

# 稳博 500 指数增强多策略 1 号私募证券投资基金 2023 年年度报告

## 告

### 1、基金产品概况

#### 1.1 基金基本情况

|                          |                            |
|--------------------------|----------------------------|
| 基金名称                     | 稳博 500 指数增强多策略 1 号私募证券投资基金 |
| 基金编码                     | SLS211                     |
| 基金运作方式                   | 开放式                        |
| 基金成立日期                   | 2020 年 09 月 01 日           |
| 基金管理人                    | 上海稳博投资管理有限公司               |
| 基金托管人（如有）                | 招商证券股份有限公司                 |
| 投资顾问（如有）                 | -                          |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 5,046.983171               |
| 基金到期日期                   | 2035 年 08 月 31 日           |

#### 1.2 基金产品说明

|            |                             |
|------------|-----------------------------|
| 投资目标       | 在控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值 |
| 投资策略       | 复合策略                        |
| 业绩比较基准（如有） | 无                           |
| 风险收益特征     | 本基金属于 R4 级（中高风险）投资品种        |

#### 1.3 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      | 上海稳博投资管理有限公司 | 招商证券股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名           | 韩鑫普                  |
|         | 联系电话         | 0755-82943666        |
|         | 电子邮箱         | tgb@cmschina.com.cn  |
| 传真      | -            | 0755-82960794        |
| 注册地址    | -            | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 办公地址    | -            | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 邮政编码    | -            | 518000               |
| 法定代表人   | -            | 霍达                   |

#### 1.4 信息披露方式

通过招商证券投资者服务平台披露

#### 1.5 其他相关资料（如有）

| 项目     | 名称         | 办公地址               |
|--------|------------|--------------------|
| 会计师事务所 | -          | -                  |
| 注册登记机构 | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路111号 |
| 外包机构   | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路111号 |
| —      | -          | -                  |

### 2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

#### 2.1 主要会计数据和财务指标

| 期间数据和指标      | 2023年         | 2022年         | 2021年         |
|--------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益      | 2,524,105.87  | -698,902.77   | 8,616,859.68  |
| 本期利润         | 2,750,087.77  | -2,618,255.55 | 9,850,327.36  |
| 期末数据和指标      | 2023年末        | 2022年末        | 2021年末        |
| 期末可供分配利润     | -292,490.19   | 11,903,810.99 | 8,592,643.07  |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0058       | 0.4051        | 0.4042        |
| 期末基金净资产      | 50,225,370.00 | 41,291,151.88 | 32,006,911.30 |
| 报告期末单位净值     | 0.9952        | 1.4051        | 1.5057        |
| 累计期末指标       | 2023年末        | 2022年末        | 2021年末        |
| 基金份额累计净值增长率  | 49.66%        | 40.51%        | 50.57%        |

#### LS211A 级主要会计数据和财务指标

| 期间数据和指标      | 2023年         | 2022年         | 2021年         |
|--------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益      | 498,846.80    | -1,185,506.27 | 4,507,010.02  |
| 本期利润         | 657,557.15    | -2,252,059.66 | 5,312,271.77  |
| 期末数据和指标      | 2023年末        | 2022年末        | 2021年末        |
| 期末可供分配利润     | -215,946.06   | -1,823,207.85 | 4,916,664.43  |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0149       | 0.3645        | 0.3917        |
| 期末基金净资产      | 14,392,256.21 | 6,862,466.85  | 18,796,326.92 |
| 报告期末单位净值     | 0.9947        | 1.3721        | 1.4974        |
| 累计期末指标       | 2023年末        | 2022年末        | 2021年末        |
| 基金份额累计净值增长   | 45.10%        | 37.21%        | 49.74%        |

|   |  |  |  |
|---|--|--|--|
| 率 |  |  |  |
|---|--|--|--|

#### LS211B 级主要会计数据和财务指标

|                  |               |               |               |
|------------------|---------------|---------------|---------------|
| 期间数据和指标          | 2023 年        | 2022 年        | 2021 年        |
| 本期已实现收益          | 2,025,259.07  | 486,603.50    | 4,109,849.66  |
| 本期利润             | 2,092,530.62  | -366,195.89   | 4,538,055.59  |
| 期末数据和指标          | 2023 年末       | 2022 年末       | 2021 年末       |
| 期末可供分配利润         | -167,890.58   | 10,042,883.53 | 3,675,978.64  |
| 期末可供分配基金份额<br>利润 | -0.0047       | 0.4118        | 0.4223        |
| 期末基金净资产          | 35,833,113.79 | 34,428,685.03 | 13,210,584.38 |
| 报告期期末单位净值        | 0.9953        | 1.4118        | 1.5178        |
| 累计期末指标           | 2023 年末       | 2022 年末       | 2021 年末       |
| 基金份额累计净值增长<br>率  | 29.26%        | 20.42%        | 51.78%        |

#### 2.2 基金净值表现

| 阶段             | 净值增长率 (%) | 净值增长率标准<br>差 (%) | 业绩比较基准收<br>益率 (%) | 业绩比较基准收益<br>率标准差 (%) |
|----------------|-----------|------------------|-------------------|----------------------|
| 当年             | 6.51      | -                | -                 | -                    |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 49.66     | -                | -                 | -                    |

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

#### LS211A 级基金净值表现

| 阶段             | 净值增长率 (%) | 净值增长率标准<br>差 (%) | 业绩比较基准收<br>益率 (%) | 业绩比较基准收益<br>率标准差 (%) |
|----------------|-----------|------------------|-------------------|----------------------|
| 当年             | 5.75      | -                | -                 | -                    |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 45.10     | -                | -                 | -                    |

#### LS211B 级基金净值表现

| 阶段             | 净值增长率 (%) | 净值增长率标准<br>差 (%) | 业绩比较基准收<br>益率 (%) | 业绩比较基准收益<br>率标准差 (%) |
|----------------|-----------|------------------|-------------------|----------------------|
| 当年             | 7.35      | -                | -                 | -                    |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 29.26     | -                | -                 | -                    |

#### 2.3 过去三年基金的利润分配情况

| 年度   | 每份基金份<br>额分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分<br>配合计  | 备注 |
|------|---------------|--------------|---------------|---------------|----|
| 2023 | 0.5014        | 0.00         | 16,926,074.67 | 16,926,074.67 | -  |
| 2022 | 0.00          | 0.00         | 0.00          | 0.00          | -  |

|      |      |      |      |      |   |
|------|------|------|------|------|---|
| 2021 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
|------|------|------|------|------|---|

#### LS211A 级过去三年基金的利润分配情况

| 年度   | 每份基金份额<br>分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计 | 备注 |
|------|---------------|--------------|---------------|--------------|----|
| 2023 | 0.4563        | 0.00         | 4,488,717.32  | 4,488,717.32 | -  |
| 2022 | 0.00          | 0.00         | 0.00          | 0.00         | -  |
| 2021 | 0.00          | 0.00         | 0.00          | 0.00         | -  |

#### LS211B 级过去三年基金的利润分配情况

| 年度   | 每份基金份额<br>分红数 | 现金形式发<br>放总额 | 再投资形式发<br>放总额 | 年度利润分配合<br>计  | 备注 |
|------|---------------|--------------|---------------|---------------|----|
| 2023 | 0.5202        | 0.00         | 12,437,357.35 | 12,437,357.35 | -  |
| 2022 | 0.00          | 0.00         | 0.00          | 0.00          | -  |
| 2021 | 0.00          | 0.00         | 0.00          | 0.00          | -  |

### 3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 2,938.734089 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 5,770.026612 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,661.77753  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00         |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额          | 5,046.983171 |

#### LS211A 级基金份额变动情况

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 500.153939   |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3,685.017189 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 2,738.288394 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00         |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额          | 1,446.882734 |

#### LS211B 级基金份额变动情况

|                           |              |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 2,438.58015  |
| 报告期期间基金总申购份额              | 2,085.009423 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 923.489136   |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00         |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额          | 3,600.100437 |

### 4、管理人说明的其他情况

#### 4.1、报告期内基金投资策略和业绩表现

截止 2023 年 12 月 31 日本基金期末基金单位净值为 0.9952 元，期末基金累计单位净值 1.4966

元。

#### 4.2、报告期内基金估值程序

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.3、报告期内基金运作情况和运作杠杆情况

无。

#### 4.4、报告期内投资收益分配和损失承担情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.5、报告期内对本基金持有人数或基金资产净值预警情形

本报告期内，本基金设置了预警线及止损线，且在报告期间内，本基金未曾触及预警线及止损线。

## 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，本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本托管人按照基金合同的约定，对本基金报告期的基金资产净值进行了复核；同时依据法律法规和基金合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，托管人未发现报告期内管理人违反基金合同约定的事项。报告期内，本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。

### 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

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

## 6、年度财务报表

### 6.1 资产负债表

金额单位：元

| 资产 | 2023-12-31 | 2022-12-31 |
|----|------------|------------|
|----|------------|------------|

|                 |                   |                   |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| <b>资产：</b>      |                   |                   |
| 银行存款            | 80,413.80         | 1,056.92          |
| 结算备付金           | 657,025.34        | 566,110.83        |
| 存出保证金           | 130,483.20        | 164,488.80        |
| 交易性金融资产         | 49,539,819.26     | 40,678,888.33     |
| 其中：股票投资         | 49,539,819.26     | 40,678,888.33     |
| 基金投资            | 0.00              | 0.00              |
| 债券投资            | 0.00              | 0.00              |
| 资产支持证券投资        | 0.00              | 0.00              |
| 贵金属投资           | 0.00              | 0.00              |
| 衍生金融资产          | 0.00              | 0.00              |
| 买入返售金融资产        | 0.00              | 0.00              |
| 应收证券清算款         | 0.00              | 0.00              |
| 应收利息            | 0.00              | 0.00              |
| 应收股利            | 0.00              | 0.00              |
| 应收申购款           | 0.00              | 0.00              |
| 递延所得税资产         | 0.00              | 0.00              |
| 其他资产            | 0.00              | 0.00              |
| 资产总计            | 50,407,741.60     | 41,410,544.88     |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| <b>负债：</b>      |                   |                   |
| 短期借款            | 0.00              | 0.00              |
| 交易性金融负债         | 0.00              | 0.00              |
| 衍生金融负债          | 0.00              | 0.00              |
| 卖出回购金融资产款       | 0.00              | 0.00              |
| 应付证券清算款         | 5.89              | 0.00              |
| 应付赎回款           | 0.00              | 0.00              |
| 应付管理人报酬         | 176,027.63        | 114,240.30        |
| 应付托管费           | 3,169.04          | 2,576.30          |
| 应付销售服务费         | 0.00              | 0.00              |
| 应付交易费用          | 0.00              | 0.00              |
| 应交税费            | 0.00              | 0.10              |
| 应付利息            | 0.00              | 0.00              |
| 应付利润            | 0.00              | 0.00              |
| 递延所得税负债         | 0.00              | 0.00              |
| 其他负债            | 3,169.04          | 2,576.30          |
| 负债合计            | 182,371.60        | 119,393.00        |
| <b>所有者权益：</b>   |                   |                   |
| 实收基金            | 50,469,831.71     | 29,387,340.89     |
| 未分配利润           | -244,461.71       | 11,903,810.99     |

|            |               |               |
|------------|---------------|---------------|
| 所有者权益合计    | 50,225,370.00 | 41,291,151.88 |
| 负债和所有者权益总计 | 50,407,741.60 | 41,410,544.88 |

注：1、其他资产：未被统计进前列分类的资产科目，主要包括其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

2、其他负债：未被统计进前列分类的负债科目，主要包括应付外包服务费、应付投资顾问费、应付咨询服务费等。

3、6.1 资产负债表中“股票投资”统计所有股票（含新三板股票）投资市值，7.1 章节中“股票投资”统计除新三板投资和上市公司定向增发股票投资以外的市值，新三板投资和上市公司定向增发股票投资有单独指标统计。

4、6.1 资产负债表中“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”单独列示，“其他资产”是总资产与已列示明细资产项的轧差项，7.1 期末基金资产组合情况中“其他资产”中除总资产与已列示明细资产项的轧差项外，还包含“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”。

## 6.2 利润表

金额单位：元

| 项目                     | 本期                      | 上年度可比期间                 |
|------------------------|-------------------------|-------------------------|
|                        | 2023年01月01日至2023年12月31日 | 2022年01月01日至2022年12月31日 |
| <b>一、收入</b>            | 4,964,847.77            | -477,667.38             |
| 1. 利息收入                | 5,383.07                | 9,067.97                |
| 其中：存款利息收入              | 4,676.76                | 8,860.89                |
| 债券利息收入                 | 0.00                    | 0.00                    |
| 资产支持证券利息收入             | 0.00                    | 0.00                    |
| 买入返售金融资产收入             | 706.31                  | 207.08                  |
| 其他利息收入                 | 0.00                    | 0.00                    |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      | 4,856,261.97            | 1,496,374.43            |
| 其中：股票投资收益              | 4,059,446.11            | 1,924,589.35            |
| 基金投资收益                 | 0.00                    | 0.00                    |
| 债券投资收益                 | 0.00                    | 0.00                    |
| 资产支持证券投资收益             | 0.00                    | 0.00                    |
| 贵金属投资收益                | 0.00                    | 0.00                    |
| 衍生工具收益                 | 47,360.00               | -622,105.58             |
| 股利收益                   | 749,455.86              | 193,890.66              |
| 其他收益                   | 0.00                    | 0.00                    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 225,981.90              | -1,919,352.78           |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     | 0.00                    | 0.00                    |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | -122,779.17             | -63,757.00              |

|                            |              |               |
|----------------------------|--------------|---------------|
| <b>减：二、费用</b>              | 2,214,760.00 | 2,140,588.17  |
| 1. 管理人报酬                   | 473,100.27   | 251,159.28    |
| 其中：固定管理费                   | 248,451.44   | 162,909.65    |
| 业绩报酬                       | 224,648.83   | 88,249.63     |
| 2. 托管费                     | 13,513.65    | 8,207.74      |
| 3. 销售服务费                   | 0.00         | 0.00          |
| 4. 外包服务费                   | 13,513.65    | 8,207.74      |
| 5. 交易费用                    | 1,703,235.07 | 1,866,304.99  |
| 6. 利息支出                    | 0.00         | 0.00          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 0.00         | 0.00          |
| 7. 其他费用                    | 11,397.36    | 6,708.42      |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | 2,750,087.77 | -2,618,255.55 |
| 减：所得税费用                    | 0.00         | 0.00          |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | 2,750,087.77 | -2,618,255.55 |

注：其他收益：未被统计进前列分类的损益类科目，主要包括投资于其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等产生的投资收益。

如业绩报酬计提模式为采取赎回、分红、固定时点扣减份额计提业绩报酬的计提模式，按照《资产管理产品相关会计处理规定》，则管理人报酬计入当期损益自2022年7月1日起执行。截至2023年12月31日LS211A级暂估业绩报酬为0元。暂估管理人报酬仅在此披露，未入账，仅供参考，与投资者实际承担的管理人报酬可能存在差异。

### 6.3 所有者权益变动表

金额单位：元

| 项目                                     | 本期<br>2023年01月01日至2023年12月31日 |                |                |
|--|-------------------------------|----------------|----------------|
|  | 实收基金                          | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 29,387,340.89                 | 11,903,810.99  | 41,291,151.88  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | 0.00                          | 2,750,087.77   | 2,750,087.77   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 21,082,490.82                 | 2,027,714.20   | 23,110,205.02  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 57,700,266.12                 | 19,883,808.55  | 77,584,074.67  |
| 2. 基金赎回款                               | -36,617,775.30                | -17,856,094.35 | -54,473,869.65 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | 0.00                          | -16,926,074.67 | -16,926,074.67 |

|  |                         |               |                |
|--|-------------------------|---------------|----------------|
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                    | 50,469,831.71           | -244,461.71   | 50,225,370.00  |
| 项目   | 上年度可比期间                 |               |                |
|  | 2022年01月01日至2022年12月31日 |               |                |
|  | 实收基金                    | 未分配利润         | 所有者权益合计        |
| 一、期初所有者权益<br>(基金净值)                                    | 21,257,021.51           | 10,749,889.79 | 32,006,911.30  |
| 二、本期经营活动产生<br>的基金净值变动数<br>(本期利润)                       | 0.00                    | -2,618,255.55 | -2,618,255.55  |
| 三、本期基金份额交易<br>产生的基金净值<br>变动数(净值减少以<br>“-”号填列)          | 8,130,319.38            | 3,772,176.75  | 11,902,496.13  |
| 其中:1.基金申购款   | 22,472,151.23           | 7,637,848.77  | 30,110,000.00  |
| 2.基金赎回款  | -14,341,831.85          | -3,865,672.02 | -18,207,503.87 |
| 四、本期向基金份额<br>持有人分配利润产生<br>的基金净值变动<br>(净值减少以“-”<br>号填列) | 0.00                    | 0.00          | 0.00           |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                                    | 29,387,340.89           | 11,903,810.99 | 41,291,151.88  |

## 7、期末投资组合情况

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:元

| 项目              | 金额           |               |
|-----------------|--------------|---------------|
| 现金类资产           | 80,413.80    |               |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 银行存款         | 0.00          |
|                 | 股权投资         | 0.00          |
|                 | 其中:优先股       | 0.00          |
|                 | 其他股权类投资      | 0.00          |
| 上市公司定向增发投资      | 上市公司定向增发股票投资 | 0.00          |
| 新三板投资           | 新三板挂牌企业投资    | 0.00          |
| 境内证券投资规模        | 结算备付金        | 657,025.34    |
|                 | 存出保证金        | 130,483.20    |
|                 | 股票投资         | 49,539,819.26 |
|                 | 债券投资         | 0.00          |
|                 | 其中:银行间市场债券   | 0.00          |
|                 | 其中:利率债       | 0.00          |
|                 | 其中:信用债       | 0.00          |
|                 | 资产支持证券       | 0.00          |
|                 | 基金投资(公募基金)   | 0.00          |
| 其中:货币基金         | 0.00         |               |

|         |                   |            |
|---------|-------------------|------------|
|         | 期货及衍生品交易保证金       | 130,483.20 |
|         | 买入返售金融资产          | 0.00       |
|         | 其他证券类标的           | 0.00       |
| 资管计划投资  | 商业银行理财产品投资        | 0.00       |
|         | 信托计划投资            | 0.00       |
|         | 基金公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00       |
|         | 保险资产管理计划投资        | 0.00       |
|         | 证券公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00       |
|         | 期货公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00       |
|         | 私募基金产品投资          | 0.00       |
|         | 未在协会备案的合伙企业份额     | 0.00       |
|         | 另类投资              | 另类投资       |
| 境内债权类投资 | 银行委托贷款规模          | 0.00       |
|         | 信托贷款              | 0.00       |
|         | 应收账款投资            | 0.00       |
|         | 各类受（收）益权投资        | 0.00       |
|         | 票据（承兑汇票等）投资       | 0.00       |
|         | 其他债权投资            | 0.00       |
| 境外投资    | 境外投资              | 0.00       |
| 其他资产    | 其他资产              | 0.00       |
| 基金负债情况  | 债券回购总额            | 0.00       |
|         | 融资、融券总额           | 0.00       |
|         | 其中：融券总额           | 0.00       |
|         | 银行借款总额            | 0.00       |
|         | 其他融资总额            | 0.00       |

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

| 序号 | 行业类别             | 公允价值          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 288,094.00    | 0.57          |
| B  | 采矿业              | 1,304,997.00  | 2.60          |
| C  | 制造业              | 32,125,833.58 | 63.96         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,036,774.20  | 4.06          |
| E  | 建筑业              | 1,420,711.97  | 2.83          |
| F  | 批发和零售业           | 1,171,941.00  | 2.33          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,107,981.00  | 2.21          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 24,660.00     | 0.05          |

|   |                 |               |       |
|---|-----------------|---------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 4,619,331.84  | 9.20  |
| J | 金融业             | 2,129,063.78  | 4.24  |
| K | 房地产业            | 823,647.28    | 1.64  |
| L | 租赁和商务服务业        | 274,071.00    | 0.55  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 404,326.29    | 0.81  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 765,482.32    | 1.52  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | 0.00          | 0.00  |
| P | 教育              | 81,471.00     | 0.16  |
| Q | 卫生和社会工作         | 369,248.00    | 0.74  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 498,294.00    | 0.99  |
| S | 综合              | 93,891.00     | 0.19  |
|   | 合计              | 49,539,819.26 | 98.64 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

| 行业类别     | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例(%) |
|----------|-----------|--------------|
| 能源       | 0.00      | 0.00         |
| 原材料      | 0.00      | 0.00         |
| 工业       | 0.00      | 0.00         |
| 非日常生活消费品 | 0.00      | 0.00         |
| 日常消费品    | 0.00      | 0.00         |
| 医疗保健     | 0.00      | 0.00         |
| 金融       | 0.00      | 0.00         |
| 信息技术     | 0.00      | 0.00         |
| 通讯业务     | 0.00      | 0.00         |
| 公用事业     | 0.00      | 0.00         |
| 房地产      | 0.00      | 0.00         |
| 合计       | 0.00      | 0.00         |

信息披露报告是否经托管机构复核：是