300839	博汇股份	3,608,142.60	29.70
62	603298	杭叉集团	3,605,452.00	29.67
63	300896	爱美客	3,592,585.00	29.57
64	605158	华达新材	3,573,617.00	29.41
65	600094	大名城	3,555,539.00	29.26

66	002422	科伦药业	3,497,839.00	28.79
67	603883	老百姓	3,478,511.00	28.63
68	003017	大洋生物	3,436,925.60	28.29
69	301030	仕净科技	3,421,174.00	28.16
70	002478	常宝股份	3,396,099.00	27.95
71	002233	塔牌集团	3,373,812.00	27.77
72	600858	银座股份	3,340,967.00	27.50
73	301160	翔楼新材	3,338,576.00	27.48
74	600761	安徽合力	3,320,782.00	27.33
75	301039	中集车辆	3,308,581.00	27.23
76	000783	长江证券	3,302,829.00	27.18
77	600572	康恩贝	3,292,159.00	27.10
78	300545	联得装备	3,281,775.00	27.01
79	600508	上海能源	3,274,533.00	26.95
80	601801	皖新传媒	3,262,854.00	26.86
81	603689	皖天然气	3,235,943.60	26.63
82	688639	华恒生物	3,229,172.02	26.58
83	002025	航天电器	3,171,407.92	26.10
84	688510	航亚科技	3,157,792.13	25.99
85	601137	博威合金	3,145,100.00	25.89
86	600035	楚天高速	3,139,624.00	25.84
87	300532	今天国际	3,123,729.00	25.71
88	002991	甘源食品	3,104,728.45	25.55
89	603071	物产环能	3,103,108.23	25.54
90	002053	云南能投	3,101,695.00	25.53
91	300511	雪榕生物	3,092,211.00	25.45
92	603345	安井食品	3,051,169.00	25.11
93	300856	科思股份	3,049,346.00	25.10
94	603529	爱玛科技	3,049,194.00	25.10
95	002605	姚记科技	3,042,158.00	25.04
96	688120	华海清科	3,042,075.94	25.04
97	300232	洲明科技	3,040,823.00	25.03
98	003006	百亚股份	3,008,277.00	24.76
99	603619	中曼石油	3,005,643.00	24.74
100	688036	传音控股	2,998,899.32	24.68
101	600362	江西铜业	2,998,445.00	24.68
102	000811	冰轮环境	2,996,763.10	24.66
103	688722	同益中	2,995,157.49	24.65
104	300796	贝斯美	2,985,814.40	24.57
105	600211	西藏药业	2,977,333.00	24.51
106	601601	中国太保	2,962,939.00	24.39
107	002749	国光股份	2,958,977.00	24.35
108	600459	贵研铂业	2,945,933.00	24.25

109	301367	怡和嘉业	2,945,898.00	24.25
110	600011	华能国际	2,938,224.00	24.18
111	603859	能科科技	2,906,874.00	23.93
112	601319	中国人保	2,903,502.00	23.90
113	603283	赛腾股份	2,901,497.00	23.88
114	000028	国药一致	2,889,558.00	23.78
115	300308	中际旭创	2,886,425.00	23.76
116	603309	维力医疗	2,858,139.00	23.52
117	688551	科威尔	2,838,737.50	23.36
118	603611	诺力股份	2,835,266.00	23.34
119	603328	依顿电子	2,815,010.00	23.17
120	000333	美的集团	2,800,738.00	23.05
121	688398	赛特新材	2,765,860.61	22.76
122	605167	利柏特	2,757,184.00	22.69
123	600826	兰生股份	2,748,852.00	22.62
124	000906	浙商中拓	2,742,303.00	22.57
125	688410	山外山	2,709,783.91	22.30
126	601086	国芳集团	2,706,603.00	22.28
127	002852	道道全	2,705,181.00	22.27
128	688186	广大特材	2,703,242.91	22.25
129	600039	四川路桥	2,701,664.00	22.24
130	600512	腾达建设	2,698,689.00	22.21
131	300908	仲景食品	2,681,860.00	22.07
132	300970	华绿生物	2,677,399.00	22.04
133	688012	中微公司	2,635,816.71	21.69
134	300740	水羊股份	2,612,067.00	21.50
135	600566	济川药业	2,602,684.00	21.42
136	688106	金宏气体	2,590,621.62	21.32
137	000921	海信家电	2,589,580.00	21.31
138	688556	高测股份	2,574,912.54	21.19
139	688599	天合光能	2,572,972.79	21.18
140	002381	双箭股份	2,564,560.00	21.11
141	003011	海象新材	2,564,008.00	21.10
142	300693	盛弘股份	2,555,953.00	21.04
143	002270	华明装备	2,540,761.00	20.91
144	605499	东鹏饮料	2,516,784.00	20.71
145	688188	柏楚电子	2,498,703.81	20.57
146	002727	一心堂	2,470,519.00	20.33
147	603161	科华控股	2,466,866.00	20.30
148	601717	郑煤机	2,451,814.00	20.18
149	300316	晶盛机电	2,418,282.00	19.90
150	000623	吉林敖东	2,416,002.00	19.89
151	603699	纽威股份	2,415,853.00	19.88

152	002860	星帅尔	2,400,183.00	19.75
153	000528	柳工	2,394,405.00	19.71
154	601958	金钼股份	2,390,125.00	19.67
155	002138	顺络电子	2,385,708.00	19.64
156	000596	古井贡酒	2,383,527.00	19.62
157	001979	招商蛇口	2,372,546.00	19.53
158	300487	蓝晓科技	2,355,248.00	19.38
159	300881	盛德鑫泰	2,353,161.10	19.37
160	300206	理邦仪器	2,339,457.14	19.26
161	688029	南微医学	2,335,336.96	19.22
162	688278	特宝生物	2,325,329.55	19.14
163	000589	贵州轮胎	2,305,238.00	18.97
164	000786	北新建材	2,297,951.54	18.91
165	300857	协创数据	2,292,981.00	18.87
166	002732	燕塘乳业	2,250,021.00	18.52
167	300743	天地数码	2,244,832.00	18.48
168	688676	金盘科技	2,244,084.48	18.47
169	002917	金奥博	2,242,068.00	18.45
170	000521	长虹美菱	2,230,071.32	18.35
171	603979	金诚信	2,226,708.00	18.33
172	002847	盐津铺子	2,212,222.00	18.21
173	300842	帝科股份	2,209,755.00	18.19
174	688072	拓荆科技	2,209,324.66	18.18
175	600633	浙数文化	2,208,292.00	18.18
176	002594	比亚迪	2,195,324.00	18.07
177	002299	圣农发展	2,180,994.00	17.95
178	000878	云南铜业	2,174,353.00	17.90
179	002028	思源电气	2,173,198.00	17.89
180	688772	珠海冠宇	2,168,162.93	17.85
181	300017	网宿科技	2,162,403.03	17.80
182	688147	微导纳米	2,151,408.37	17.71
183	000058	深赛格	2,139,886.00	17.61
184	002158	汉钟精机	2,135,858.00	17.58
185	688617	惠泰医疗	2,131,617.71	17.54
186	601163	三角轮胎	2,128,084.00	17.52
187	300866	安克创新	2,106,530.00	17.34
188	600048	保利发展	2,103,451.80	17.31
189	301256	华融化学	2,100,462.00	17.29
190	601728	中国电信	2,082,204.00	17.14
191	002273	水晶光电	2,067,476.16	17.02
192	300827	上能电气	2,066,377.57	17.01
193	002891	中宠股份	2,058,876.50	16.95
194	301257	普蕊斯	2,045,520.00	16.84

195	000526	学大教育	2,044,946.00	16.83
196	601058	赛轮轮胎	2,020,865.00	16.63
197	603929	亚翔集成	2,015,431.00	16.59
198	601918	新集能源	1,977,293.00	16.27
199	002737	葵花药业	1,972,750.00	16.24
200	002335	科华数据	1,965,660.00	16.18
201	603225	新凤鸣	1,947,411.00	16.03
202	000338	潍柴动力	1,945,833.00	16.02
203	603708	家家悦	1,936,088.00	15.94
204	002085	万丰奥威	1,922,267.00	15.82
205	600325	华发股份	1,913,611.00	15.75
206	002017	东信和平	1,907,908.97	15.70
207	002466	天齐锂业	1,900,175.00	15.64
208	688111	金山办公	1,878,374.62	15.46
209	688126	沪硅产业	1,866,405.95	15.36
210	605300	佳禾食品	1,857,107.00	15.29
211	688239	航宇科技	1,852,905.81	15.25
212	002959	小熊电器	1,849,895.00	15.23
213	603339	四方科技	1,848,003.00	15.21
214	603100	川仪股份	1,828,864.00	15.05
215	300274	阳光电源	1,815,807.00	14.95
216	002459	晶澳科技	1,804,691.50	14.85
217	000417	合肥百货	1,769,238.00	14.56
218	600284	浦东建设	1,763,023.00	14.51
219	603556	海兴电力	1,744,319.00	14.36
220	002371	北方华创	1,735,511.00	14.28
221	603063	禾望电气	1,709,708.00	14.07
222	601628	中国人寿	1,680,568.00	13.83
223	002568	百润股份	1,661,786.00	13.68
224	300019	硅宝科技	1,627,256.00	13.39
225	002952	亚世光电	1,617,594.00	13.31
226	688630	芯碁微装	1,605,394.83	13.21
227	002739	万达电影	1,596,636.00	13.14
228	000423	东阿阿胶	1,589,991.00	13.09
229	603757	大元泵业	1,578,555.00	12.99
230	688625	呈和科技	1,537,520.46	12.65
231	600502	安徽建工	1,524,722.00	12.55
232	600535	天士力	1,514,772.00	12.47
233	003012	东鹏控股	1,508,871.00	12.42
234	688063	派能科技	1,486,107.34	12.23
235	600803	新奥股份	1,485,480.00	12.23
236	605066	天正电气	1,474,056.00	12.13
237	002367	康力电梯	1,470,173.44	12.10

238	002918	蒙娜丽莎	1,462,591.00	12.04
239	688329	艾隆科技	1,437,011.37	11.83
240	688711	宏微科技	1,414,738.17	11.64
241	603586	金麒麟	1,401,812.00	11.54
242	603215	比依股份	1,401,151.00	11.53
243	688080	映翰通	1,395,057.50	11.48
244	301076	新瀚新材	1,385,759.40	11.41
245	603519	立霸股份	1,360,752.00	11.20
246	002484	江海股份	1,349,358.00	11.11
247	605117	德业股份	1,345,927.36	11.08
248	600153	建发股份	1,345,378.00	11.07
249	605287	德才股份	1,337,805.00	11.01
250	000517	荣安地产	1,324,954.00	10.91
251	300452	山河药辅	1,321,974.00	10.88
252	688475	萤石网络	1,320,451.37	10.87
253	300041	回天新材	1,304,456.00	10.74
254	688311	盟升电子	1,285,405.65	10.58
255	688669	聚石化学	1,279,116.89	10.53
256	600760	中航沈飞	1,273,468.40	10.48
257	300884	狄耐克	1,271,501.00	10.47
258	603878	武进不锈	1,263,446.40	10.40
259	003019	宸展光电	1,226,196.20	10.09
260	002521	齐峰新材	1,220,208.00	10.04
261	603103	横店影视	1,198,865.00	9.87
262	603516	淳中科技	1,196,525.00	9.85
263	300840	酷特智能	1,167,945.00	9.61
264	300777	中简科技	1,163,111.00	9.57
265	000548	湖南投资	1,150,376.00	9.47
266	002154	报喜鸟	1,137,035.00	9.36
267	002983	芯瑞达	1,131,891.00	9.32
268	603518	锦泓集团	1,125,838.00	9.27
269	002674	兴业科技	1,118,947.00	9.21
270	301051	信濠光电	1,101,966.00	9.07
271	601688	华泰证券	1,079,477.00	8.88
272	688138	清溢光电	1,073,701.16	8.84
273	000937	冀中能源	1,070,053.00	8.81
274	603040	新坐标	1,065,617.00	8.77
275	001218	丽臣实业	1,061,291.00	8.74
276	603099	长白山	1,044,988.00	8.60
277	300594	朗进科技	1,025,962.00	8.44
278	300119	瑞普生物	1,025,667.00	8.44
279	300717	华信新材	1,021,000.00	8.40
280	600784	鲁银投资	988,507.00	8.14

281	300349	金卡智能	982,716.00	8.09
282	603012	创力集团	975,966.00	8.03
283	002360	同德化工	968,879.00	7.97
284	603725	天安新材	968,709.00	7.97
285	002774	快意电梯	964,525.00	7.94
286	300729	乐歌股份	961,524.40	7.91
287	603338	浙江鼎力	948,887.00	7.81
288	688626	翔宇医疗	943,375.87	7.76
289	000951	中国重汽	938,665.00	7.73
290	600755	厦门国贸	918,910.00	7.56
291	600729	重庆百货	917,693.00	7.55
292	688050	爱博医疗	917,331.59	7.55
293	688212	澳华内镜	916,451.19	7.54
294	301004	嘉益股份	896,605.00	7.38
295	600409	三友化工	892,844.00	7.35
296	300731	科创新源	883,622.00	7.27
297	002893	京能热力	874,440.00	7.20
298	600820	隧道股份	874,346.00	7.20
299	605077	华康股份	866,125.00	7.13
300	301087	可孚医疗	865,170.00	7.12
301	601702	华峰铝业	864,777.00	7.12
302	000560	我爱我家	863,832.00	7.11
303	300462	华铭智能	855,587.00	7.04
304	603167	渤海轮渡	853,393.00	7.02
305	600582	天地科技	840,547.00	6.92
306	603199	九华旅游	834,093.00	6.87
307	000426	兴业银锡	824,874.00	6.79
308	002126	银轮股份	824,062.00	6.78
309	603360	百傲化学	819,163.80	6.74
310	002179	中航光电	791,512.00	6.51
311	300638	广和通	788,318.00	6.49
312	300644	南京聚隆	787,118.00	6.48
313	688628	优利德	786,307.05	6.47
314	600026	中远海能	784,436.00	6.46
315	603551	奥普家居	774,206.00	6.37
316	603214	爱婴室	770,083.00	6.34
317	603950	长源东谷	769,759.00	6.34
318	300283	温州宏丰	746,585.00	6.14
319	300185	通裕重工	741,888.00	6.11
320	301391	卡莱特	737,939.00	6.07
321	603179	新泉股份	735,763.00	6.06
322	002997	瑞鹄模具	725,021.07	5.97
323	600051	宁波联合	723,220.00	5.95

324	002540	亚太科技	719,688.00	5.92
325	300910	瑞丰新材	719,437.80	5.92
326	603567	珍宝岛	719,223.00	5.92
327	603661	恒林股份	718,301.00	5.91
328	688439	振华风光	712,233.53	5.86
329	002443	金洲管道	706,761.00	5.82
330	688013	天臣医疗	701,266.03	5.77
331	603278	大业股份	699,433.00	5.76
332	600737	中粮糖业	696,578.00	5.73
333	603365	水星家纺	693,231.00	5.71
334	000856	冀东装备	691,345.00	5.69
335	000026	飞亚达	686,998.00	5.65
336	603939	益丰药房	684,244.80	5.63
337	603969	银龙股份	683,026.00	5.62
338	600054	黄山旅游	681,729.00	5.61
339	688569	铁科轨道	672,920.30	5.54
340	002215	诺普信	670,696.00	5.52
341	603778	国晟科技	670,487.00	5.52
342	301185	鸥玛软件	668,011.00	5.50
343	600718	东软集团	666,044.00	5.48
344	600968	海油发展	658,437.00	5.42
345	002746	仙坛股份	648,787.00	5.34
346	000100	TCL 科技	648,042.00	5.33
347	600551	时代出版	640,451.00	5.27
348	300694	蠡湖股份	633,684.00	5.22
349	600419	天润乳业	628,420.00	5.17
350	600710	苏美达	621,747.00	5.12
351	600312	平高电气	618,315.00	5.09
352	600774	汉商集团	617,812.00	5.08
353	601231	环旭电子	608,176.00	5.01
354	300833	浩洋股份	592,557.00	4.88
355	600323	瀚蓝环境	591,789.00	4.87
356	002170	芭田股份	591,619.00	4.87
357	002106	莱宝高科	589,501.00	4.85
358	600941	中国移动	588,175.00	4.84
359	688578	艾力斯	586,846.18	4.83
360	000612	焦作万方	583,427.00	4.80
361	002004	华邦健康	581,882.00	4.79
362	605123	派克新材	579,768.00	4.77
363	688777	中控技术	574,490.18	4.73
364	002351	漫步者	568,709.00	4.68
365	688033	天宜上佳	566,125.54	4.66
366	601101	昊华能源	565,718.00	4.66

367	600727	鲁北化工	562,844.00	4.63
368	002249	大洋电机	561,625.00	4.62
369	002462	嘉事堂	557,002.00	4.58
370	002919	名臣健康	556,192.00	4.58
371	600386	北巴传媒	553,836.00	4.56
372	605086	龙高股份	553,012.00	4.55
373	000973	佛塑科技	549,320.00	4.52
374	603639	海利尔	546,863.00	4.50
375	002345	潮宏基	546,059.00	4.49
376	600455	博通股份	545,725.00	4.49
377	603602	纵横通信	540,426.50	4.45
378	000027	深圳能源	536,280.99	4.41
379	002595	豪迈科技	533,676.00	4.39
380	002641	公元股份	533,076.00	4.39
381	002743	富煌钢构	531,087.00	4.37
382	300543	朗科智能	523,793.00	4.31
383	603058	永吉股份	521,904.00	4.30
384	300394	天孚通信	521,661.00	4.29
385	688009	中国通号	519,833.42	4.28
386	002161	远望谷	518,196.00	4.27
387	600177	雅戈尔	517,453.00	4.26
388	603787	新日股份	516,384.00	4.25
389	600230	沧州大化	515,835.00	4.25
390	600697	欧亚集团	504,952.00	4.16
391	002373	千方科技	504,036.00	4.15
392	603321	梅轮电梯	500,360.00	4.12
393	000030	富奥股份	498,794.00	4.11
394	300558	贝达药业	496,458.00	4.09
395	600057	厦门象屿	496,003.00	4.08
396	300396	迪瑞医疗	492,948.00	4.06
397	601500	通用股份	492,321.00	4.05
398	000156	华数传媒	489,982.00	4.03
399	000543	皖能电力	488,794.00	4.02
400	601956	东贝集团	488,460.00	4.02
401	002614	奥佳华	482,365.00	3.97
402	688268	华特气体	476,177.26	3.92
403	603600	永艺股份	471,663.00	3.88
404	002697	红旗连锁	471,623.00	3.88
405	600704	物产中大	470,911.00	3.88
406	002899	英派斯	467,929.00	3.85
407	601952	苏垦农发	446,428.00	3.67
408	002048	宁波华翔	441,906.00	3.64
409	002332	仙琚制药	440,468.00	3.63

410	002938	鹏鼎控股	437,618.00	3.60
411	000887	中鼎股份	434,140.00	3.57
412	601668	中国建筑	428,275.00	3.52
413	601607	上海医药	426,044.00	3.51
414	000672	上峰水泥	419,069.00	3.45
415	601699	潞安环能	418,188.00	3.44
416	002128	电投能源	417,722.00	3.44
417	603102	百合股份	415,142.00	3.42
418	000823	超声电子	409,056.00	3.37
419	300388	节能国祯	408,261.00	3.36
420	002956	西麦食品	407,603.00	3.35
421	300515	三德科技	405,713.00	3.34
422	000990	诚志股份	405,198.00	3.34
423	600050	中国联通	404,676.00	3.33
424	300787	海能实业	403,608.00	3.32
425	300102	乾照光电	402,750.00	3.31
426	688127	蓝特光学	400,058.14	3.29
427	002133	广宇集团	399,192.00	3.29
428	300243	瑞丰高材	392,608.00	3.23
429	601992	金隅集团	392,570.00	3.23
430	600320	振华重工	391,312.00	3.22
431	688332	中科蓝讯	390,871.38	3.22
432	603508	思维列控	390,644.00	3.22
433	600266	城建发展	389,386.00	3.20
434	300358	楚天科技	387,119.00	3.19
435	300621	维业股份	385,469.00	3.17
436	600694	大商股份	383,789.00	3.16
437	002635	安洁科技	382,872.00	3.15
438	603313	梦百合	380,023.00	3.13
439	603808	歌力思	378,955.00	3.12
440	000601	韶能股份	367,771.00	3.03
441	300440	运达科技	364,883.00	3.00
442	600469	风神股份	362,655.00	2.98
443	300043	星辉娱乐	354,717.00	2.92
444	600874	创业环保	353,621.00	2.91
445	000531	穗恒运 A	349,961.00	2.88
446	002044	美年健康	346,255.00	2.85
447	603920	世运电路	345,388.00	2.84
448	000559	万向钱潮	341,013.00	2.81
449	601857	中国石油	340,313.00	2.80
450	688288	鸿泉物联	339,659.44	2.80
451	600742	一汽富维	339,501.00	2.79
452	600873	梅花生物	338,045.00	2.78

453	600073	上海梅林	335,690.00	2.76
454	002833	弘亚数控	335,433.00	2.76
455	002933	新兴装备	330,973.00	2.72
456	688618	三旺通信	329,665.35	2.71
457	300387	富邦股份	329,631.00	2.71
458	603885	吉祥航空	324,273.00	2.67
459	300739	明阳电路	322,413.00	2.65
460	688169	石头科技	316,571.73	2.61
461	600180	瑞茂通	315,398.00	2.60
462	601211	国泰君安	312,959.00	2.58
463	301019	宁波色母	310,866.00	2.56
464	603386	骏亚科技	309,184.00	2.54
465	002442	龙星化工	307,292.00	2.53
466	600967	内蒙一机	306,976.00	2.53
467	002554	惠博普	305,370.00	2.51
468	603726	朗迪集团	305,045.00	2.51
469	688677	海泰新光	304,446.18	2.51
470	605259	绿田机械	304,443.00	2.51
471	300652	雷迪克	299,945.00	2.47
472	688336	三生国健	298,882.82	2.46
473	002984	森麒麟	297,865.00	2.45
474	000415	渤海租赁	295,655.00	2.43
475	603681	永冠新材	295,651.00	2.43
476	603458	勘设股份	295,187.00	2.43
477	002753	永东股份	295,074.00	2.43
478	600531	豫光金铅	293,924.00	2.42
479	603337	杰克股份	290,451.00	2.39
480	605088	冠盛股份	289,699.00	2.38
481	600977	中国电影	289,087.00	2.38
482	300453	三鑫医疗	286,300.00	2.36
483	688049	炬芯科技	286,014.14	2.35
484	000039	中集集团	284,976.00	2.35
485	605058	澳弘电子	284,736.00	2.34
486	600959	江苏有线	283,071.00	2.33
487	002763	汇洁股份	281,860.00	2.32
488	000882	华联股份	281,438.00	2.32
489	688511	天微电子	281,047.20	2.31
490	300470	中密控股	280,037.00	2.30
491	002677	浙江美大	278,893.00	2.30
492	601966	玲珑轮胎	277,571.00	2.28
493	002302	西部建设	277,217.00	2.28
494	300242	佳云科技	276,284.10	2.27
495	002955	鸿合科技	275,952.00	2.27

496	000651	格力电器	275,452.00	2.27
497	002563	森马服饰	274,960.00	2.26
498	300772	运达股份	274,955.00	2.26
499	300855	图南股份	274,787.00	2.26
500	601588	北辰实业	273,179.00	2.25
501	600027	华电国际	271,138.00	2.23
502	000513	丽珠集团	271,110.00	2.23
503	600611	大众交通	269,446.00	2.22
504	603303	得邦照明	269,341.00	2.22
505	603700	宁水集团	267,364.00	2.20
506	002990	盛视科技	265,514.00	2.19
507	603332	苏州龙杰	263,468.00	2.17
508	601595	上海电影	261,752.00	2.15
509	600894	广日股份	260,853.00	2.15
510	002078	太阳纸业	259,527.00	2.14
511	688123	聚辰股份	258,838.93	2.13
512	600638	新黄浦	257,605.00	2.12
513	600356	恒丰纸业	257,067.00	2.12
514	600675	中华企业	256,187.00	2.11
515	601800	中国交建	255,393.00	2.10
516	600822	上海物贸	254,069.00	2.09
517	688257	新锐股份	253,369.48	2.09
518	000157	中联重科	252,865.00	2.08
519	300377	赢时胜	252,807.00	2.08
520	002440	闰土股份	252,656.00	2.08
521	600383	金地集团	252,634.00	2.08
522	600513	联环药业	248,253.00	2.04
523	601766	中国中车	248,056.00	2.04
524	600511	国药股份	247,467.00	2.04
525	301026	浩通科技	245,838.00	2.02
526	600487	亨通光电	245,788.00	2.02
527	000910	大亚圣象	244,964.00	2.02
528	603096	新经典	244,184.00	2.01
529	688190	云路股份	244,168.83	2.01
530	300889	爱克股份	244,017.00	2.01

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,040,664,840.64
卖出股票的收入（成交）总额	952,361,082.98

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金未参与投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在

报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

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	96,457.84
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,182,830.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,279,288.47

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

	(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
信澳量化多 因子混合 (LOF) A	308	26,841.44	0.00	0.00%	8,267,162.68	100.00 %
信澳量化多 因子混合 (LOF) C	1,025	80,720.43	30,584,088.02	36.96%	52,154,348.57	63.04%
合计	1,333	68,271.27	30,584,088.02	33.61%	60,421,511.25	66.39%

9.2 期末上市基金前十名持有人

信澳量化多因子混合 (LOF) A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比 例
1	郭锐	489,800.00	40.50%
2	蔡洪梅	57,732.00	4.77%
3	崔冰	50,001.00	4.13%
4	刘逸凡	46,328.00	3.83%
5	吴双燕	46,000.00	3.80%
6	董利剑	40,801.00	3.37%
7	肖玉艳	32,300.00	2.67%
8	殷密仙	31,903.00	2.64%
9	孙钦东	25,500.00	2.11%
10	张爱红	25,200.00	2.08%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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	信澳量化多因子混合 (LOF) A	141,318.21	1.71%
	信澳量化多因子混合 (LOF) C	0.00	0.00%
	合计	141,318.21	0.16%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理 人员、基金投资和 研究部门负责人 持有本开放式基	信澳量化多因子混合 (LOF) A	0
	信澳量化多因子混合 (LOF) C	0

金	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	信澳量化多因子混合(LOF) A	10~50
	信澳量化多因子混合(LOF) C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C
基金合同生效日(2019年11月6日)基金份额总额	225,841,133.97	106,489,634.84
本报告期期初基金份额总额	4,492,095.31	7,310,136.10
本报告期基金总申购份额	61,908,924.03	492,075,390.97
减:本报告期基金总赎回份额	58,133,856.66	416,647,090.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,267,162.68	82,738,436.59

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，未召开基金份额持有人大会，未有相关决议。

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，本基金管理人经第六届董事会第六次会议决定，自2023年1月起黄晖女士担任公司督察长兼董事会秘书，徐伟文先生担任公司首席信息官，公司总经理朱永强先生不再兼任首席信息官。第六届董事会第十次会议决定，自2023年3月起，王咏辉先生离任公司副总经理。2023年12月15日通过第六届董事会第十六次会议，黄晖女士不再担任公司董事会秘书，由方敬先生担任公司董事会秘书。2023年12月15日通过股东会书面决议，批准了监事Ken Okamoto的辞职申请。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内，未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 20000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	287,810,116.37	14.44%	210,477.88	14.32%	-
东兴证券	1	3,662,208.00	0.18%	2,678.06	0.18%	-
广发证券	2	335,832,112.45	16.85%	245,594.72	16.71%	-
国联证券	1	9,480,242.08	0.48%	6,933.05	0.47%	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

光大证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	1,356,241,244.72	68.05%	1,003,890.14	68.31%	-

注：根据《交易单元及佣金管理办法》、《投资审议委员会议事规则》的规定，交易单元开设、增设或退租由研究咨询部提议，经公司投资审议委员会审议。在分配交易量方面，公司制订合理的评分体系，相关投资研究人员于每个季度最后20个工作日对提供研究报告的证券公司的研究水平、服务质量等综合情况通过投研管理系统进行评比打分。交易管理部根据上季度研究服务评分结果安排研究机构交易佣金分配，每季度佣金分配量应与上季度研究服务评分排名基本匹配，并确保券商研究机构年度佣金分配量与全年合计研究服务评分排名基本匹配。

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		回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
广发证券	7,926.40	100.00%	9,900,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒投资者谨防虚假客服电话诈骗的提示性公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-10
2	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-14
3	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2022年第四季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-01-18
4	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披	2023-02-15

		露网站、公司网站	
5	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金经理变更公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-16
6	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)A)基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-17
7	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)C)基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-17
8	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-17
9	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-25
10	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2022年年度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-03-29
11	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过直销网上交易汇款交易业务实施费率优惠的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-18
12	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2023年第一季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-04-20
13	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒客户及时更新身份证件及非自然人客户及时登记受益所有人信息的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-06-21
14	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2023年第二季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-07-20
15	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金可投资北京证券交易所股票的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司	2023-08-11

		网站	
16	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-08-31
17	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2023年中期报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-08-31
18	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-09-04
19	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)A)基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-09-20
20	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)C)基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-09-20
21	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-09-20
22	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)托管协议更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-09-20
23	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-09-20
24	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2023年第三季度报告	证监会信息披露网站、公司网站	2023-10-25
25	信达澳亚基金管理有限公司关于谨防不法分子假冒“信达澳亚”名义进行非法活动的声明	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-11-23
26	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-14
27	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)A)基金产品资料概要更	证监会信息披露网站、公司	2023-12-21

	新	网站	
28	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)（信澳量化多因子混合（LOF）C）基金产品资料概要更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-21
29	信澳量化多因子混合型证券投资基金（LOF）招募说明书更新	证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-21
30	信达澳亚基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修改基金合同等法律文件的公告	证监会指定信息披露报纸、证监会信息披露网站、公司网站	2023-12-29

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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05日-2023年03月28日,2023年04月04日-2023年05月14日,2023年05月23日-2023年05月23日	1,823,396.73	-	1,823,396.73	-	-
	2	2023年03月29日-2023年04月03日	-	23,886,088.45	23,886,088.45	-	-
	3	2023年10月24日-2023年12月31日	-	24,470,451.69	-	24,470,451.69	26.89%
个人	1	2023年01月01日-2023年01月04日	4,673,017.97	-	4,673,017.97	-	-
	2	2023年03月29日-2023年04月03日	-	10,604,347.38	10,604,347.38	-	-
	3	2023年06月	-	24,022,292.6	24,022,292.6	-	-

	26 日-2023 年 06 月 26 日		9	69		
产品特有风险						
(1) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险； (2) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的流动性风险； (3) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的赎回申请延期办理的风险； (4) 持有基金份额比例达到或超过 20% 的投资者大额赎回导致的基金资产净值持续低于 5000 万元的风险等。						

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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日