

**海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金**  
**2023 年年度报告**  
**2023 年 12 月 31 日**

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	19
<b>§5 托管人报告</b> .....	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	20
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.....	20
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.....	20
<b>§6 审计报告</b> .....	20
6.1 审计意见.....	20
6.2 形成审计意见的基础.....	21
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	21
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	21
<b>§7 年度财务报表</b> .....	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
<b>§8 投资组合报告</b> .....	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	94

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 .....	95
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 .....	95
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 .....	95
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	95
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	95
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	95
8.12	投资组合报告附注 .....	96
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>96</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	96
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	97
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	97
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>98</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>98</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	98
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 .....	98
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	98
11.4	基金投资策略的改变 .....	98
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	98
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 .....	99
11.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	99
11.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	99
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	99
11.8	其他重大事件 .....	100
<b>12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>102</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>104</b>
13.1	备查文件目录 .....	104
13.2	存放地点 .....	104
13.3	查阅方式 .....	105

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	海富通欣荣混合	
基金主代码	519223	
交易代码	519223	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016 年 9 月 22 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	400,749,220.71 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
下属分级基金的交易代码	519224	519223
报告期末下属分级基金的份 额总额	327,798,186.97 份	72,951,033.74 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持灵活的资产配置,在严格控制下跌风险的基础上,积极把握证券市场的投资机会,追求资产的保值增值。
投资策略	本基金的资产配置策略以基金的投资目标为中心,首先按照投资时钟理论,根据宏观预期环境判断经济周期所处的阶段,作出权益类资产的初步配置,并根据投资时钟判断大致的行业配置;其次结合证券市场趋势指标,判断证券市场指数的大致风险收益比,从而做出权益类资产的具体仓位选择。债券投资采取“自上而下”的策略,深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素,以价值发现为基础,在市场创新和变化中寻找投资机会,采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极投资管理方式,确定和构造

	合理的债券组合。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+中证全债指数收益率*50%
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和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等风险水平的投资品种。

### 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		海富通基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	陆志俊
	联系电话	021-38650788	95559
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		40088-40099	95559
传真		021-33830166	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室	中国（上海）长宁区仙霞路 18号
邮政编码		200120	200336
法定代表人		杨仓兵	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
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	
	海富通欣 荣混合 A	海富通欣 荣混合 C	海富通欣荣 混合 A	海富通欣荣 混合 C	海富通欣荣 混合 A	海富通欣荣 混合 C
本期已 实现收 益	-46,643,33 3.73	-9,827,710 .66	-14,890,134 .18	-4,843,369. 34	40,641,864. 06	34,210,606.0 3
本期利 润	-42,266,44 5.73	-10,238,61 8.95	-72,892,953 .37	-29,065,265 .85	10,463,486. 34	7,554,950.46
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.1650	-0.1619	-0.6187	-0.6910	0.0719	0.0692
本期加 权平均 净值利 润率	-13.18%	-12.94%	-36.34%	-40.30%	3.65%	3.52%
本期基 金份额 净值增 长率	-8.04%	-8.23%	-24.39%	-24.54%	4.00%	3.79%

3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
期末可供分配利润	21,837,405.64	4,183,156.23	28,723,641.91	908,157.78	118,262,447.88	60,477,233.40
期末可供分配基金份额利润	0.0666	0.0573	0.5107	0.5046	0.6594	0.6549
期末基金资产净值	361,286,881.06	79,812,110.37	84,971,804.14	2,707,904.29	358,323,926.78	184,137,632.15
期末基金份额净值	1.1022	1.0941	1.5107	1.5046	1.9980	1.9939
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金份额累计净值增长率	38.92%	38.08%	51.07%	50.46%	99.80%	99.39%

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

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



### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 海富通欣荣混合 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.88%	0.73%	-2.84%	0.39%	-3.04%	0.34%
过去六个月	-11.45%	0.73%	-4.36%	0.42%	-7.09%	0.31%
过去一年	-8.04%	0.74%	-3.19%	0.42%	-4.85%	0.32%
过去三年	-27.69%	1.09%	-11.95%	0.55%	-15.74%	0.54%
过去五年	57.95%	1.15%	21.65%	0.60%	36.30%	0.55%
自基金合同生效起至今	38.92%	1.05%	20.51%	0.57%	18.41%	0.48%

##### 2. 海富通欣荣混合 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.93%	0.73%	-2.84%	0.39%	-3.09%	0.34%
过去六个月	-11.54%	0.73%	-4.36%	0.42%	-7.18%	0.31%
过去一年	-8.23%	0.74%	-3.19%	0.42%	-5.04%	0.32%
过去三年	-28.12%	1.09%	-11.95%	0.55%	-16.17%	0.54%
过去五年	57.08%	1.16%	21.65%	0.60%	35.43%	0.56%
自基金合同生效起至今	38.08%	1.05%	20.51%	0.57%	17.57%	0.48%

#### 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

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

## 1. 海富通欣荣混合 A

(2016 年 9 月 22 日至 2023 年 12 月 31 日)



## 2. 海富通欣荣混合 C

(2016 年 9 月 22 日至 2023 年 12 月 31 日)



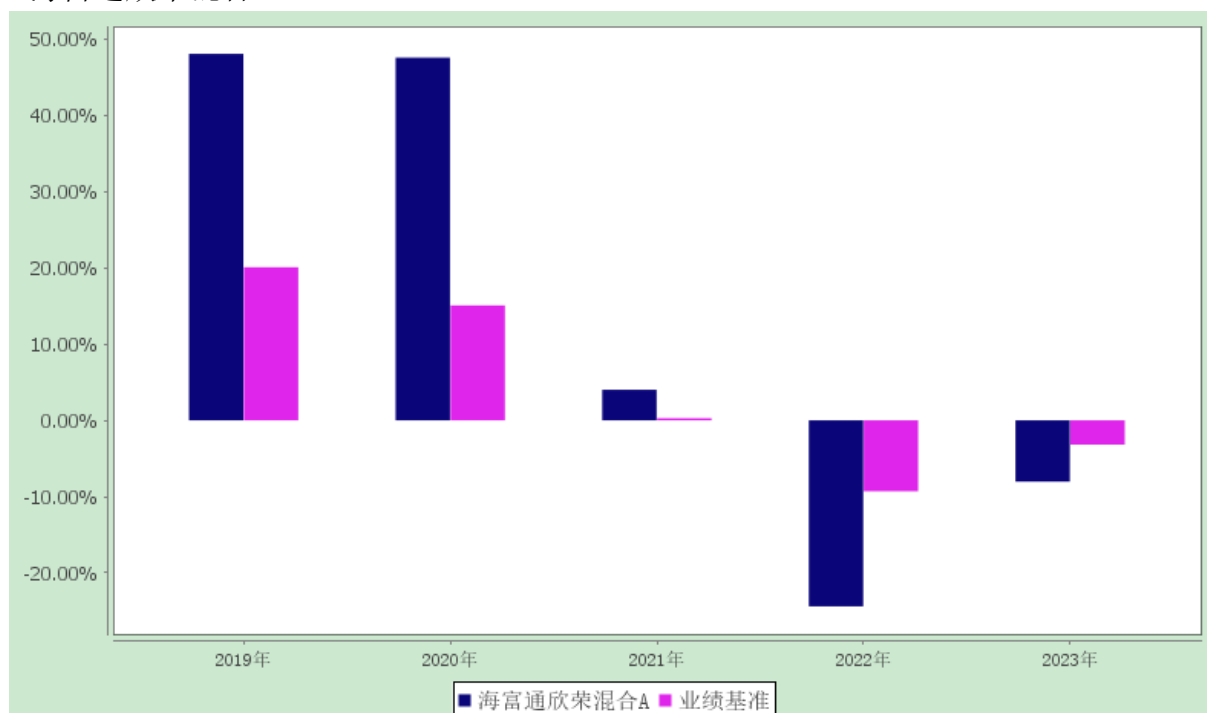
注：本基金合同于 2016 年 9 月 22 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

### 3.2.3 过去五年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

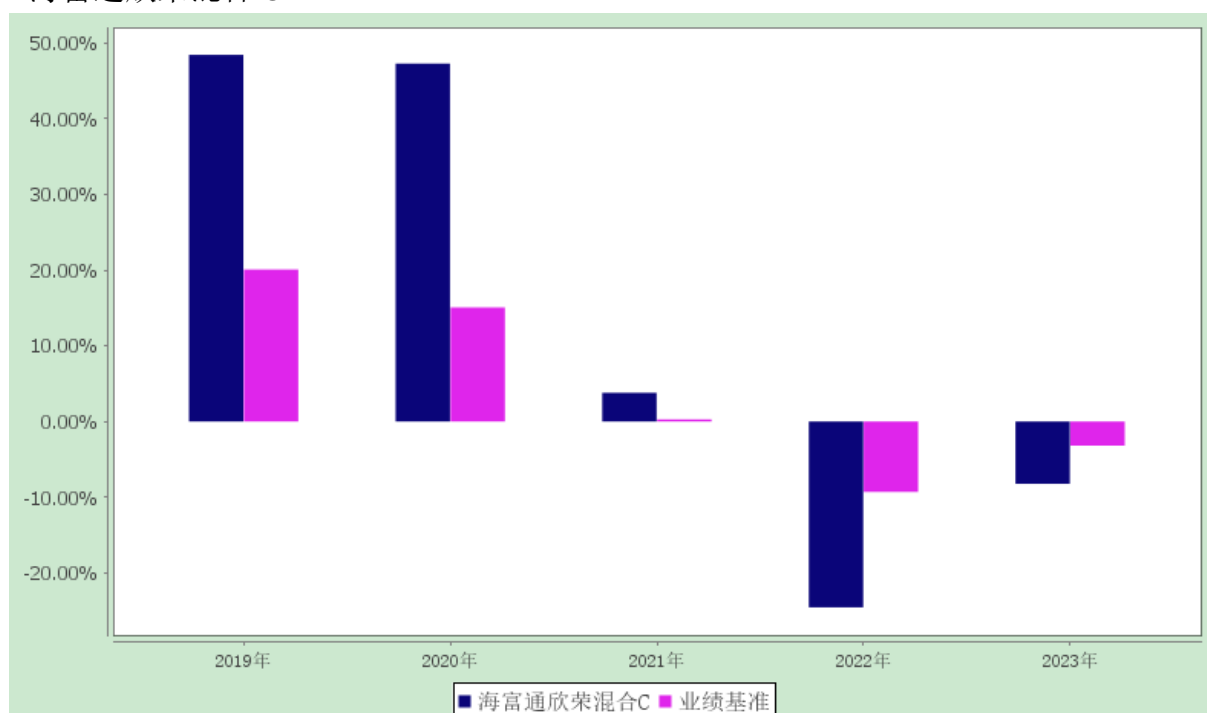
海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1. 海富通欣荣混合 A



#### 2. 海富通欣荣混合 C



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、海富通欣荣混合 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2023 年	3.159	68,964,400.20	54,313,844.98	123,278,245.18	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	3.159	68,964,400.20	54,313,844.98	123,278,245.18	-

#### 2、海富通欣荣混合 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2023 年	3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-

## §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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 88 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通

中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混

合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金。

#### 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		
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2016-09-28	-	23 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理兼量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4

				<p>月至 2020 年 10 月兼任海富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

#### 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，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各

投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，国内宏观经济逐步修复，全年实现 GDP 增速 5.2%，总体平稳向好；物价也相对平稳，全年居民消费价格（CPI）比上年上涨 0.2%。从节奏上看，上半年恢复效应较为显著，经济相对较好；下半年，房地产市场持续走弱，对整体经济、地方财政的负面影响逐步显现，市场对经济的信心也在不断降低。

海外方面，2023 年美国在超预期的财政扩张支撑下继续维持强势，美国通胀也一直在 3% 以上运行和波动。受此影响，美国十年期国债收益率逐步上行，在 2023 年 10 月最高点超过 5%；随后两个月虽然有所回落，但依然保持在 4% 左右的高位。这对全球金融市场、资产价格均产生了较为显著的影响。

从 A 股市场看，全年主要指数均以下跌为主，上证指数为-3.70%，沪深 300 为-11.38%，中证 800 为-10.37%，创业板指为-19.41%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，通信、传媒、煤炭、家电、石油石化排名前五，涨幅分别为 24.78%、19.84%、13.39%、9.13%、9.03%；消费者服务、房地产、电力设备及新能源、建材、基础化工排名后五，分别下跌 41.18%、24.80%、24.65%、20.47%、17.50%。节奏方面，上半年市场以平稳分化为主，结构性机会较多，科技成长行业的超额收益更为显著；下半年市场以单边下跌为主，低估值、高分红板块较为抗跌，而上半年大幅上涨的科技板块出现了显著回调。从驱动因素看，国内外经济和政策的运行及变化，对 A 股市场有较显著的影响，而 AI



技术的变更，是 TMT 等科技成长行业在上半年出现显著结构性机会的核心驱动力。

本报告期内，在大盘持续下跌的背景下，低估值、低波、反转类因子表现较好，成长表现较差。这与市场持续下跌，投资者防御意愿较强有关。在北向资金持续流出的背景下，大盘显著跑输小盘。当前在低拥挤度的股票中挖掘机会更有利于获得超额。

行业方面，截止报告期末，相对沪深 300，本基金显著超配了前期跌幅较大、景气度有积极变化的医药、电子板块，以及受益于出口链的汽车板块，显著低配了基本面较弱的食品饮料、银行、电力设备板块。其余行业配置相对均衡。

组合风格上相对均衡，根据公司基本面在业绩和估值匹配的公司中寻找投资机会，同时积极运用量价模型在低关注股票中挖掘机会。本基金通过多策略并行的方式，力争在风险可控的基础上跑赢市场。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通欣荣混合 A 净值增长率为-8.04%，同期业绩比较基准收益率为-3.19%，基金净值跑输业绩比较基准 4.85 个百分点。海富通欣荣混合 C 净值增长率为-8.23%，同期业绩比较基准收益率为-3.19%，基金净值跑输业绩比较基准 5.04 个百分点。报告期内，股票市场波动较大，主流指数大多下跌，组合整体仓位较高，导致基金跑输基准。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，由于美国财政高杠杆、货币高利率的制约，2024 年美国财政刺激力度将边际走弱，美国经济、通胀也将逐步下行，具体的下行速度、幅度需要具体跟踪。在这个背景下，美联储的具体降息操作将成为全球市场关注的一个焦点。这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，我们面临的外部金融环境有望缓解。

中国经济暂时仍面临着总需求不足、结构调整阵痛的冲击，在这过程中市场信心的脆弱和不足可能短期加剧经济的疲弱。不过，目前市场信心已在相对低位，监管层也在积极呵护市场，对经济的托底力度也有望进一步加强。我们对此依然怀着积极心态，积极跟踪国内政策和经济的变化。

投资策略上，随着经济增长在全球范围内均相对乏力，我们将更加关注上市公司的发展质量。一方面，我们将更为重视对经营现金流、股息分红、积极回报投资者因素的考量，高质量的上市公司在目前变革的全球环境中依然是值得持续关注重点。另一方面，我们将更加重视高端制造产业的核心技术及能力，寻找真正具备核心竞争优势的科技创新企业、出口或出海制造龙头、细分行业隐形冠军等，这些企业代表着中国经济转型升级的未来，我们将以更为严苛的标准去伪存真、精选个股。

投资策略上，我们将坚持多策略并行，一方面通过基本面策略跟踪公司的业绩，挖掘估值与成长相匹配、具备投资价值的好公司，另一方面通过深度学习策略在低关注股票中获取超额，力争在风险可控的基础上跑赢市场。

进入 2024 年，随着年报业绩预告陆续披露，个股景气度将得到进一步验证。后市操作上，本基金将在控制回撤的基础上，力图寻找合适的股票投资机会以赚取相对指数的超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项稽核等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度，健全内控体系，落实内控责任。

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及公司管理需要，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。

二、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施。

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。针对上述内外部评估检查中发现的问题，公司相关业务部门均认真进行整改。通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作。

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度及流程，组织多场反洗钱专项培训和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息数据治理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，全面升级反洗钱系统，持续优化监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了 2022 年度洗钱固有风险评估工作，有效管控公司洗钱固有风险敞口。另外，公司加大反洗钱课题研习工作力度，组织反洗钱专兼职人员深入开展相关课题研究，提升反洗钱工作质效。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，提升员工的合规及风险意识。

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，

营造合规文化浓厚氛围。另外，通过考试等方式检验培训效果，将法规落实到具体的业务、工作中。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

#### 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，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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 10%。

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2023 年 06 月 16 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2023 年 06 月 27 日完成权益登记，海富通欣荣混合 A 单位分红金额为 0.3159 元，海富通欣荣混合 C 单位分红金额为 0.3159 元。合计利润分配金额为 167,690,592.71 元。符合基金合同规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，海富通基金管理有限公司在海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 20560 号

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (一) 我们审计的内容

我们审计了海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“海富通欣荣混合基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了海富通欣荣混合基金 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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于海富通欣荣混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通欣荣混合基金的基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估海富通欣荣混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算海富通欣荣混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通欣荣混合基金的财务报告过程。

## 6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对海富通欣荣混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致海富通欣荣混合基金不能持续经营。

(五) 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。

我们与基金管理人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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 胡莲莲

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	11,682,588.44	1,897,668.50
结算备付金		10,149,972.83	1,048,562.31
存出保证金		1,487,094.89	76,656.92
交易性金融资产	7.4.7.2	426,612,738.40	85,120,489.04
其中：股票投资		405,510,557.25	81,106,416.21
基金投资		-	-

债券投资		21,102,181.15	4,014,072.83
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		447,220.20	875,146.63
应收股利		-	-
应收申购款		29.98	67.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		450,379,644.74	89,018,591.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,734,809.56	-
应付赎回款		2,223.05	755,427.74
应付管理人报酬		243,774.21	71,839.45
应付托管费		60,943.58	17,959.86
应付销售服务费		13,551.17	4,189.53
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,225,351.74	489,465.89
负债合计		9,280,653.31	1,338,882.96
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	400,749,220.71	58,047,908.74
未分配利润	7.4.7.8	40,349,770.72	29,631,799.69
净资产合计		441,098,991.43	87,679,708.43
负债和净资产总计		450,379,644.74	89,018,591.39

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.1022 元，C 类基金份额净值 1.0941 元。基金份额总额 400,749,220.71 份，其中 A 类基金份额 327,798,186.97 份，C 类基金份额 72,951,033.74 份。

## 7.2 利润表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-49,188,214.54	-99,508,503.31
1.利息收入		366,384.32	201,522.77
其中：存款利息收入	7.4.7.9	359,214.19	194,561.13
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		7,170.13	6,961.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-53,821,372.78	-17,605,715.39
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-63,409,888.43	-22,190,056.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	608,211.40	609,480.56
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-1,782,534.25	789,304.84
股利收益	7.4.7.14	10,762,838.50	3,185,555.31
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	3,965,979.71	-82,224,715.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	300,794.21	120,405.01
<b>减：二、营业总支出</b>		3,316,850.14	2,449,715.91
1. 管理人报酬		2,367,988.41	1,663,055.32
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		591,997.20	415,763.86
3. 销售服务费		155,671.43	148,384.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	90.41
其中：卖出回购金融资产支出		-	90.41
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		332.55	3,441.55
8. 其他费用	7.4.7.17	200,860.55	218,980.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-52,505,064.68</b>	<b>-101,958,219.22</b>



减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		<b>-52,505,064.68</b>	<b>-101,958,219.22</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-52,505,064.68	-101,958,219.22

### 7.3 净资产变动表

会计主体：海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	58,047,908.74	-	29,631,799.69	87,679,708.43
二、本期期初净资产	58,047,908.74	-	29,631,799.69	87,679,708.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	342,701,311.97	-	10,717,971.03	353,419,283.00
（一）、综合收益总额	-	-	-52,505,064.68	-52,505,064.68
（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）	342,701,311.97	-	230,913,628.42	573,614,940.39
其中：1. 基金申购款	532,459,908.06	-	269,531,962.01	801,991,870.07
2. 基金赎回款	-189,758,596.09	-	-38,618,333.59	-228,376,929.68
（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）	-	-	-167,690,592.71	-167,690,592.71

列)				
四、本期期末净资产	400,749,220.71	-	40,349,770.72	441,098,991.43
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	271,692,015.70	-	270,769,543.23	542,461,558.93
二、本期期初净资产	271,692,015.70	-	270,769,543.23	542,461,558.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-213,644,106.96	-	-241,137,743.54	-454,781,850.50
（一）、综合收益总额	-	-	-101,958,219.22	-101,958,219.22
（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）	-213,644,106.96	-	-139,179,524.32	-352,823,631.28
其中：1. 基金申购款	8,090,769.37	-	6,432,396.84	14,523,166.21
2. 基金赎回款	-221,734,876.33	-	-145,611,921.16	-367,346,797.49
（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	58,047,908.74	-	29,631,799.69	87,679,708.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第 1480 号《关于准予海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册,由海富通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《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 450,020,570.20 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1193 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 450,135,331.01 份,其中认购资金利息折合 114,760.81 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、权证、股指期货等权益类品种,债券等固定收益类品种(包括但不限于国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券、可分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、资产支持证券、次级债、债券回购、银行存款、货币市场工具等),国债期货,以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例范围为 0-95%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。股指期货、国债期货的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 50%+中证全债指数收益率 $\times$ 50%。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 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等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

#### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

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

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率

和计算方法确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的



该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

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

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提

供的贷款服务，产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	11,682,588.44	1,897,668.50
等于：本金	11,679,408.34	1,896,447.62
加：应计利息	3,180.10	1,220.88
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	11,682,588.44	1,897,668.50

## 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	403,707,844.11	-	405,510,557.25	1,802,713.14	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	20,712,667.58	400,111.15	21,102,181.15	-10,597.58
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,712,667.58	400,111.15	21,102,181.15	-10,597.58
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	424,420,511.69	400,111.15	426,612,738.40	1,792,115.56	
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	83,197,833.65	-	81,106,416.21	-2,091,417.44	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	

债券	交易所市场	3,954,556.71	52,042.83	4,014,072.83	7,473.29
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,954,556.71	52,042.83	4,014,072.83	7,473.29
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		87,152,390.36	52,042.83	85,120,489.04	-2,083,944.15

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	10,277,480.00	-	-	-
——股指期货	10,277,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	10,277,480.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2403	IF2403	10.00	10,367,400.00	89,920.00
合计	-	-	-	89,920.00

减：可抵销期货暂收款	-	-	-	89,920.00
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

##### 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	0.45	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,065,351.29	314,465.89
其中：交易所市场	1,065,351.29	314,465.89
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	175,000.00
合计	1,225,351.74	489,465.89

##### 7.4.7.7 实收基金

##### 海富通欣荣混合 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	56,248,162.23	56,248,162.23
本期申购	390,968,846.09	390,968,846.09
本期赎回（以“-”号填列）	-119,418,821.35	-119,418,821.35
本期末	327,798,186.97	327,798,186.97

**海富通欣荣混合 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	1,799,746.51	1,799,746.51
本期申购	141,491,061.97	141,491,061.97
本期赎回（以“-”号填列）	-70,339,774.74	-70,339,774.74
本期末	72,951,033.74	72,951,033.74

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

**7.4.7.8 未分配利润****海富通欣荣混合 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	28,965,683.44	-242,041.53	28,723,641.91
本期期初	28,965,683.44	-242,041.53	28,723,641.91
本期利润	-46,643,333.73	4,376,888.00	-42,266,445.73
本期基金份额交易产生的变动数	162,793,301.11	7,516,441.98	170,309,743.09
其中：基金申购款	185,335,869.01	10,436,576.44	195,772,445.45
基金赎回款	-22,542,567.90	-2,920,134.46	-25,462,702.36
本期已分配利润	-123,278,245.18	-	-123,278,245.18
本期末	21,837,405.64	11,651,288.45	33,488,694.09

## 海富通欣荣混合 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	913,538.49	-5,380.71	908,157.78
本期期初	913,538.49	-5,380.71	908,157.78
本期利润	-9,827,710.66	-410,908.29	-10,238,618.95
本期基金份额交易产生的变动数	57,509,675.93	3,094,209.40	60,603,885.33
其中：基金申购款	70,731,555.72	3,027,960.84	73,759,516.56
基金赎回款	-13,221,879.79	66,248.56	-13,155,631.23
本期已分配利润	-44,412,347.53	-	-44,412,347.53
本期末	4,183,156.23	2,677,920.40	6,861,076.63

## 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	129,801.54	92,934.56
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	167,547.08	99,829.54
其他	61,865.57	1,797.03
合计	359,214.19	194,561.13

## 7.4.7.10 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	1,988,183,371.36	968,757,396.50
减：卖出股票成本总额	2,046,594,026.12	988,648,540.91
减：交易费用	4,999,233.67	2,298,911.69
买卖股票差价收入	-63,409,888.43	-22,190,056.10

### 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	391,412.76	223,397.76
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	216,798.64	386,082.80
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	608,211.40	609,480.56

#### 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	36,261,854.98	58,390,543.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	35,609,621.73	57,065,753.59
减：应计利息总额	435,270.98	938,665.76
减：交易费用	163.63	40.94
买卖债券差价收入	216,798.64	386,082.80

### 7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

### 7.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
股指期货投资收益（税前）	-1,729,980.00	829,060.00



股指期货差价收入应缴纳 增值税额	-2,552.62	-28,672.43
减：交易费用	50,001.63	11,082.73
合计	-1,782,534.25	789,304.84

#### 7.4.7.14 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	10,762,838.50	3,185,555.31
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	10,762,838.50	3,185,555.31

#### 7.4.7.15 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	3,876,059.71	-82,224,715.70
——股票投资	3,894,130.58	-82,240,809.39
——债券投资	-18,070.87	16,093.69
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	89,920.00	-
——权证投资	-	-
——股指期货	89,920.00	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	3,965,979.71	-82,224,715.70

**7.4.7.16 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	300,794.21	120,405.01
合计	300,794.21	120,405.01

**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	50,000.00	55,000.00
信息披露费	110,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	3,660.55	6,780.72
其他费用	1,200.00	1,200.00
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
合计	200,860.55	218,980.72

**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，本基金并无须作披露的或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露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
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构

法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	239,793,410.41	5.51%	366,269,685.25	22.68%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	176,058.89	5.52%	96,335.72	9.04%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	263,361.74	22.48%	99,138.26	31.53%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中

国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

#### 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	2,367,988.41	1,663,055.32
其中：应支付销售机构的客户维护 费	19,528.65	6,422.66
应支付基金管理人的净管理费	2,348,459.76	1,656,632.66

注：支付基金管理人海富通的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.60% / 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	591,997.20	415,763.86

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x 0.15% / 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

	海富通欣荣混合A	海富通欣荣混合C	合计
海通证券	-	3.65	3.65
海富通	-	148,551.42	148,551.42
合计	-	148,555.07	148,555.07
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		
	海富通欣荣混合A	海富通欣荣混合C	合计
海通证券	-	3.60	3.60
海富通	-	146,944.89	146,944.89
合计	-	146,948.49	146,948.49

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.20%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.20% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 × 0.20% / 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

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
交通银行	11,682,588.44	129,801.54	1,897,668.50	92,934.56

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	688234	天岳先进	网下发行	2,849	235,868.71
海通证券	688259	创耀科技	网下发行	1,595	106,227.00
海通证券	301228	实朴检测	网下发行	3,721	74,717.68

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 7.4.11 利润分配情况

海富通欣荣混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份 额分红	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润 分配合计	备注
----	-------	-----	----------------------	--------------	-------------------	--------------	----

			数				
1	2023-06-27	2023-06-27	3.159	68,964,400.20	54,313,844.98	123,278,245.18	-
合计			3.159	68,964,400.20	54,313,844.98	123,278,245.18	-

海富通欣荣混合 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2023-06-27	2023-06-27	3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-
合计			3.159	44,127,915.94	284,431.59	44,412,347.53	-

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

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001378	德冠新材	2023-10-23	6个月	新股锁定	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股锁定	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	新股锁定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-

30127 2	英华 特	2023- 07-06	6 个 月	新股 锁定	51.39	53.38	173	8,890. 47	9,234. 74	-
30129 1	明阳 电气	2023- 06-21	6 个 月	新股 锁定	38.13	28.36	1,101	41,98 1.13	31,22 4.36	-
30129 2	海科 新源	2023- 06-29	6 个 月	新股 锁定	19.99	19.35	583	11,65 4.17	11,28 1.05	-
30132 9	信音 电子	2023- 07-05	6 个 月	新股 锁定	21.00	22.23	458	9,618. 00	10,18 1.34	-
30137 1	敷尔 佳	2023- 07-24	6 个 月	新股 锁定	55.68	37.58	391	21,77 0.88	14,69 3.78	-
30141 8	协昌 科技	2023- 08-10	6 个 月	新股 锁定	51.88	50.20	189	9,805. 32	9,487. 80	-
30148 8	豪恩 汽电	2023- 06-26	6 个 月	新股 锁定	39.78	69.09	262	10,42 2.36	18,10 1.58	-
30149 8	乖宝 宠物	2023- 08-09	6 个 月	新股 锁定	39.99	38.81	554	22,15 4.46	21,50 0.74	-
30150 0	飞南 资源	2023- 09-13	6 个 月	新股 锁定	23.97	20.89	455	10,90 6.35	9,504. 95	-
30150 5	苏州 规划	2023- 07-12	6 个 月	新股 锁定	26.35	35.81	194	5,111. 90	6,947. 14	-
30150 7	民生 健康	2023- 08-24	6 个 月	新股 锁定	10.00	15.85	851	8,510. 00	13,48 8.35	-
30151 5	港通 医疗	2023- 07-13	6 个 月	新股 锁定	31.16	28.27	230	7,166. 80	6,502. 10	-
30151 7	陕西 华达	2023- 10-09	6 个 月	新股 锁定	26.87	43.69	185	4,970. 95	8,082. 65	-
30151 9	舜禹 股份	2023- 07-19	6 个 月	新股 锁定	20.93	20.21	442	9,251. 06	8,932. 82	-
30152 0	万邦 医药	2023- 09-18	6 个 月	新股 锁定	67.88	52.74	160	10,86 0.80	8,438. 40	-
30152 8	多浦 乐	2023- 08-17	6 个 月	新股 锁定	71.80	68.91	148	10,62 6.40	10,19 8.68	-
30155 0	斯菱 股份	2023- 09-06	6 个 月	新股 锁定	37.56	43.57	260	9,765. 60	11,32 8.20	-
30155 5	惠柏 新材	2023- 10-24	6 个 月	新股 锁定	22.88	32.44	224	5,125. 12	7,266. 56	-
30155 9	中集 环科	2023- 09-26	6 个 月	新股 锁定	24.22	18.24	635	15,37 9.70	11,58 2.40	-
30156 6	达利 凯普	2023- 12-22	6 个 月	新股 锁定	8.90	22.14	576	5,126. 40	12,75 2.64	-
30157 8	辰奕 智能	2023- 12-21	6 个 月	新股 锁定	48.94	68.32	118	5,774. 92	8,061. 76	-
60311 9	浙江 荣泰	2023- 07-21	6 个 月	新股 锁定	15.32	23.87	226	3,462. 32	5,394. 62	-



60327 6	恒兴 新材	2023- 09-18	6 个 月	新股 锁定	25.73	24.88	134	3,447. 82	3,333. 92	-
68845 0	光格 科技	2023- 07-17	6 个 月	新股 锁定	53.09	36.42	167	8,866. 03	6,082. 14	-
68856 3	航材 股份	2023- 07-12	6 个 月	新股 锁定	78.99	60.49	523	41,31 1.77	31,63 6.27	-
68860 2	康鹏 科技	2023- 07-13	6 个 月	新股 锁定	8.66	11.06	1,066	9,231. 56	11,78 9.96	-
68860 3	天承 科技	2023- 06-30	6 个 月	新股 锁定	55.00	74.14	140	7,700. 00	10,37 9.60	-
68861 0	埃科 光电	2023- 07-10	6 个 月	新股 锁定	73.33	51.00	275	20,16 5.75	14,02 5.00	-
68864 6	逸飞 激光	2023- 07-21	6 个 月	新股 锁定	46.80	36.07	219	10,24 9.20	7,899. 33	-
68865 2	京仪 装备	2023- 11-22	6 个 月	新股 锁定	31.95	52.25	410	13,09 9.50	21,42 2.50	-
68865 7	浩辰 软件	2023- 09-25	6 个 月	新股 锁定	103.4 0	78.23	101	10,44 3.40	7,901. 23	-
68867 1	碧兴 物联	2023- 08-02	6 个 月	新股 锁定	36.12	34.30	226	8,163. 12	7,751. 80	-
68870 2	盛科 通信	2023- 09-06	6 个 月	新股 锁定	42.66	48.18	354	15,10 1.64	17,05 5.72	-

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

#### 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

本基金是一只混合型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

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于信用良好的银行，与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。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券（2022 年 12 月 31 日：0.07%）。

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	21,102,181.15	3,950,079.21
合计	21,102,181.15	3,950,079.21

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

#### 7.4.13.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	63,993.62
未评级	-	-
合计	-	63,993.62

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

##### 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在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度

指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

#### **7.4.13.4 市场风险**

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

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

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

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

#### 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	11,682,588.44	-	-	-	11,682,588.44
结算备付金	10,149,972.83	-	-	-	10,149,972.83
存出保证金	243,006.89	-	-	1,244,088.00	1,487,094.89
交易性金融资产	21,102,181.15	-	-	405,510,557.25	426,612,738.40
应收清算款	-	-	-	447,220.20	447,220.20
应收申购款	-	-	-	29.98	29.98
资产总计	43,177,749.31	-	-	407,201,895.43	450,379,644.74
负债					
应付清算款	-	-	-	7,734,809.56	7,734,809.56
应付赎回款	-	-	-	2,223.05	2,223.05
应付管理人报酬	-	-	-	243,774.21	243,774.21
应付托管费	-	-	-	60,943.58	60,943.58
应付销售服务费	-	-	-	13,551.17	13,551.17
其他负债	-	-	-	1,225,351.74	1,225,351.74
负债总计	-	-	-	9,280,653.31	9,280,653.31
利率敏感度缺口	43,177,749.31	-	-	397,921,242.12	441,098,991.43
上年度末 2022年12月	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

31 日					
资产					
货币资金	1,897,668.50	-	-	-	1,897,668.50
结算备付金	1,048,562.31	-	-	-	1,048,562.31
存出保证金	76,656.92	-	-	-	76,656.92
交易性金融资产	3,950,079.21	-	63,993.62	81,106,416.21	85,120,489.04
应收清算款	-	-	-	875,146.63	875,146.63
应收申购款	-	-	-	67.99	67.99
资产总计	6,972,966.94	-	63,993.62	81,981,630.83	89,018,591.39
负债					
应付赎回款	-	-	-	755,427.74	755,427.74
应付管理人报酬	-	-	-	71,839.45	71,839.45
应付托管费	-	-	-	17,959.86	17,959.86
应付销售服务费	-	-	-	4,189.53	4,189.53
应交税费	-	-	-	0.49	0.49
其他负债	-	-	-	489,465.89	489,465.89
负债总计	-	-	-	1,338,882.96	1,338,882.96
利率敏感度缺口	6,972,966.94	-	63,993.62	80,642,747.87	87,679,708.43

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-2,382.82	-3,957.20
市场利率下降 25 个基点	2,389.01	3,982.85	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资及存托凭证比例为基金总资产的 0%-95%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时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	405,510,557.25	91.93	81,106,416.21	92.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	405,510,557.25	91.93	81,106,416.21	92.50

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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

1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	17,286,318.77	4,269,362.33
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-17,286,318.77	-4,269,362.33

#### 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	405,067,000.40	80,519,953.31
第二层次	21,102,181.15	4,074,951.21
第三层次	443,556.85	525,584.52
合计	426,612,738.40	85,120,489.04

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	525,584.52	525,584.52
当期购买	-	-	-



当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	493,738.34	493,738.34
转出第三层次	-	677,686.52	677,686.52
当期利得或损失总额	-	101,920.51	101,920.51
其中：计入损益的利得或损失	-	101,920.51	101,920.51
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	443,556.85	443,556.85
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	205.67	205.67
项目	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,975,001.38	1,975,001.38
转出第三层次	-	1,843,733.92	1,843,733.92
当期利得或损失总额	-	394,317.06	394,317.06
其中：计入损益的利得或损失	-	394,317.06	394,317.06
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	525,584.52	525,584.52
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	13,610.86	13,610.86

注：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资（2022年12月31日：同）。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2022年度：同）。

计入损益的利得或损失计入利润表中的投资收益及公允价值变动损益项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	443,556.85	亚式期权模	预期年化波	19.62%~194.82%	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	525,584.52	亚式期权模型	预期年化波动率	20.63%~247.56%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2022 年 12 月 31 日：无）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	405,510,557.25	90.04
	其中：股票	405,510,557.25	90.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,102,181.15	4.69
	其中：债券	21,102,181.15	4.69
	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	21,832,561.27	4.85
8	其他各项资产	1,934,345.07	0.43
9	合计	450,379,644.74	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	30,090.00	0.01
B	采矿业	22,055,942.88	5.00
C	制造业	257,928,598.89	58.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,720,817.00	4.47
E	建筑业	13,433,915.00	3.05
F	批发和零售业	19,988,132.40	4.53
G	交通运输、仓储和邮政业	7,258,579.00	1.65
H	住宿和餐饮业	60,918.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,713,637.67	4.92
J	金融业	19,086,026.08	4.33
K	房地产业	1,221,480.00	0.28
L	租赁和商务服务业	8,520,918.00	1.93
M	科学研究和技术服务业	8,649,901.69	1.96
N	水利、环境和公共设施管理业	154,834.82	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	70,413.00	0.02
Q	卫生和社会工作	4,110,139.82	0.93
R	文化、体育和娱乐业	497,147.00	0.11
S	综合	1,009,066.00	0.23
	合计	405,510,557.25	91.93

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金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	300130	新国都	283,600	6,863,120.00	1.56
2	600519	贵州茅台	3,400	5,868,400.00	1.33
3	600900	长江电力	232,400	5,424,216.00	1.23
4	601138	工业富联	350,000	5,292,000.00	1.20
5	002027	分众传媒	811,600	5,129,312.00	1.16
6	002126	银轮股份	271,800	5,074,506.00	1.15
7	300592	华凯易佰	203,200	5,033,264.00	1.14
8	600941	中国移动	49,500	4,924,260.00	1.12
9	000034	神州数码	162,200	4,851,402.00	1.10
10	603556	海兴电力	163,500	4,746,405.00	1.08
11	601899	紫金矿业	374,600	4,667,516.00	1.06
12	300791	仙乐健康	130,200	4,512,732.00	1.02
13	600422	昆药集团	214,300	4,470,298.00	1.01
14	601601	中国太保	186,200	4,427,836.00	1.00
15	000921	海信家电	209,500	4,273,800.00	0.97
16	002600	领益智造	616,200	4,165,512.00	0.94
17	300416	苏试试验	223,845	4,112,032.65	0.93
18	600820	隧道股份	672,400	3,873,024.00	0.88
19	688012	中微公司	23,655	3,633,408.00	0.82
20	600795	国电电力	866,200	3,603,392.00	0.82
21	601668	中国建筑	744,800	3,582,488.00	0.81
22	300866	安克创新	40,300	3,570,580.00	0.81
23	000400	许继电气	155,098	3,405,952.08	0.77
24	600150	中国船舶	114,400	3,367,936.00	0.76
25	600989	宝丰能源	226,200	3,340,974.00	0.76
26	603035	常熟汽饰	177,000	3,339,990.00	0.76
27	603730	岱美股份	219,475	3,180,192.75	0.72
28	600901	江苏金租	647,780	3,135,255.20	0.71
29	300832	新产业	39,500	3,088,900.00	0.70
30	002475	立讯精密	88,891	3,062,294.95	0.69
31	600970	中材国际	310,500	2,900,070.00	0.66
32	600919	江苏银行	429,800	2,875,362.00	0.65
33	300604	长川科技	72,200	2,742,878.00	0.62
34	603518	锦泓集团	263,000	2,635,260.00	0.60
35	002011	盾安环境	191,400	2,631,750.00	0.60
36	603993	洛阳钼业	505,500	2,628,600.00	0.60
37	002345	潮宏基	384,800	2,620,488.00	0.59

38	601088	中国神华	82,700	2,592,645.00	0.59
39	002463	沪电股份	116,800	2,583,616.00	0.59
40	300037	新宙邦	54,210	2,564,133.00	0.58
41	002444	巨星科技	113,086	2,546,696.72	0.58
42	603979	金诚信	67,200	2,537,472.00	0.58
43	300482	万孚生物	83,900	2,531,263.00	0.57
44	000338	潍柴动力	184,600	2,519,790.00	0.57
45	000589	贵州轮胎	405,500	2,481,660.00	0.56
46	002540	亚太科技	372,600	2,462,886.00	0.56
47	601717	郑煤机	189,100	2,392,115.00	0.54
48	601288	农业银行	653,900	2,380,196.00	0.54
49	605090	九丰能源	85,100	2,376,843.00	0.54
50	000700	模塑科技	339,500	2,376,500.00	0.54
51	601001	晋控煤业	189,900	2,341,467.00	0.53
52	002353	杰瑞股份	81,600	2,293,776.00	0.52
53	300244	迪安诊断	95,900	2,283,379.00	0.52
54	600161	天坛生物	73,080	2,261,095.20	0.51
55	600803	新奥股份	132,800	2,233,696.00	0.51
56	002028	思源电气	42,800	2,227,312.00	0.50
57	603596	伯特利	31,500	2,182,950.00	0.49
58	603368	柳药集团	113,400	2,145,528.00	0.49
59	603300	华铁应急	331,300	2,120,320.00	0.48
60	600060	海信视像	100,300	2,096,270.00	0.48
61	000933	神火股份	123,500	2,074,800.00	0.47
62	601689	拓普集团	28,200	2,072,700.00	0.47
63	601985	中国核电	271,100	2,033,250.00	0.46
64	600710	苏美达	280,200	1,986,618.00	0.45
65	002179	中航光电	49,926	1,947,114.00	0.44
66	600976	健民集团	29,800	1,944,450.00	0.44
67	002130	沃尔核材	254,900	1,924,495.00	0.44
68	301376	致欧科技	80,120	1,916,470.40	0.43
69	300002	神州泰岳	213,700	1,891,245.00	0.43
70	601567	三星医疗	92,200	1,890,100.00	0.43
71	300760	迈瑞医疗	6,500	1,888,900.00	0.43
72	603558	健盛集团	194,400	1,883,736.00	0.43
73	002555	三七互娱	99,500	1,871,595.00	0.42
74	002429	兆驰股份	328,300	1,831,914.00	0.42
75	000895	双汇发展	67,600	1,805,596.00	0.41
76	600993	马应龙	74,500	1,801,410.00	0.41
77	002154	报喜鸟	304,700	1,730,696.00	0.39
78	300873	海晨股份	71,700	1,707,177.00	0.39
79	688169	石头科技	5,967	1,688,362.65	0.38
80	601857	中国石油	238,400	1,683,104.00	0.38
81	002252	上海莱士	208,000	1,664,000.00	0.38

82	600380	健康元	131,000	1,628,330.00	0.37
83	002967	广电计量	108,400	1,627,084.00	0.37
84	600572	康恩贝	321,100	1,621,555.00	0.37
85	000423	东阿阿胶	32,600	1,607,832.00	0.36
86	002920	德赛西威	12,400	1,605,924.00	0.36
87	002318	久立特材	79,700	1,584,436.00	0.36
88	300319	麦捷科技	163,600	1,577,104.00	0.36
89	600497	驰宏锌锗	309,000	1,560,450.00	0.35
90	603882	金域医学	24,628	1,540,973.96	0.35
91	000065	北方国际	135,000	1,514,700.00	0.34
92	000039	中集集团	189,700	1,451,205.00	0.33
93	601126	四方股份	100,700	1,425,912.00	0.32
94	600583	海油工程	238,400	1,416,096.00	0.32
95	688520	神州细胞	25,826	1,391,246.62	0.32
96	000063	中兴通讯	51,800	1,371,664.00	0.31
97	300274	阳光电源	15,600	1,366,404.00	0.31
98	002223	鱼跃医疗	38,900	1,345,162.00	0.30
99	002371	北方华创	5,400	1,326,834.00	0.30
100	001965	招商公路	135,400	1,322,858.00	0.30
101	601500	通用股份	313,300	1,297,062.00	0.29
102	600933	爱柯迪	59,100	1,296,654.00	0.29
103	601728	中国电信	239,600	1,296,236.00	0.29
104	301356	天振股份	71,000	1,291,490.00	0.29
105	601989	中国重工	311,000	1,284,430.00	0.29
106	601666	平煤股份	109,600	1,266,976.00	0.29
107	300908	仲景食品	30,500	1,258,735.00	0.29
108	601658	邮储银行	283,900	1,234,965.00	0.28
109	603611	诺力股份	64,800	1,226,664.00	0.28
110	605368	蓝天燃气	112,900	1,215,933.00	0.28
111	600399	抚顺特钢	124,500	1,210,140.00	0.27
112	000333	美的集团	21,864	1,194,430.32	0.27
113	688376	美埃科技	31,146	1,183,236.54	0.27
114	603055	台华新材	97,800	1,177,512.00	0.27
115	300782	卓胜微	8,300	1,170,300.00	0.27
116	601390	中国中铁	202,900	1,152,472.00	0.26
117	603112	华翔股份	94,700	1,150,605.00	0.26
118	300926	博俊科技	38,500	1,129,205.00	0.26
119	688091	上海谊众	17,601	1,126,464.00	0.26
120	000625	长安汽车	66,600	1,120,878.00	0.25
121	002452	长高电新	157,600	1,118,960.00	0.25
122	603661	恒林股份	25,100	1,118,707.00	0.25
123	002987	京北方	58,200	1,081,356.00	0.25
124	600012	皖通高速	95,400	1,051,308.00	0.24
125	002937	兴瑞科技	40,300	1,050,218.00	0.24

126	600612	老凤祥	14,800	1,021,200.00	0.23
127	600603	广汇物流	129,700	1,009,066.00	0.23
128	600276	恒瑞医药	22,200	1,004,106.00	0.23
129	002078	太阳纸业	81,920	996,966.40	0.23
130	601208	东材科技	79,200	980,496.00	0.22
131	600548	深高速	108,600	976,314.00	0.22
132	601916	浙商银行	386,700	974,484.00	0.22
133	600030	中信证券	47,600	969,612.00	0.22
134	600363	联创光电	28,500	969,000.00	0.22
135	300129	泰胜风能	89,300	961,761.00	0.22
136	603444	吉比特	3,900	955,968.00	0.22
137	688676	金盘科技	26,622	953,866.26	0.22
138	003000	劲仔食品	76,900	939,718.00	0.21
139	600584	长电科技	31,300	934,618.00	0.21
140	600131	国网信通	61,500	931,725.00	0.21
141	601398	工商银行	194,600	930,188.00	0.21
142	688001	华兴源创	26,538	927,503.10	0.21
143	600479	千金药业	85,000	915,450.00	0.21
144	605599	菜百股份	61,300	912,757.00	0.21
145	600415	小商品城	124,400	910,608.00	0.21
146	000543	皖能电力	143,700	899,562.00	0.20
147	000997	新大陆	45,600	894,216.00	0.20
148	688016	心脉医疗	4,586	892,573.18	0.20
149	688401	路维光电	29,038	892,047.36	0.20
150	300408	三环集团	30,120	887,034.00	0.20
151	300181	佐力药业	83,100	885,846.00	0.20
152	603889	新澳股份	124,400	885,728.00	0.20
153	002533	金杯电工	109,300	883,144.00	0.20
154	605319	无锡振华	37,800	870,156.00	0.20
155	688506	百利天恒	6,140	858,986.00	0.19
156	000960	锡业股份	59,900	857,768.00	0.19
157	002643	万润股份	51,500	854,385.00	0.19
158	002273	水晶光电	62,900	851,666.00	0.19
159	603050	科林电气	47,440	851,548.00	0.19
160	601038	一拖股份	58,300	849,431.00	0.19
161	688772	珠海冠宇	38,288	842,718.88	0.19
162	603393	新天然气	27,500	840,675.00	0.19
163	002138	顺络电子	31,100	840,011.00	0.19
164	601021	春秋航空	16,700	838,340.00	0.19
165	300354	东华测试	16,800	834,456.00	0.19
166	603228	景旺电子	36,800	830,208.00	0.19
167	603308	应流股份	57,800	828,274.00	0.19
168	600577	精达股份	199,600	826,344.00	0.19
169	002276	万马股份	80,500	822,710.00	0.19

170	002807	江阴银行	231,200	820,760.00	0.19
171	002014	永新股份	98,100	819,135.00	0.19
172	300639	凯普生物	87,400	816,316.00	0.19
173	301096	百诚医药	12,500	813,750.00	0.18
174	603128	华贸物流	109,700	810,683.00	0.18
175	600699	均胜电子	45,100	809,996.00	0.18
176	603501	韦尔股份	7,500	800,325.00	0.18
177	600587	新华医疗	31,000	799,490.00	0.18
178	600395	盘江股份	128,800	794,696.00	0.18
179	300303	聚飞光电	134,000	794,620.00	0.18
180	600875	东方电气	54,300	793,866.00	0.18
181	300406	九强生物	41,400	790,740.00	0.18
182	002446	盛路通信	94,500	784,350.00	0.18
183	688037	芯源微	5,865	783,622.65	0.18
184	688073	毕得医药	14,051	779,830.50	0.18
185	688072	拓荆科技	3,363	777,861.90	0.18
186	002478	常宝股份	142,100	774,445.00	0.18
187	000811	冰轮环境	56,800	770,776.00	0.17
188	600867	通化东宝	71,100	770,013.00	0.17
189	301095	广立微	10,300	769,719.00	0.17
190	603187	海容冷链	50,660	768,005.60	0.17
191	603707	健友股份	51,200	768,000.00	0.17
192	601211	国泰君安	51,600	767,808.00	0.17
193	688078	龙软科技	18,726	755,032.32	0.17
194	002025	航天电器	15,700	753,914.00	0.17
195	301179	泽宇智能	29,000	752,550.00	0.17
196	300174	元力股份	46,800	749,268.00	0.17
197	002558	巨人网络	67,200	748,608.00	0.17
198	300088	长信科技	111,800	747,942.00	0.17
199	300428	立中集团	35,200	743,424.00	0.17
200	300687	赛意信息	33,700	733,986.00	0.17
201	002737	葵花药业	28,100	730,038.00	0.17
202	002015	协鑫能科	58,700	726,706.00	0.16
203	301227	森鹰窗业	26,700	722,769.00	0.16
204	688612	威迈斯	18,325	713,758.75	0.16
205	300026	红日药业	167,800	711,472.00	0.16
206	603298	杭叉集团	28,400	706,592.00	0.16
207	300384	三联虹普	42,900	684,684.00	0.16
208	688503	聚和材料	12,746	683,185.60	0.15
209	002984	森麒麟	23,600	680,860.00	0.15
210	600216	浙江医药	61,700	662,041.00	0.15
211	600665	天地源	169,300	639,954.00	0.15
212	003020	立方制药	22,500	633,375.00	0.14
213	688111	金山办公	1,876	593,191.20	0.13



214	300415	伊之密	33,200	585,316.00	0.13
215	001311	多利科技	11,400	564,414.00	0.13
216	000059	华锦股份	90,000	494,100.00	0.11
217	603380	易德龙	18,900	484,029.00	0.11
218	600223	福瑞达	47,700	459,351.00	0.10
219	300442	润泽科技	17,800	451,586.00	0.10
220	002469	三维化学	73,400	444,804.00	0.10
221	300833	浩洋股份	4,900	441,490.00	0.10
222	000568	泸州老窖	2,400	430,608.00	0.10
223	600570	恒生电子	14,000	402,640.00	0.09
224	300770	新媒股份	10,300	398,404.00	0.09
225	300638	广和通	20,480	389,734.40	0.09
226	600809	山西汾酒	1,680	387,626.40	0.09
227	300979	华利集团	7,300	384,272.00	0.09
228	688257	新锐股份	14,431	361,352.24	0.08
229	300124	汇川技术	4,850	306,229.00	0.07
230	002415	海康威视	8,276	287,342.72	0.07
231	600309	万华化学	3,700	284,234.00	0.06
232	300015	爱尔眼科	17,723	280,377.86	0.06
233	600522	中天科技	21,800	272,282.00	0.06
234	605555	德昌股份	11,900	271,915.00	0.06
235	002180	纳思达	12,000	271,560.00	0.06
236	000650	仁和药业	40,700	269,841.00	0.06
237	000651	格力电器	7,700	247,709.00	0.06
238	002978	安宁股份	7,700	243,782.00	0.06
239	300750	宁德时代	1,480	241,624.80	0.05
240	002410	广联达	14,000	239,960.00	0.05
241	300957	贝泰妮	3,500	238,595.00	0.05
242	300012	华测检测	16,500	234,300.00	0.05
243	000090	天健集团	50,100	230,460.00	0.05
244	300566	激智科技	12,300	229,764.00	0.05
245	601633	长城汽车	9,100	229,502.00	0.05
246	688008	澜起科技	3,900	229,164.00	0.05
247	605369	拱东医疗	4,100	228,862.00	0.05
248	002129	TCL 中环	14,600	228,344.00	0.05
249	600426	华鲁恒升	8,090	223,203.10	0.05
250	603833	欧派家居	3,200	222,752.00	0.05
251	603100	川仪股份	7,900	218,988.00	0.05
252	000725	京东方 A	56,100	218,790.00	0.05
253	001215	千味央厨	4,100	216,521.00	0.05
254	301208	中亦科技	5,500	214,720.00	0.05
255	300585	奥联电子	12,800	214,528.00	0.05
256	300409	道氏技术	19,100	212,774.00	0.05
257	601636	旗滨集团	31,100	212,724.00	0.05

258	002532	天山铝业	35,100	210,951.00	0.05
259	600481	双良节能	24,800	209,808.00	0.05
260	603896	寿仙谷	6,500	209,560.00	0.05
261	301248	杰创智能	11,900	209,559.00	0.05
262	601888	中国中免	2,500	209,225.00	0.05
263	603181	皇马科技	19,100	208,763.00	0.05
264	601388	怡球资源	79,100	207,242.00	0.05
265	301345	涛涛车业	3,400	207,060.00	0.05
266	603866	桃李面包	27,000	206,820.00	0.05
267	603989	艾华集团	9,600	206,592.00	0.05
268	301231	荣信文化	8,100	206,145.00	0.05
269	300365	恒华科技	30,400	205,504.00	0.05
270	000062	深圳华强	18,200	205,114.00	0.05
271	002960	青鸟消防	14,800	204,832.00	0.05
272	605208	永茂泰	21,500	204,250.00	0.05
273	301029	怡合达	7,900	203,662.00	0.05
274	603222	济民医疗	25,400	203,454.00	0.05
275	300326	凯利泰	32,000	202,560.00	0.05
276	603018	华设集团	26,600	202,160.00	0.05
277	002330	得利斯	36,300	201,828.00	0.05
278	600581	八一钢铁	56,000	201,040.00	0.05
279	600556	天下秀	34,000	200,940.00	0.05
280	688221	前沿生物	20,200	200,384.00	0.05
281	002064	华峰化学	29,700	199,287.00	0.05
282	300253	卫宁健康	27,700	199,163.00	0.05
283	603113	金能科技	24,400	196,908.00	0.04
284	301162	国能日新	3,700	191,956.00	0.04
285	688556	高测股份	4,748	185,124.52	0.04
286	600229	城市传媒	24,300	183,465.00	0.04
287	002929	润建股份	4,200	175,266.00	0.04
288	300647	超频三	27,100	173,982.00	0.04
289	300204	舒泰神	17,000	172,720.00	0.04
290	600029	南方航空	29,000	167,040.00	0.04
291	002088	鲁阳节能	10,800	153,900.00	0.03
292	603195	公牛集团	1,572	150,361.80	0.03
293	603886	元祖股份	8,000	145,840.00	0.03
294	600845	宝信软件	2,867	139,909.60	0.03
295	600271	航天信息	12,700	135,128.00	0.03
296	000948	南天信息	8,900	134,123.00	0.03
297	002832	比音勒芬	4,000	126,800.00	0.03
298	002966	苏州银行	19,400	125,324.00	0.03
299	002483	润邦股份	22,800	119,016.00	0.03
300	301129	瑞纳智能	4,460	118,769.80	0.03
301	300246	宝莱特	11,000	113,300.00	0.03

302	003816	中国广核	36,400	113,204.00	0.03
303	300741	华宝股份	5,100	109,191.00	0.02
304	688678	福立旺	5,900	108,619.00	0.02
305	688299	长阳科技	7,600	106,020.00	0.02
306	603898	好莱客	9,500	104,215.00	0.02
307	003026	中晶科技	2,900	103,820.00	0.02
308	002084	海鸥住工	26,000	103,480.00	0.02
309	603311	金海高科	9,900	102,366.00	0.02
310	603811	诚意药业	9,800	101,626.00	0.02
311	300452	山河药辅	7,100	101,104.00	0.02
312	688175	高凌信息	3,600	100,548.00	0.02
313	603215	比依股份	5,700	98,610.00	0.02
314	603755	日辰股份	3,700	98,346.00	0.02
315	600475	华光环能	9,100	94,640.00	0.02
316	002841	视源股份	2,000	91,520.00	0.02
317	600066	宇通客车	6,400	84,800.00	0.02
318	300421	力星股份	6,250	80,687.50	0.02
319	605167	利柏特	8,500	80,665.00	0.02
320	002818	富森美	6,400	79,744.00	0.02
321	601186	中国铁建	10,400	79,144.00	0.02
322	000538	云南白药	1,600	78,640.00	0.02
323	002332	仙琚制药	5,985	76,428.45	0.02
324	300102	乾照光电	10,000	73,500.00	0.02
325	601838	成都银行	6,500	73,190.00	0.02
326	600580	卧龙电驱	6,200	72,726.00	0.02
327	601702	华峰铝业	3,900	70,005.00	0.02
328	601006	大秦铁路	9,700	69,937.00	0.02
329	605168	三人行	1,100	69,696.00	0.02
330	002461	珠江啤酒	8,800	69,520.00	0.02
331	002372	伟星新材	4,800	69,456.00	0.02
332	603927	中科软	2,300	68,954.00	0.02
333	600062	华润双鹤	3,700	68,820.00	0.02
334	603338	浙江鼎力	1,300	66,521.00	0.02
335	600350	山东高速	9,400	65,236.00	0.01
336	300532	今天国际	3,900	64,038.00	0.01
337	688589	力合微	1,604	64,015.64	0.01
338	600036	招商银行	2,300	63,986.00	0.01
339	600529	山东药玻	2,480	63,488.00	0.01
340	600745	闻泰科技	1,500	63,465.00	0.01
341	603259	药明康德	870	63,301.20	0.01
342	002674	兴业科技	5,200	63,284.00	0.01
343	600750	江中药业	3,000	62,640.00	0.01
344	002701	奥瑞金	14,900	61,686.00	0.01
345	002430	杭氧股份	2,100	61,341.00	0.01

346	300811	铂科新材	1,160	61,329.20	0.01
347	600258	首旅酒店	3,900	60,918.00	0.01
348	600886	国投电力	4,600	60,628.00	0.01
349	300830	金现代	7,500	60,525.00	0.01
350	600019	宝钢股份	10,100	59,893.00	0.01
351	600690	海尔智家	2,800	58,800.00	0.01
352	603369	今世缘	1,200	58,500.00	0.01
353	000938	紫光股份	3,000	58,050.00	0.01
354	600557	康缘药业	2,800	57,456.00	0.01
355	601318	中国平安	1,400	56,420.00	0.01
356	601800	中国交建	7,400	56,240.00	0.01
357	601766	中国中车	10,600	55,756.00	0.01
358	603699	纽威股份	4,000	55,440.00	0.01
359	600219	南山铝业	18,700	54,978.00	0.01
360	600008	首创环保	20,300	54,607.00	0.01
361	688626	翔宇医疗	1,021	54,409.09	0.01
362	301166	优宁维	1,400	53,788.00	0.01
363	600109	国金证券	5,900	53,572.00	0.01
364	600061	国投资本	7,900	53,246.00	0.01
365	601577	长沙银行	7,600	51,832.00	0.01
366	300223	北京君正	800	51,720.00	0.01
367	300718	长盛轴承	2,700	50,085.00	0.01
368	688036	传音控股	361	49,962.40	0.01
369	688332	中科蓝讯	661	49,852.62	0.01
370	000975	银泰黄金	3,300	49,500.00	0.01
371	600535	天士力	2,900	49,358.00	0.01
372	002266	浙富控股	14,500	49,300.00	0.01
373	603667	五洲新春	2,100	49,140.00	0.01
374	603355	莱克电气	2,200	49,060.00	0.01
375	603816	顾家家居	1,400	49,000.00	0.01
376	688385	复旦微电	1,250	48,287.50	0.01
377	600985	淮北矿业	2,900	48,227.00	0.01
378	002648	卫星化学	3,252	47,967.00	0.01
379	002876	三利谱	1,300	47,801.00	0.01
380	603600	永艺股份	4,300	47,472.00	0.01
381	603328	依顿电子	5,800	47,270.00	0.01
382	603662	柯力传感	1,300	46,787.00	0.01
383	300226	上海钢联	1,640	46,723.60	0.01
384	688097	博众精工	1,389	46,670.40	0.01
385	002315	焦点科技	1,400	46,382.00	0.01
386	600582	天地科技	8,500	46,240.00	0.01
387	600642	申能股份	7,200	46,224.00	0.01
388	603986	兆易创新	500	46,195.00	0.01
389	603799	华友钴业	1,400	46,102.00	0.01

390	002073	软控股份	7,000	45,990.00	0.01
391	002050	三花智控	1,564	45,981.60	0.01
392	002439	启明星辰	1,700	45,900.00	0.01
393	300122	智飞生物	750	45,832.50	0.01
394	300951	博硕科技	700	45,346.00	0.01
395	600893	航发动力	1,200	44,856.00	0.01
396	000429	粤高速 A	5,300	44,838.00	0.01
397	605589	圣泉集团	2,000	44,760.00	0.01
398	300224	正海磁材	3,800	44,536.00	0.01
399	000983	山西焦煤	4,500	44,460.00	0.01
400	000661	长春高新	300	43,740.00	0.01
401	688041	海光信息	615	43,652.70	0.01
402	603688	石英股份	500	43,440.00	0.01
403	000100	TCL 科技	10,100	43,430.00	0.01
404	300192	科德教育	4,400	43,428.00	0.01
405	688187	时代电气	1,191	43,269.03	0.01
406	600160	巨化股份	2,600	42,874.00	0.01
407	002833	弘亚数控	2,400	42,576.00	0.01
408	003006	百亚股份	2,800	42,448.00	0.01
409	002236	大华股份	2,300	42,435.00	0.01
410	600023	浙能电力	9,200	42,412.00	0.01
411	002864	盘龙药业	1,100	42,339.00	0.01
412	688668	鼎通科技	765	42,319.80	0.01
413	000630	铜陵有色	12,900	42,312.00	0.01
414	600064	南京高科	7,000	42,280.00	0.01
415	605117	德业股份	500	41,950.00	0.01
416	300693	盛弘股份	1,400	41,874.00	0.01
417	002384	东山精密	2,300	41,814.00	0.01
418	300435	中泰股份	2,900	41,702.00	0.01
419	002595	豪迈科技	1,400	41,678.00	0.01
420	600459	贵研铂业	2,900	41,644.00	0.01
421	600188	兖矿能源	2,100	41,601.00	0.01
422	000963	华东医药	1,000	41,460.00	0.01
423	000028	国药一致	1,400	40,586.00	0.01
424	300601	康泰生物	1,480	40,182.00	0.01
425	600765	中航重机	2,100	40,131.00	0.01
426	002158	汉钟精机	1,800	40,068.00	0.01
427	600511	国药股份	1,400	40,068.00	0.01
428	600761	安徽合力	2,200	40,062.00	0.01
429	300569	天能重工	5,600	40,040.00	0.01
430	688301	奕瑞科技	123	40,006.98	0.01
431	603650	彤程新材	1,200	39,960.00	0.01
432	603296	华勤技术	500	39,945.00	0.01
433	601921	浙版传媒	5,200	39,728.00	0.01

434	000932	华菱钢铁	7,700	39,655.00	0.01
435	300369	绿盟科技	4,200	39,606.00	0.01
436	688099	晶晨股份	631	39,519.53	0.01
437	000906	浙商中拓	5,400	39,474.00	0.01
438	301009	可靠股份	3,700	39,442.00	0.01
439	688357	建龙微纳	759	39,232.71	0.01
440	002517	恺英网络	3,500	39,095.00	0.01
441	300775	三角防务	1,400	39,060.00	0.01
442	600755	厦门国贸	5,600	39,032.00	0.01
443	002254	泰和新材	2,600	38,896.00	0.01
444	603619	中曼石油	2,100	38,892.00	0.01
445	300443	金雷股份	1,400	38,626.00	0.01
446	300773	拉卡拉	2,400	38,496.00	0.01
447	603239	浙江仙通	2,500	38,175.00	0.01
448	600861	北京人力	2,000	37,480.00	0.01
449	600600	青岛啤酒	500	37,375.00	0.01
450	600528	中铁工业	5,000	37,200.00	0.01
451	002897	意华股份	1,000	37,160.00	0.01
452	300857	协创数据	700	37,093.00	0.01
453	002139	拓邦股份	3,800	37,088.00	0.01
454	600908	无锡银行	7,300	36,865.00	0.01
455	601369	陕鼓动力	4,600	36,708.00	0.01
456	600998	九州通	5,200	36,452.00	0.01
457	600988	赤峰黄金	2,600	36,426.00	0.01
458	601816	京沪高铁	7,400	36,408.00	0.01
459	688128	中国电研	1,773	36,381.96	0.01
460	300682	朗新科技	2,200	36,058.00	0.01
461	603885	吉祥航空	3,000	36,000.00	0.01
462	002531	天顺风能	3,100	35,960.00	0.01
463	600233	圆通速递	2,900	35,641.00	0.01
464	000425	徐工机械	6,500	35,490.00	0.01
465	603306	华懋科技	1,300	35,243.00	0.01
466	002611	东方精工	7,100	35,216.00	0.01
467	000786	北新建材	1,500	35,040.00	0.01
468	688369	致远互联	1,007	34,852.27	0.01
469	600079	人福医药	1,400	34,804.00	0.01
470	688596	正帆科技	876	34,715.88	0.01
471	600566	济川药业	1,100	34,573.00	0.01
472	603383	顶点软件	700	34,510.00	0.01
473	600835	上海机电	2,900	34,423.00	0.01
474	600266	城建发展	7,100	34,364.00	0.01
475	002244	滨江集团	4,700	34,169.00	0.01
476	300627	华测导航	1,100	34,122.00	0.01
477	000922	佳电股份	3,300	33,891.00	0.01

478	300308	中际旭创	300	33,873.00	0.01
479	600595	中孚实业	9,700	33,756.00	0.01
480	603324	盛剑环境	1,100	33,407.00	0.01
481	603198	迎驾贡酒	500	33,145.00	0.01
482	603508	思维列控	2,100	32,970.00	0.01
483	300679	电连技术	794	32,951.00	0.01
484	301280	珠城科技	800	32,864.00	0.01
485	300396	迪瑞医疗	1,100	32,395.00	0.01
486	002311	海大集团	720	32,335.20	0.01
487	600887	伊利股份	1,200	32,100.00	0.01
488	000777	中核科技	2,200	31,988.00	0.01
489	300653	正海生物	1,100	31,922.00	0.01
490	688588	凌志软件	2,679	31,880.10	0.01
491	688563	航材股份	523	31,636.27	0.01
492	601000	唐山港	9,000	31,500.00	0.01
493	301291	明阳电气	1,101	31,224.36	0.01
494	688009	中国通号	7,089	31,049.82	0.01
495	603801	志邦家居	1,840	30,856.80	0.01
496	000950	重药控股	6,200	30,814.00	0.01
497	603859	能科科技	800	30,184.00	0.01
498	601881	中国银河	2,500	30,125.00	0.01
499	300498	温氏股份	1,500	30,090.00	0.01
500	688389	普门科技	1,326	29,848.26	0.01
501	000988	华工科技	1,000	29,760.00	0.01
502	000733	振华科技	500	29,420.00	0.01
503	601298	青岛港	4,700	29,046.00	0.01
504	603966	法兰泰克	3,500	28,630.00	0.01
505	300842	帝科股份	400	28,220.00	0.01
506	603305	旭升集团	1,424	28,095.52	0.01
507	002557	洽洽食品	800	27,856.00	0.01
508	300248	新开普	2,900	27,811.00	0.01
509	002705	新宝股份	1,900	27,683.00	0.01
510	605098	行动教育	700	26,985.00	0.01
511	603277	银都股份	1,000	26,820.00	0.01
512	300470	中密控股	700	26,460.00	0.01
513	000937	冀中能源	3,700	26,418.00	0.01
514	600373	中文传媒	2,000	26,360.00	0.01
515	600487	亨通光电	2,200	26,268.00	0.01
516	600438	通威股份	1,000	25,030.00	0.01
517	601117	中国化学	3,900	24,804.00	0.01
518	000596	古井贡酒	100	23,280.00	0.01
519	600740	山西焦化	4,544	22,901.76	0.01
520	603590	康辰药业	600	22,848.00	0.01
521	002698	博实股份	1,500	22,785.00	0.01

522	603920	世运电路	1,200	21,936.00	0.00
523	000923	河钢资源	1,300	21,840.00	0.00
524	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
525	688652	京仪装备	410	21,422.50	0.00
526	002334	英威腾	2,400	20,952.00	0.00
527	600063	皖维高新	4,800	20,640.00	0.00
528	300476	胜宏科技	1,100	20,295.00	0.00
529	300413	芒果超媒	800	20,160.00	0.00
530	688516	奥特维	220	19,910.00	0.00
531	300019	硅宝科技	1,200	19,812.00	0.00
532	002594	比亚迪	100	19,800.00	0.00
533	002541	鸿路钢构	908	19,730.84	0.00
534	002851	麦格米特	800	19,680.00	0.00
535	603203	快克智能	680	19,658.80	0.00
536	600456	宝钛股份	600	18,834.00	0.00
537	688239	航宇科技	382	18,248.14	0.00
538	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
539	688800	瑞可达	443	17,799.74	0.00
540	300628	亿联网络	600	17,730.00	0.00
541	300316	晶盛机电	400	17,636.00	0.00
542	002080	中材科技	1,100	17,512.00	0.00
543	603639	海利尔	1,100	17,270.00	0.00
544	300820	英杰电气	300	17,184.00	0.00
545	605377	华旺科技	900	17,181.00	0.00
546	688702	盛科通信	354	17,055.72	0.00
547	688208	道通科技	707	16,791.25	0.00
548	300351	永贵电器	800	16,576.00	0.00
549	601975	招商南油	5,900	16,520.00	0.00
550	000708	中信特钢	1,120	15,724.80	0.00
551	603515	欧普照明	900	15,642.00	0.00
552	601336	新华保险	500	15,565.00	0.00
553	002056	横店东磁	1,100	14,894.00	0.00
554	301371	敷尔佳	391	14,693.78	0.00
555	600419	天润乳业	1,200	14,076.00	0.00
556	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
557	002271	东方雨虹	725	13,920.00	0.00
558	002790	瑞尔特	1,300	13,572.00	0.00
559	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
560	002738	中矿资源	360	13,431.60	0.00
561	002063	远光软件	2,120	13,101.60	0.00
562	300144	宋城演艺	1,300	12,831.00	0.00
563	603309	维力医疗	900	12,807.00	0.00
564	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
565	301566	N 达利	576	12,752.64	0.00



566	300856	科思股份	200	12,446.00	0.00
567	688631	莱斯信息	336	11,844.00	0.00
568	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
569	301559	中集环科	635	11,582.40	0.00
570	605009	豪悦护理	300	11,451.00	0.00
571	601168	西部矿业	800	11,416.00	0.00
572	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
573	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
574	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
575	002867	周大生	700	10,626.00	0.00
576	603345	安井食品	100	10,461.00	0.00
577	002959	小熊电器	200	10,386.00	0.00
578	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
579	600496	精工钢构	3,400	10,370.00	0.00
580	603129	春风动力	100	10,224.00	0.00
581	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
582	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
583	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
584	301061	匠心家居	200	9,950.00	0.00
585	002270	华明装备	700	9,884.00	0.00
586	603118	共进股份	1,100	9,856.00	0.00
587	600009	上海机场	300	9,834.00	0.00
588	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
589	002484	江海股份	600	9,636.00	0.00
590	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
591	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
592	300059	东方财富	672	9,434.88	0.00
593	601058	赛轮轮胎	800	9,400.00	0.00
594	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
595	300910	瑞丰新材	200	9,188.00	0.00
596	301165	锐捷网络	242	9,169.38	0.00
597	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
598	600398	海澜之家	1,200	8,904.00	0.00
599	603279	景津装备	400	8,844.00	0.00
600	600248	陕建股份	2,100	8,442.00	0.00
601	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
602	300829	金丹科技	400	8,352.00	0.00
603	600486	扬农化工	130	8,205.60	0.00
604	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
605	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
606	688080	映翰通	197	7,994.26	0.00
607	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
608	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
609	600025	华能水电	900	7,767.00	0.00

610	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
611	002001	新 和 成	456	7,733.76	0.00
612	688429	时创能源	346	7,331.74	0.00
613	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
614	601618	中国中冶	2,300	7,038.00	0.00
615	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
616	688181	八亿时空	256	6,912.00	0.00
617	688698	伟创电气	184	6,684.72	0.00
618	300674	宇信科技	400	6,512.00	0.00
619	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
620	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
621	002810	山东赫达	300	6,357.00	0.00
622	300634	彩讯股份	300	6,141.00	0.00
623	000807	云铝股份	500	6,110.00	0.00
624	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
625	603855	华荣股份	300	5,988.00	0.00
626	688621	阳光诺和	80	5,580.00	0.00
627	002262	恩华药业	200	5,424.00	0.00
628	002044	美年健康	900	5,409.00	0.00
629	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
630	300118	东方日升	300	5,295.00	0.00
631	603690	至纯科技	200	5,140.00	0.00
632	603179	新泉股份	100	5,071.00	0.00
633	300502	新易盛	100	4,932.00	0.00
634	600968	海油发展	1,500	4,275.00	0.00
635	300360	炬华科技	300	4,098.00	0.00
636	301195	北路智控	100	4,058.00	0.00
637	002352	顺丰控股	100	4,040.00	0.00
638	603096	新经典	200	3,936.00	0.00
639	001979	招商蛇口	400	3,812.00	0.00
640	603416	信捷电气	100	3,756.00	0.00
641	688100	威胜信息	129	3,730.68	0.00
642	600458	时代新材	400	3,684.00	0.00
643	301363	美好医疗	100	3,680.00	0.00
644	601872	招商轮船	600	3,528.00	0.00
645	002990	盛视科技	100	3,453.00	0.00
646	688233	神工股份	96	3,387.84	0.00
647	688019	安集科技	21	3,354.96	0.00
648	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
649	600332	白云山	116	3,317.60	0.00
650	300982	苏文电能	100	3,284.00	0.00
651	000002	万 科 A	300	3,138.00	0.00
652	688599	天合光能	108	3,081.24	0.00
653	301026	浩通科技	100	3,045.00	0.00

654	600048	保利发展	300	2,970.00	0.00
655	605133	嵘泰股份	102	2,822.34	0.00
656	002335	科华数据	100	2,768.00	0.00
657	600885	宏发股份	100	2,764.00	0.00
658	603076	乐惠国际	100	2,680.00	0.00
659	002487	大金重工	100	2,662.00	0.00
660	688109	品茗科技	94	2,647.98	0.00
661	300291	百纳千成	400	2,576.00	0.00
662	002777	久远银海	100	2,511.00	0.00
663	300358	楚天科技	222	2,375.40	0.00
664	601333	广深铁路	900	2,331.00	0.00
665	002068	黑猫股份	200	2,320.00	0.00
666	002046	国机精工	200	2,310.00	0.00
667	300996	普联软件	100	2,290.00	0.00
668	605068	明新旭腾	100	2,244.00	0.00
669	601877	正泰电器	100	2,151.00	0.00
670	688110	东芯股份	61	2,100.23	0.00
671	300036	超图软件	100	2,090.00	0.00
672	600057	厦门象屿	300	2,013.00	0.00
673	603588	高能环境	300	1,962.00	0.00
674	002212	天融信	200	1,956.00	0.00
675	000719	中原传媒	200	1,946.00	0.00
676	601012	隆基绿能	84	1,923.60	0.00
677	688002	睿创微纳	42	1,857.24	0.00
678	000928	中钢国际	300	1,749.00	0.00
679	601137	博威合金	100	1,553.00	0.00
680	300041	回天新材	150	1,503.00	0.00
681	600325	华发股份	200	1,442.00	0.00
682	600562	国睿科技	100	1,384.00	0.00
683	300138	晨光生物	100	1,343.00	0.00
684	300196	长海股份	100	1,088.00	0.00
685	300494	盛天网络	60	948.60	0.00
686	300887	谱尼测试	80	944.80	0.00
687	688066	航天宏图	22	929.28	0.00
688	688378	奥来德	15	710.10	0.00
689	688586	江航装备	40	443.60	0.00
690	688330	宏力达	12	340.92	0.00
691	600938	中国海油	4	83.88	0.00

注：根据朗新科技集团股份有限公司于 2023 年 12 月 29 日发布的《关于变更证券简称的公告》，自 2024 年 1 月 2 日起，公司的证券简称由“朗新科技”变更为“朗新集团”，证券代码“300682”保持不变。

## 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	300750	宁德时代	16,436,263.40	18.75
2	000333	美的集团	16,102,211.24	18.36
3	601601	中国太保	16,058,632.00	18.32
4	600941	中国移动	15,844,579.00	18.07
5	601668	中国建筑	15,097,769.47	17.22
6	600919	江苏银行	14,606,494.00	16.66
7	601899	紫金矿业	14,570,344.00	16.62
8	600325	华发股份	13,031,494.00	14.86
9	601318	中国平安	12,918,528.00	14.73
10	600795	国电电力	12,863,502.00	14.67
11	000063	中兴通讯	12,185,717.96	13.90
12	300866	安克创新	12,056,954.92	13.75
13	605168	三人行	11,523,710.51	13.14
14	600131	国网信通	11,377,700.00	12.98
15	600048	保利发展	10,944,993.00	12.48
16	000400	许继电气	10,718,471.11	12.22
17	601138	工业富联	10,630,231.00	12.12
18	002555	三七互娱	10,158,436.95	11.59
19	002126	银轮股份	10,138,857.00	11.56
20	600519	贵州茅台	9,932,744.00	11.33
21	601126	四方股份	9,931,465.60	11.33
22	300760	迈瑞医疗	9,873,837.00	11.26
23	601288	农业银行	9,697,500.00	11.06
24	000921	海信家电	9,625,050.71	10.98
25	002027	分众传媒	9,321,729.00	10.63
26	601088	中国神华	9,136,919.00	10.42
27	300416	苏试试验	8,857,896.47	10.10
28	000589	贵州轮胎	8,689,313.37	9.91
29	300592	华凯易佰	8,674,535.00	9.89
30	600803	新奥股份	8,605,440.00	9.81
31	603927	中科软	8,602,634.00	9.81
32	601398	工商银行	8,597,484.00	9.81
33	002139	拓邦股份	8,555,655.00	9.76
34	300130	新国都	8,544,017.01	9.74
35	600572	康恩贝	8,406,937.00	9.59
36	000858	五粮液	8,397,146.00	9.58

37	000034	神州数码	8,313,920.00	9.48
38	002353	杰瑞股份	7,897,853.00	9.01
39	000338	潍柴动力	7,763,066.00	8.85
40	002345	潮宏基	7,601,100.00	8.67
41	002867	周大生	7,596,146.00	8.66
42	601689	拓普集团	7,558,124.00	8.62
43	603444	吉比特	7,527,144.00	8.58
44	600522	中天科技	7,414,010.00	8.46
45	003816	中国广核	7,413,977.00	8.46
46	600900	长江电力	7,409,726.00	8.45
47	600511	国药股份	7,328,818.00	8.36
48	002463	沪电股份	7,234,130.40	8.25
49	300274	阳光电源	7,219,713.00	8.23
50	000988	华工科技	7,106,187.00	8.10
51	600710	苏美达	7,023,532.00	8.01
52	002705	新宝股份	6,936,886.89	7.91
53	000425	徐工机械	6,846,215.00	7.81
54	000733	振华科技	6,808,829.00	7.77
55	600820	隧道股份	6,706,849.01	7.65
56	002984	森麒麟	6,691,048.00	7.63
57	600426	华鲁恒升	6,620,077.00	7.55
58	002236	大华股份	6,595,739.40	7.52
59	601857	中国石油	6,513,971.00	7.43
60	688596	正帆科技	6,509,000.14	7.42
61	600875	东方电气	6,504,048.00	7.42
62	603035	常熟汽饰	6,459,782.04	7.37
63	688589	力合微	6,419,191.51	7.32
64	000938	紫光股份	6,411,511.00	7.31
65	600566	济川药业	6,405,042.00	7.31
66	002311	海大集团	6,392,056.93	7.29
67	600989	宝丰能源	6,283,497.00	7.17
68	601058	赛轮轮胎	6,280,439.00	7.16
69	601567	三星医疗	6,250,260.00	7.13
70	002371	北方华创	6,203,597.00	7.08
71	000568	泸州老窖	6,184,967.00	7.05
72	603993	洛阳钼业	6,184,108.00	7.05
73	600809	山西汾酒	6,160,329.00	7.03
74	603508	思维列控	5,960,059.28	6.80
75	601390	中国中铁	5,956,008.00	6.79
76	002011	盾安环境	5,950,009.00	6.79
77	002244	滨江集团	5,946,219.00	6.78
78	002179	中航光电	5,917,802.06	6.75
79	600765	中航重机	5,789,663.00	6.60
80	300223	北京君正	5,780,430.00	6.59

81	688012	中微公司	5,772,561.46	6.58
82	603596	伯特利	5,753,728.08	6.56
83	600415	小商品城	5,721,626.00	6.53
84	601000	唐山港	5,674,126.76	6.47
85	603129	春风动力	5,631,508.00	6.42
86	002439	启明星辰	5,556,941.00	6.34
87	600276	恒瑞医药	5,543,955.60	6.32
88	603279	景津装备	5,543,396.00	6.32
89	002014	永新股份	5,539,752.60	6.32
90	000975	银泰黄金	5,495,791.00	6.27
91	002252	上海莱士	5,481,212.00	6.25
92	600422	昆药集团	5,479,359.17	6.25
93	600970	中材国际	5,475,610.20	6.25
94	000933	神火股份	5,441,892.00	6.21
95	600036	招商银行	5,423,816.00	6.19
96	002154	报喜鸟	5,401,120.00	6.16
97	002851	麦格米特	5,375,729.75	6.13
98	002410	广联达	5,354,528.00	6.11
99	002130	沃尔核材	5,306,158.51	6.05
100	300026	红日药业	5,281,470.00	6.02
101	601717	郑煤机	5,270,076.72	6.01
102	600258	首旅酒店	5,259,004.00	6.00
103	603369	今世缘	5,201,841.22	5.93
104	600600	青岛啤酒	5,180,090.00	5.91
105	300308	中际旭创	5,163,473.00	5.89
106	002444	巨星科技	5,139,675.00	5.86
107	601001	晋控煤业	5,091,351.00	5.81
108	000811	冰轮环境	5,082,830.00	5.80
109	002028	思源电气	5,018,718.00	5.72
110	601916	浙商银行	4,993,020.00	5.69
111	000928	中钢国际	4,957,756.00	5.65
112	603556	海兴电力	4,907,420.70	5.60
113	688111	金山办公	4,837,638.91	5.52
114	000700	模塑科技	4,831,395.00	5.51
115	001979	招商蛇口	4,817,393.00	5.49
116	000002	万科A	4,816,597.00	5.49
117	600570	恒生电子	4,795,656.84	5.47
118	001965	招商公路	4,771,247.00	5.44
119	603187	海容冷链	4,770,907.00	5.44
120	603605	珀莱雅	4,695,788.00	5.36
121	601838	成都银行	4,689,760.00	5.35
122	000028	国药一致	4,643,406.60	5.30
123	300628	亿联网络	4,595,907.80	5.24
124	002648	卫星化学	4,574,232.20	5.22

125	601728	中国电信	4,570,152.00	5.21
126	600887	伊利股份	4,524,000.38	5.16
127	000960	锡业股份	4,467,477.81	5.10
128	002508	老板电器	4,466,758.00	5.09
129	605090	九丰能源	4,387,229.60	5.00
130	603901	永创智能	4,353,509.00	4.97
131	002352	顺丰控股	4,349,199.43	4.96
132	600861	北京人力	4,328,961.00	4.94
133	605599	菜百股份	4,328,651.00	4.94
134	603368	柳药集团	4,328,059.00	4.94
135	300638	广和通	4,326,640.40	4.93
136	300604	长川科技	4,323,449.00	4.93
137	603300	华铁应急	4,303,823.60	4.91
138	600475	华光环能	4,299,489.48	4.90
139	603259	药明康德	4,297,282.00	4.90
140	002841	视源股份	4,296,266.00	4.90
141	002737	葵花药业	4,285,107.00	4.89
142	300122	智飞生物	4,280,997.50	4.88
143	601117	中国化学	4,264,364.00	4.86
144	601137	博威合金	4,197,271.00	4.79
145	002600	领益智造	4,189,228.00	4.78
146	603305	旭升集团	4,171,980.10	4.76
147	603518	锦泓集团	4,128,234.00	4.71
148	600064	南京高科	4,096,443.00	4.67
149	603345	安井食品	4,076,472.00	4.65
150	002063	远光软件	4,022,536.80	4.59
151	601800	中国交建	3,996,597.00	4.56
152	000538	云南白药	3,987,647.00	4.55
153	002517	恺英网络	3,978,219.00	4.54
154	300791	仙乐健康	3,932,819.00	4.49
155	688676	金盘科技	3,929,951.10	4.48
156	688037	芯源微	3,910,621.37	4.46
157	603882	金城医学	3,883,975.88	4.43
158	603801	志邦家居	3,868,985.45	4.41
159	603298	杭叉集团	3,858,853.00	4.40
160	600060	海信视像	3,857,625.00	4.40
161	002937	兴瑞科技	3,855,707.04	4.40
162	300982	苏文电能	3,844,528.00	4.38
163	600933	爱柯迪	3,838,299.00	4.38
164	300413	芒果超媒	3,835,284.49	4.37
165	300146	汤臣倍健	3,824,497.00	4.36
166	000039	中集集团	3,802,499.50	4.34
167	600449	宁夏建材	3,800,083.00	4.33
168	600557	康缘药业	3,794,980.62	4.33

169	600085	同仁堂	3,780,649.00	4.31
170	300482	万孚生物	3,774,489.64	4.30
171	603393	新天然气	3,765,782.00	4.29
172	603050	科林电气	3,741,330.40	4.27
173	600266	城建发展	3,740,143.60	4.27
174	600908	无锡银行	3,716,964.00	4.24
175	600079	人福医药	3,705,968.00	4.23
176	002541	鸿路钢构	3,703,909.00	4.22
177	688016	心脉医疗	3,701,179.14	4.22
178	000650	仁和药业	3,697,271.00	4.22
179	601818	光大银行	3,676,830.00	4.19
180	601500	通用股份	3,651,744.00	4.16
181	601766	中国中车	3,647,188.00	4.16
182	688009	中国通号	3,647,027.28	4.16
183	300118	东方日升	3,645,516.00	4.16
184	300740	水羊股份	3,640,082.00	4.15
185	002206	海利得	3,635,535.00	4.15
186	601658	邮储银行	3,635,235.00	4.15
187	002429	兆驰股份	3,620,253.00	4.13
188	688425	铁建重工	3,613,300.08	4.12
189	300406	九强生物	3,610,090.00	4.12
190	002595	豪迈科技	3,608,952.30	4.12
191	600456	宝钛股份	3,606,851.00	4.11
192	300319	麦捷科技	3,602,409.00	4.11
193	603816	顾家家居	3,601,010.00	4.11
194	605009	豪悦护理	3,589,987.90	4.09
195	002483	润邦股份	3,578,375.00	4.08
196	300693	盛弘股份	3,558,473.00	4.06
197	688626	翔宇医疗	3,557,131.37	4.06
198	000090	天健集团	3,542,417.00	4.04
199	600587	新华医疗	3,529,391.00	4.03
200	300910	瑞丰新材	3,513,391.60	4.01
201	601186	中国铁建	3,507,128.00	4.00
202	603128	华贸物流	3,503,529.00	4.00
203	603730	岱美股份	3,500,069.00	3.99
204	300316	晶盛机电	3,497,791.59	3.99
205	002966	苏州银行	3,455,929.80	3.94
206	002050	三花智控	3,454,521.00	3.94
207	600497	驰宏锌锗	3,452,106.00	3.94
208	600373	中文传媒	3,440,093.00	3.92
209	688621	阳光诺和	3,436,377.88	3.92
210	300832	新产业	3,423,310.00	3.90
211	300908	仲景食品	3,405,833.00	3.88
212	002475	立讯精密	3,399,566.14	3.88



213	603885	吉祥航空	3,354,882.50	3.83
214	002727	一心堂	3,347,932.00	3.82
215	002697	红旗连锁	3,329,878.00	3.80
216	301376	致欧科技	3,299,849.69	3.76
217	600583	海油工程	3,299,521.00	3.76
218	605368	蓝天燃气	3,295,980.80	3.76
219	002987	京北方	3,292,766.20	3.76
220	601816	京沪高铁	3,280,673.00	3.74
221	300782	卓胜微	3,271,359.20	3.73
222	002531	天顺风能	3,252,144.00	3.71
223	000999	华润三九	3,247,227.00	3.70
224	605167	利柏特	3,232,884.32	3.69
225	000997	新大陆	3,227,477.00	3.68
226	601677	明泰铝业	3,226,493.57	3.68
227	605089	味知香	3,214,930.86	3.67
228	002430	杭氧股份	3,213,822.00	3.67
229	003006	百亚股份	3,212,470.00	3.66
230	300773	拉卡拉	3,207,004.00	3.66
231	603920	世运电路	3,195,916.30	3.64
232	300979	华利集团	3,187,794.00	3.64
233	600665	天地源	3,180,624.00	3.63
234	600582	天地科技	3,176,880.00	3.62
235	601975	招商南油	3,165,952.00	3.61
236	600886	国投电力	3,145,023.00	3.59
237	300415	伊之密	3,137,400.00	3.58
238	600150	中国船舶	3,136,012.31	3.58
239	600019	宝钢股份	3,123,652.00	3.56
240	600062	华润双鹤	3,115,724.03	3.55
241	601012	隆基绿能	3,106,902.00	3.54
242	000725	京东方 A	3,103,631.00	3.54
243	300811	铂科新材	3,097,719.00	3.53
244	688257	新锐股份	3,086,549.35	3.52
245	300724	捷佳伟创	3,076,635.00	3.51
246	600309	万华化学	3,075,831.00	3.51
247	000932	华菱钢铁	3,069,760.80	3.50
248	603889	新澳股份	3,060,355.68	3.49
249	300687	赛意信息	3,056,141.00	3.49
250	002271	东方雨虹	3,051,615.00	3.48
251	300770	新媒股份	3,032,012.00	3.46
252	300896	爱美客	3,028,804.00	3.45
253	002332	仙琚制药	2,995,932.00	3.42
254	601985	中国核电	2,991,703.00	3.41
255	002833	弘亚数控	2,980,292.26	3.40
256	002015	协鑫能科	2,968,823.00	3.39

257	688612	威迈斯	2,960,660.53	3.38
258	002384	东山精密	2,955,978.00	3.37
259	600745	闻泰科技	2,937,405.00	3.35
260	601872	招商轮船	2,937,060.00	3.35
261	601098	中南传媒	2,924,036.00	3.33
262	603215	比依股份	2,915,018.00	3.32
263	300532	今天国际	2,883,837.00	3.29
264	000963	华东医药	2,879,121.00	3.28
265	002415	海康威视	2,874,497.00	3.28
266	600612	老凤祥	2,872,575.00	3.28
267	603611	诺力股份	2,865,322.80	3.27
268	301026	浩通科技	2,851,681.00	3.25
269	002402	和而泰	2,849,696.97	3.25
270	688128	中国电研	2,817,652.34	3.21
271	600901	江苏金租	2,813,682.00	3.21
272	002540	亚太科技	2,810,121.00	3.20
273	603986	兆易创新	2,809,255.00	3.20
274	600399	抚顺特钢	2,803,309.00	3.20
275	600977	中国电影	2,792,133.00	3.18
276	688389	普门科技	2,779,134.56	3.17
277	600138	中青旅	2,765,663.00	3.15
278	600050	中国联通	2,765,529.00	3.15
279	688187	时代电气	2,751,017.90	3.14
280	603659	璞泰来	2,750,171.85	3.14
281	603979	金诚信	2,742,353.00	3.13
282	688072	拓荆科技	2,686,320.21	3.06
283	603690	至纯科技	2,664,854.00	3.04
284	605337	李子园	2,664,647.83	3.04
285	002158	汉钟精机	2,654,386.00	3.03
286	603338	浙江鼎力	2,635,683.00	3.01
287	688239	航宇科技	2,617,750.48	2.99
288	601019	山东出版	2,612,173.44	2.98
289	600529	山东药玻	2,608,879.00	2.98
290	688599	天合光能	2,606,535.15	2.97
291	300856	科思股份	2,597,421.00	2.96
292	002698	博实股份	2,584,691.00	2.95
293	002469	三维化学	2,583,040.00	2.95
294	003020	立方制药	2,582,765.20	2.95
295	000895	双汇发展	2,582,504.00	2.95
296	605377	华旺科技	2,582,408.00	2.95
297	688588	凌志软件	2,561,335.26	2.92
298	300452	山河药辅	2,542,445.29	2.90
299	688401	路维光电	2,517,312.91	2.87
300	600535	天士力	2,516,717.00	2.87

301	300244	迪安诊断	2,505,461.00	2.86
302	002025	航天电器	2,502,234.00	2.85
303	300037	新宙邦	2,499,385.60	2.85
304	600603	广汇物流	2,493,367.00	2.84
305	300533	冰川网络	2,484,551.00	2.83
306	300124	汇川技术	2,480,084.00	2.83
307	605133	嵘泰股份	2,474,144.56	2.82
308	600872	中炬高新	2,469,117.00	2.82
309	600988	赤峰黄金	2,466,742.00	2.81
310	300421	力星股份	2,453,470.40	2.80
311	600660	福耀玻璃	2,451,640.00	2.80
312	300068	南都电源	2,448,201.00	2.79
313	601928	凤凰传媒	2,439,446.91	2.78
314	601336	新华保险	2,423,960.00	2.76
315	002839	张家港行	2,420,948.00	2.76
316	601006	大秦铁路	2,420,499.00	2.76
317	300751	迈为股份	2,419,998.40	2.76
318	600025	华能水电	2,402,944.00	2.74
319	688110	东芯股份	2,401,424.30	2.74
320	600028	中国石化	2,390,496.00	2.73
321	300019	硅宝科技	2,388,936.00	2.72
322	603324	盛剑环境	2,388,700.00	2.72
323	300476	胜宏科技	2,388,274.00	2.72
324	002533	金杯电工	2,387,921.00	2.72
325	603309	维力医疗	2,384,124.00	2.72
326	603308	应流股份	2,378,391.80	2.71
327	300226	上海钢联	2,366,604.80	2.70
328	000100	TCL 科技	2,353,013.00	2.68
329	300627	华测导航	2,348,617.00	2.68
330	600674	川投能源	2,324,324.60	2.65
331	002568	百润股份	2,322,654.72	2.65
332	002452	长高电新	2,322,251.00	2.65
333	300360	炬华科技	2,318,904.00	2.64
334	002335	科华数据	2,318,710.00	2.64
335	601208	东材科技	2,315,687.00	2.64
336	603855	华荣股份	2,310,434.00	2.64
337	600066	宇通客车	2,305,185.00	2.63
338	603118	共进股份	2,300,292.00	2.62
339	603043	广州酒家	2,288,906.00	2.61
340	603859	能科科技	2,282,704.00	2.60
341	000543	皖能电力	2,276,858.70	2.60
342	002078	太阳纸业	2,275,610.00	2.60
343	002142	宁波银行	2,274,215.00	2.59
344	300873	海晨股份	2,269,182.80	2.59

345	601100	恒立液压	2,267,341.00	2.59
346	688516	奥特维	2,261,820.68	2.58
347	688008	澜起科技	2,253,685.99	2.57
348	603501	韦尔股份	2,251,177.00	2.57
349	000736	中交地产	2,250,215.00	2.57
350	600012	皖通高速	2,232,701.00	2.55
351	002318	久立特材	2,232,063.00	2.55
352	600183	生益科技	2,229,547.00	2.54
353	688376	美埃科技	2,212,712.46	2.52
354	600598	北大荒	2,200,809.00	2.51
355	600161	天坛生物	2,198,822.60	2.51
356	300853	申昊科技	2,195,947.00	2.50
357	600023	浙能电力	2,193,151.00	2.50
358	300926	博俊科技	2,175,440.00	2.48
359	600867	通化东宝	2,165,906.00	2.47
360	601369	陕鼓动力	2,163,233.00	2.47
361	002152	广电运通	2,162,232.00	2.47
362	603112	华翔股份	2,148,051.00	2.45
363	300682	朗新科技	2,134,243.00	2.43
364	601211	国泰君安	2,133,816.00	2.43
365	600928	西安银行	2,112,887.00	2.41
366	600350	山东高速	2,109,049.00	2.41
367	300820	英杰电气	2,103,725.00	2.40
368	600690	海尔智家	2,095,514.00	2.39
369	002276	万马股份	2,081,838.00	2.37
370	002594	比亚迪	2,074,094.00	2.37
371	002080	中材科技	2,072,000.00	2.36
372	600976	健民集团	2,070,527.00	2.36
373	688332	中科蓝讯	2,069,145.31	2.36
374	000777	中核科技	2,058,760.00	2.35
375	600968	海油发展	2,050,168.00	2.34
376	605117	德业股份	2,046,766.00	2.33
377	688002	睿创微纳	2,046,503.45	2.33
378	601377	兴业证券	2,037,156.00	2.32
379	601811	新华文轩	2,034,704.00	2.32
380	000922	佳电股份	2,033,772.76	2.32
381	002959	小熊电器	2,025,888.00	2.31
382	603096	新经典	2,022,895.00	2.31
383	300002	神州泰岳	2,015,384.00	2.30
384	000059	华锦股份	2,002,255.00	2.28
385	300753	爱朋医疗	1,994,233.32	2.27
386	600885	宏发股份	1,993,536.00	2.27
387	002938	鹏鼎控股	1,974,116.00	2.25
388	603619	中曼石油	1,972,961.00	2.25

389	000708	中信特钢	1,960,396.00	2.24
390	002649	博彦科技	1,951,665.00	2.23
391	600835	上海机电	1,938,837.00	2.21
392	002315	焦点科技	1,936,095.00	2.21
393	603486	科沃斯	1,932,174.00	2.20
394	002790	瑞尔特	1,932,173.72	2.20
395	002273	水晶光电	1,927,027.00	2.20
396	600750	江中药业	1,926,900.00	2.20
397	688357	建龙微纳	1,919,814.60	2.19
398	300442	润泽科技	1,912,356.80	2.18
399	000625	长安汽车	1,906,631.00	2.17
400	600008	首创环保	1,906,150.00	2.17
401	600285	羚锐制药	1,898,921.00	2.17
402	603727	博迈科	1,885,953.00	2.15
403	301208	中亦科技	1,883,426.00	2.15
404	002049	紫光国微	1,877,971.00	2.14
405	600030	中信证券	1,871,316.00	2.13
406	300041	回天新材	1,844,621.00	2.10
407	300303	聚飞光电	1,841,495.00	2.10
408	300129	泰胜风能	1,834,726.00	2.09
409	600993	马应龙	1,831,507.00	2.09
410	300842	帝科股份	1,818,821.00	2.07
411	000950	重药控股	1,817,281.00	2.07
412	300451	创业慧康	1,817,280.00	2.07
413	000661	长春高新	1,813,506.00	2.07
414	601869	长飞光纤	1,812,133.00	2.07
415	000719	中原传媒	1,803,020.00	2.06
416	300384	三联虹普	1,797,086.00	2.05
417	002129	TCL 中环	1,790,335.00	2.04
418	603811	诚意药业	1,787,753.12	2.04
419	600039	四川路桥	1,779,277.00	2.03
420	002701	奥瑞金	1,774,393.00	2.02
421	300569	天能重工	1,769,235.00	2.02
422	301248	杰创智能	1,769,161.00	2.02
423	603019	中科曙光	1,762,208.57	2.01
424	000065	北方国际	1,761,457.00	2.01

注：“买入金额”按买入成交金额（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	300750	宁德时代	17,252,541.00	19.68
2	000333	美的集团	15,209,538.18	17.35
3	601318	中国平安	13,065,098.00	14.90
4	600325	华发股份	12,746,883.00	14.54
5	600919	江苏银行	11,518,688.00	13.14
6	601601	中国太保	11,368,595.66	12.97
7	600941	中国移动	11,190,253.00	12.76
8	605168	三人行	11,165,168.35	12.73
9	600048	保利发展	10,802,835.00	12.32
10	601899	紫金矿业	10,661,676.00	12.16
11	601668	中国建筑	10,354,996.00	11.81
12	000858	五粮液	10,119,828.00	11.54
13	600131	国网信通	10,026,075.00	11.43
14	000063	中兴通讯	9,380,084.00	10.70
15	600795	国电电力	9,282,710.00	10.59
16	300866	安克创新	8,913,549.44	10.17
17	601126	四方股份	8,468,565.10	9.66
18	600519	贵州茅台	8,189,259.00	9.34
19	603927	中科软	8,169,565.00	9.32
20	300760	迈瑞医疗	8,149,839.00	9.30
21	000988	华工科技	7,793,972.00	8.89
22	002139	拓邦股份	7,756,454.00	8.85
23	601398	工商银行	7,606,857.00	8.68
24	002867	周大生	7,426,861.00	8.47
25	601288	农业银行	7,389,223.00	8.43
26	002126	银轮股份	7,372,029.19	8.41
27	003816	中国广核	7,293,187.00	8.32
28	002555	三七互娱	7,277,596.00	8.30
29	000589	贵州轮胎	7,103,929.20	8.10
30	601689	拓普集团	7,040,486.00	8.03
31	000400	许继电气	6,962,248.00	7.94
32	601088	中国神华	6,929,270.00	7.90
33	002705	新宝股份	6,849,913.44	7.81
34	600522	中天科技	6,771,286.00	7.72
35	000425	徐工机械	6,652,670.00	7.59
36	603444	吉比特	6,601,410.00	7.53
37	601058	赛轮轮胎	6,591,654.00	7.52
38	600511	国药股份	6,586,360.14	7.51
39	002984	森麒麟	6,573,836.00	7.50
40	600426	华鲁恒升	6,498,091.00	7.41
41	600803	新奥股份	6,376,113.00	7.27
42	002311	海大集团	6,334,764.00	7.22

43	002236	大华股份	6,324,614.37	7.21
44	600572	康恩贝	6,233,608.00	7.11
45	688596	正帆科技	6,178,868.43	7.05
46	002353	杰瑞股份	6,113,059.00	6.97
47	000733	振华科技	6,107,219.00	6.97
48	601567	三星医疗	6,018,133.00	6.86
49	000938	紫光股份	5,995,673.00	6.84
50	002244	滨江集团	5,995,117.00	6.84
51	600875	东方电气	5,992,348.00	6.83
52	688589	力合微	5,902,090.84	6.73
53	600036	招商银行	5,822,943.00	6.64
54	000338	潍柴动力	5,781,172.20	6.59
55	600765	中航重机	5,758,206.26	6.57
56	600566	济川药业	5,729,072.00	6.53
57	000975	银泰黄金	5,692,912.00	6.49
58	600809	山西汾酒	5,591,384.00	6.38
59	300274	阳光电源	5,567,824.00	6.35
60	000568	泸州老窖	5,561,341.00	6.34
61	601138	工业富联	5,518,725.00	6.29
62	603508	思维列控	5,503,238.79	6.28
63	601000	唐山港	5,410,508.00	6.17
64	600710	苏美达	5,400,426.00	6.16
65	603129	春风动力	5,343,526.00	6.09
66	600415	小商品城	5,267,733.82	6.01
67	002439	启明星辰	5,232,336.00	5.97
68	300122	智飞生物	5,154,601.00	5.88
69	300223	北京君正	5,118,182.00	5.84
70	603369	今世缘	5,052,741.00	5.76
71	600887	伊利股份	5,032,915.00	5.74
72	002851	麦格米特	5,000,375.00	5.70
73	600600	青岛啤酒	5,000,250.00	5.70
74	000002	万 科 A	4,910,985.00	5.60
75	002463	沪电股份	4,896,121.00	5.58
76	001979	招商蛇口	4,885,780.22	5.57
77	603279	景津装备	4,811,017.85	5.49
78	601838	成都银行	4,808,566.00	5.48
79	002345	潮宏基	4,764,782.00	5.43
80	000928	中钢国际	4,757,670.00	5.43
81	600258	首旅酒店	4,742,509.00	5.41
82	601857	中国石油	4,712,707.00	5.37
83	002648	卫星化学	4,712,396.80	5.37
84	000921	海信家电	4,700,183.00	5.36
85	300308	中际旭创	4,631,260.00	5.28
86	300628	亿联网络	4,588,286.00	5.23

87	002027	分众传媒	4,517,278.00	5.15
88	600276	恒瑞医药	4,513,237.92	5.15
89	603605	珀莱雅	4,500,181.20	5.13
90	002410	广联达	4,490,766.00	5.12
91	002014	永新股份	4,482,888.40	5.11
92	603345	安井食品	4,446,030.00	5.07
93	002508	老板电器	4,435,443.72	5.06
94	600861	北京人力	4,422,503.96	5.04
95	300416	苏试试验	4,400,966.50	5.02
96	002371	北方华创	4,398,272.10	5.02
97	603259	药明康德	4,393,614.00	5.01
98	002252	上海莱士	4,373,957.34	4.99
99	600475	华光环能	4,273,738.00	4.87
100	603596	伯特利	4,254,953.00	4.85
101	002841	视源股份	4,225,599.50	4.82
102	600079	人福医药	4,218,427.12	4.81
103	002352	顺丰控股	4,180,887.64	4.77
104	601137	博威合金	4,173,675.00	4.76
105	002179	中航光电	4,160,184.65	4.74
106	605599	菜百股份	4,152,214.00	4.74
107	000811	冰轮环境	4,119,592.00	4.70
108	300026	红日药业	4,097,395.00	4.67
109	600449	宁夏建材	4,093,517.00	4.67
110	603901	永创智能	4,092,421.00	4.67
111	601117	中国化学	4,086,327.00	4.66
112	603298	杭叉集团	4,032,950.75	4.60
113	002050	三花智控	4,016,141.45	4.58
114	300413	芒果超媒	4,012,290.00	4.58
115	000933	神火股份	4,000,150.00	4.56
116	688626	翔宇医疗	3,999,363.68	4.56
117	000028	国药一致	3,989,100.40	4.55
118	601390	中国中铁	3,946,274.00	4.50
119	002517	恺英网络	3,931,538.00	4.48
120	600570	恒生电子	3,897,332.22	4.44
121	300740	水羊股份	3,886,379.00	4.43
122	002154	报喜鸟	3,885,177.00	4.43
123	000960	锡业股份	3,835,712.00	4.37
124	300146	汤臣倍健	3,819,311.96	4.36
125	600085	同仁堂	3,801,636.00	4.34
126	688111	金山办公	3,797,276.53	4.33
127	300982	苏文电能	3,782,625.67	4.31
128	300638	广和通	3,747,557.47	4.27
129	600064	南京高科	3,736,822.00	4.26
130	603305	旭升集团	3,732,085.00	4.26



131	002063	远光软件	3,727,754.00	4.25
132	600908	无锡银行	3,709,887.00	4.23
133	601800	中国交建	3,695,145.00	4.21
134	603801	志邦家居	3,694,620.00	4.21
135	601916	浙商银行	3,673,433.00	4.19
136	603816	顾家家居	3,634,761.68	4.15
137	002697	红旗连锁	3,599,782.67	4.11
138	601818	光大银行	3,580,914.00	4.08
139	603187	海容冷链	3,579,542.07	4.08
140	000538	云南白药	3,578,220.60	4.08
141	001965	招商公路	3,564,018.73	4.06
142	002130	沃尔核材	3,535,938.00	4.03
143	000090	天健集团	3,521,386.00	4.02
144	002011	盾安环境	3,503,242.00	4.00
145	002206	海利得	3,500,922.00	3.99
146	002541	鸿路钢构	3,480,059.20	3.97
147	688009	中国通号	3,475,948.61	3.96
148	603993	洛阳钼业	3,475,037.00	3.96
149	600456	宝钛股份	3,467,788.00	3.96
150	600989	宝丰能源	3,429,476.00	3.91
151	002595	豪迈科技	3,393,025.00	3.87
152	603885	吉祥航空	3,392,681.00	3.87
153	601766	中国中车	3,386,391.00	3.86
154	600557	康缘药业	3,379,628.00	3.85
155	002727	一心堂	3,373,003.00	3.85
156	002142	宁波银行	3,352,116.80	3.82
157	002937	兴瑞科技	3,309,547.00	3.77
158	600582	天地科技	3,307,095.00	3.77
159	002966	苏州银行	3,299,936.00	3.76
160	000650	仁和药业	3,295,001.00	3.76
161	002483	润邦股份	3,276,832.00	3.74
162	600309	万华化学	3,271,372.00	3.73
163	600266	城建发展	3,257,559.19	3.72
164	300118	东方日升	3,254,574.00	3.71
165	601728	中国电信	3,251,556.00	3.71
166	601816	京沪高铁	3,235,585.00	3.69
167	601677	明泰铝业	3,216,371.00	3.67
168	603920	世运电路	3,208,133.30	3.66
169	605009	豪悦护理	3,182,659.02	3.63
170	601186	中国铁建	3,182,242.19	3.63
171	300979	华利集团	3,178,333.15	3.62
172	000932	华菱钢铁	3,174,993.00	3.62
173	605167	利柏特	3,162,865.00	3.61
174	605089	味知香	3,149,791.56	3.59

175	688621	阳光诺和	3,146,525.28	3.59
176	002737	葵花药业	3,114,821.00	3.55
177	603035	常熟汽饰	3,104,584.00	3.54
178	601012	隆基绿能	3,100,639.00	3.54
179	002531	天顺风能	3,097,073.00	3.53
180	000999	华润三九	3,093,368.05	3.53
181	300592	华凯易佰	3,085,703.00	3.52
182	600062	华润双鹤	3,083,858.00	3.52
183	002430	杭氧股份	3,081,985.00	3.52
184	300773	拉卡拉	3,076,108.00	3.51
185	688676	金盘科技	3,050,234.37	3.48
186	688016	心脉医疗	3,043,668.06	3.47
187	000034	神州数码	3,042,405.00	3.47
188	600886	国投电力	3,035,971.55	3.46
189	300693	盛弘股份	3,034,203.85	3.46
190	601975	招商南油	3,028,556.00	3.45
191	688425	铁建重工	3,025,632.61	3.45
192	300910	瑞丰新材	3,002,633.98	3.42
193	603393	新天然气	3,000,092.40	3.42
194	688389	普门科技	2,999,769.25	3.42
195	002833	弘亚数控	2,987,867.60	3.41
196	600019	宝钢股份	2,972,592.00	3.39
197	002271	东方雨虹	2,965,664.00	3.38
198	002028	思源电气	2,953,280.00	3.37
199	600373	中文传媒	2,950,724.00	3.37
200	603300	华铁应急	2,939,402.00	3.35
201	002332	仙琚制药	2,927,189.00	3.34
202	300724	捷佳伟创	2,926,888.00	3.34
203	601717	郑煤机	2,907,097.00	3.32
204	600820	隧道股份	2,865,802.00	3.27
205	688037	芯源微	2,865,547.63	3.27
206	300811	铂科新材	2,856,890.79	3.26
207	000963	华东医药	2,840,830.70	3.24
208	000725	京东方 A	2,836,094.00	3.23
209	002384	东山精密	2,824,035.00	3.22
210	601872	招商轮船	2,822,507.00	3.22
211	003006	百亚股份	2,809,129.00	3.20
212	603050	科林电气	2,808,417.60	3.20
213	600977	中国电影	2,788,641.90	3.18
214	002444	巨星科技	2,786,111.51	3.18
215	300896	爱美客	2,783,381.00	3.17
216	600587	新华医疗	2,771,353.10	3.16
217	600050	中国联通	2,766,225.00	3.15
218	603986	兆易创新	2,763,890.00	3.15

219	601098	中南传媒	2,756,957.00	3.14
220	300421	力星股份	2,743,482.49	3.13
221	600535	天士力	2,738,402.00	3.12
222	603128	华贸物流	2,734,792.00	3.12
223	603659	璞泰来	2,734,626.20	3.12
224	600745	闻泰科技	2,716,933.00	3.10
225	000039	中集集团	2,699,173.00	3.08
226	002402	和而泰	2,689,964.00	3.07
227	600988	赤峰黄金	2,683,489.84	3.06
228	601019	山东出版	2,680,651.00	3.06
229	688187	时代电气	2,674,161.76	3.05
230	300316	晶盛机电	2,672,486.00	3.05
231	301026	浩通科技	2,667,473.00	3.04
232	600138	中青旅	2,654,711.00	3.03
233	605337	李子园	2,652,679.69	3.03
234	603690	至纯科技	2,646,893.00	3.02
235	300406	九强生物	2,636,699.00	3.01
236	002158	汉钟精机	2,619,670.00	2.99
237	688257	新锐股份	2,616,678.19	2.98
238	002698	博实股份	2,605,919.00	2.97
239	605377	华旺科技	2,597,149.50	2.96
240	600660	福耀玻璃	2,591,595.00	2.96
241	300532	今天国际	2,577,321.00	2.94
242	601001	晋控煤业	2,560,408.00	2.92
243	603338	浙江鼎力	2,556,166.00	2.92
244	300682	朗新科技	2,552,629.00	2.91
245	688588	凌志软件	2,551,480.11	2.91
246	300476	胜宏科技	2,551,247.00	2.91
247	600025	华能水电	2,550,726.00	2.91
248	601500	通用股份	2,540,430.00	2.90
249	601336	新华保险	2,508,221.00	2.86
250	600933	爱柯迪	2,507,551.00	2.86
251	688128	中国电研	2,503,264.63	2.86
252	600529	山东药玻	2,502,123.00	2.85
253	000700	模塑科技	2,494,184.00	2.84
254	300856	科思股份	2,489,357.00	2.84
255	603215	比依股份	2,486,898.00	2.84
256	603889	新澳股份	2,479,512.80	2.83
257	600674	川投能源	2,476,797.00	2.82
258	300601	康泰生物	2,467,793.00	2.81
259	300415	伊之密	2,461,391.28	2.81
260	688599	天合光能	2,442,156.42	2.79
261	300770	新媒股份	2,440,243.24	2.78
262	600665	天地源	2,436,398.00	2.78

263	300751	迈为股份	2,430,904.60	2.77
264	300124	汇川技术	2,426,346.00	2.77
265	002959	小熊电器	2,419,174.10	2.76
266	601888	中国中免	2,417,759.00	2.76
267	002049	紫光国微	2,408,426.20	2.75
268	002415	海康威视	2,405,787.00	2.74
269	300226	上海钢联	2,405,175.68	2.74
270	600028	中国石化	2,400,337.00	2.74
271	605133	嵘泰股份	2,398,951.00	2.74
272	603043	广州酒家	2,398,885.00	2.74
273	300627	华测导航	2,393,005.00	2.73
274	603118	共进股份	2,383,226.00	2.72
275	600872	中炬高新	2,371,392.00	2.70
276	300019	硅宝科技	2,331,966.00	2.66
277	688239	航宇科技	2,314,693.26	2.64
278	002594	比亚迪	2,314,444.00	2.64
279	300452	山河药辅	2,313,368.00	2.64
280	601658	邮储银行	2,299,812.00	2.62
281	000100	TCL 科技	2,296,113.30	2.62
282	002839	张家港行	2,287,356.00	2.61
283	600066	宇通客车	2,287,256.50	2.61
284	002335	科华数据	2,286,361.00	2.61
285	300130	新国都	2,270,409.80	2.59
286	688012	中微公司	2,269,125.16	2.59
287	603486	科沃斯	2,265,311.00	2.58
288	002015	协鑫能科	2,249,465.17	2.57
289	601100	恒立液压	2,246,579.00	2.56
290	601928	凤凰传媒	2,241,882.00	2.56
291	603324	盛剑环境	2,227,029.00	2.54
292	601006	大秦铁路	2,224,653.00	2.54
293	603309	维力医疗	2,221,586.89	2.53
294	002152	广电运通	2,212,262.00	2.52
295	605368	蓝天燃气	2,205,290.40	2.52
296	300360	炬华科技	2,202,013.00	2.51
297	600885	宏发股份	2,200,101.00	2.51
298	600183	生益科技	2,199,676.00	2.51
299	300014	亿纬锂能	2,175,291.24	2.48
300	688110	东芯股份	2,170,722.47	2.48
301	600598	北大荒	2,157,363.00	2.46
302	600690	海尔智家	2,155,068.00	2.46
303	600900	长江电力	2,148,467.87	2.45
304	601369	陕鼓动力	2,145,888.00	2.45
305	000997	新大陆	2,144,214.00	2.45
306	002568	百润股份	2,139,908.00	2.44

307	002429	兆驰股份	2,133,745.00	2.43
308	688612	威迈斯	2,124,982.21	2.42
309	000736	中交地产	2,109,459.00	2.41
310	603806	福斯特	2,106,981.80	2.40
311	300378	鼎捷软件	2,105,997.00	2.40
312	603096	新经典	2,104,332.00	2.40
313	603859	能科科技	2,098,778.00	2.39
314	603882	金城医学	2,091,215.00	2.39
315	002790	瑞尔特	2,085,934.00	2.38
316	600023	浙能电力	2,076,133.00	2.37
317	300319	麦捷科技	2,075,846.00	2.37
318	002929	润建股份	2,075,135.15	2.37
319	603855	华荣股份	2,074,066.00	2.37
320	300068	南都电源	2,071,966.00	2.36
321	601811	新华文轩	2,063,847.00	2.35
322	300687	赛意信息	2,058,244.00	2.35
323	600928	西安银行	2,033,382.00	2.32
324	300853	申昊科技	2,027,121.00	2.31
325	600970	中材国际	2,020,929.00	2.30
326	688008	澜起科技	2,017,308.87	2.30
327	600350	山东高速	2,016,163.00	2.30
328	002469	三维化学	2,016,079.00	2.30
329	688516	奥特维	2,006,063.74	2.29
330	300782	卓胜微	1,998,307.00	2.28
331	688002	睿创微纳	1,985,852.47	2.26
332	002649	博彦科技	1,984,044.00	2.26
333	603368	柳药集团	1,973,495.00	2.25
334	002315	焦点科技	1,970,220.00	2.25
335	300908	仲景食品	1,967,568.00	2.24
336	300533	冰川网络	1,963,693.00	2.24
337	601377	兴业证券	1,963,313.00	2.24
338	600612	老凤祥	1,961,044.00	2.24
339	300753	爱朋医疗	1,960,311.00	2.24
340	003020	立方制药	1,956,027.00	2.23
341	600968	海油发展	1,953,913.00	2.23
342	002080	中材科技	1,936,519.00	2.21
343	002987	京北方	1,933,914.80	2.21
344	600845	宝信软件	1,932,856.00	2.20
345	300842	帝科股份	1,923,793.00	2.19
346	603727	博迈科	1,890,322.00	2.16
347	000777	中核科技	1,888,874.00	2.15
348	000719	中原传媒	1,873,089.00	2.14
349	600750	江中药业	1,872,433.00	2.14
350	002714	牧原股份	1,869,280.94	2.13

351	002180	纳思达	1,852,965.00	2.11
352	605117	德业股份	1,846,216.60	2.11
353	605090	九丰能源	1,844,227.00	2.10
354	688072	拓荆科技	1,842,250.22	2.10
355	603619	中曼石油	1,839,180.00	2.10
356	300451	创业慧康	1,832,020.00	2.09
357	000922	佳电股份	1,829,499.00	2.09
358	002938	鹏鼎控股	1,828,746.00	2.09
359	600285	羚锐制药	1,809,754.00	2.06
360	603198	迎驾贡酒	1,802,480.00	2.06
361	600835	上海机电	1,800,978.00	2.05
362	601669	中国电建	1,796,208.00	2.05
363	600008	首创环保	1,792,830.00	2.04
364	603600	永艺股份	1,792,815.00	2.04
365	300396	迪瑞医疗	1,792,653.00	2.04
366	688357	建龙微纳	1,785,984.41	2.04
367	688332	中科蓝讯	1,781,775.69	2.03
368	601869	长飞光纤	1,771,282.00	2.02
369	688097	博众精工	1,761,426.43	2.01

注：“卖出金额”按卖出成交金额（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	2,367,104,036.58
卖出股票的收入（成交）总额	1,988,183,371.36

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	21,102,181.15	4.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,102,181.15	4.78

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	019694	23 国债 01	207,000	21,102,181.15	4.78

## 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投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本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

本基金的股指期货投资用于套期保值。在预期市场上涨时，可以通过买入股指期货作为股票替代，增加股票仓位，同时提高资金的利用效率；在预期市场下跌时，可以通过卖出股指期货对冲股市整体下跌的系统性风险，对投资组合的价值进行保护。

## 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

本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的。管理人按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2** 本基金投资的前十名证券中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,487,094.89
2	应收清算款	447,220.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,934,345.07

### 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处于转股期的可转换债券。

### 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中未存在流通受限情况。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份



份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
海富通欣荣混合 A	1,677	195,467.02	325,530,874.70	99.31%	2,267,312.27	0.69%
海富通欣荣混合 C	775	94,130.37	70,196,813.16	96.22%	2,754,220.58	3.78%
合计	2,452	163,437.69	395,727,687.86	98.75%	5,021,532.85	1.25%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,A、C 级比例分母为各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	海富通欣荣混合 A	1,819,961.48	0.5552%
	海富通欣荣混合 C	8,059.50	0.0110%
	合计	1,828,020.98	0.4562%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通欣荣混合 A	>100
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通欣荣混合 A	>100
	海富通欣荣混合 C	0
	合计	>100

**§10 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	海富通欣荣混合 A	海富通欣荣混合 C
基金合同生效日（2016 年 9 月 22 日）基金份额总额	250,120,830.38	200,014,500.63
本报告期期初基金份额总额	56,248,162.23	1,799,746.51
本报告期基金总申购份额	390,968,846.09	141,491,061.97
减：本报告期基金总赎回份额	119,418,821.35	70,339,774.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	327,798,186.97	72,951,033.74

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

**§11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

2023 年 12 月 13 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第七届董事会第二十一一次临时会议审议通过，何树方先生不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

**11.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

**11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的连续年限是 8 年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	917,211,740.65	21.08%	678,454.89	21.27%	-
国金证券	1	865,539,287.69	19.90%	627,141.17	19.66%	-
长江证券	1	713,610,289.80	16.40%	527,257.01	16.53%	-
申万宏源	1	627,525,059.94	14.43%	460,575.25	14.44%	-
光大证券	1	367,673,039.60	8.45%	268,091.01	8.41%	-
华创证券	1	255,824,231.85	5.88%	184,528.46	5.79%	-
海通证券	2	239,793,410.41	5.51%	176,058.89	5.52%	-
招商证券	1	226,093,203.05	5.20%	166,383.51	5.22%	-
太平洋证券	2	64,168,987.20	1.48%	46,950.38	1.47%	-
平安证券	1	39,895,479.32	0.92%	29,759.80	0.93%	-
华泰证券	1	32,784,961.92	0.75%	23,975.86	0.75%	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元未发生变更。

#### 2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，形成证券公司交易单元租用意见。

#### (2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用

意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

### 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	
	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
国泰君安	21,903,080.67	25.02%	9,000,000.00	56.25%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	31,918,044.00	36.46%	-	-	-	-
申万宏源	26,355,975.85	30.11%	-	-	-	-
光大证券	142,438.85	0.16%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	6,005,772.00	6.86%	-	-	-	-
平安证券	163,078.36	0.19%	-	-	-	-
华泰证券	1,045,198.40	1.19%	7,000,000.00	43.75%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-

### 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	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增海通期货股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-01-18
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分	证券日报、基金管理	2023-02-08

	基金新增东方财富证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	人网站及中国证监会基金电子披露网站	
3	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增兴业银行股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
7	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-08
8	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-15
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-17
10	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
11	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-02
12	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金第一次分红公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
13	海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购和转换转入业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会	2023-07-18

		会基金电子披露网站	
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-01
15	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信建投证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-14
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-14
17	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-13
18	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-14

## 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	2023/5/24-2023/12/31	-	163,942,716.05	-	163,942,716.05	40.91%
	2	2023/5/23-2023/5/23,2023/12/26-2023/12/31	-	81,674,915.98	-	81,674,915.98	20.38%
	3	2023/4/25-2023/5/18	-	40,417,710.16	-	40,417,710.16	10.09%
	4	2023/5/22-2023/	-	38,88	-	38,884,000.	9.70%

		5/22		4,000.22		22	
5	2023/1/1-2023/5/18	26,221,418.08	6,706,076.72	-	32,927,494.80	8.22%	
6	2023/2/15-2023/3/28	10,422,207.13	2,665,459.22	-	13,087,666.35	3.27%	
7	2023/1/1-2023/1/3	12,768,260.67	-	12,768,260.67	-	-	
8	2023/5/11-2023/5/17	-	40,549,007.91	40,549,007.91	-	-	
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；</p> <p>2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；</p> <p>3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于5000万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>4、其他可能的风险。</p> <p>另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的50%或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过50%时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。</p>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 113 只公募基金。截至 2023 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1510 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保

障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金的文件
- (二)海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- (三)海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

### 13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室



### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日