

国海证券量化优选一年持有期股票型集合
资产管理计划
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 6 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	76
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	78
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	78

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	78
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	78
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
7.12 投资组合报告附注	79
§ 8 基金份额持有人信息	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	80
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	80
§ 9 开放式基金份额变动	80
§ 10 重大事件揭示	81
10.1 基金份额持有人大会决议	81
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	81
10.4 基金投资策略的改变	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	82
10.8 其他重大事件	83
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	84
11.1 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	84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§ 12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	85
12.3 查阅方式	85

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划	
基金简称	国海量化优选一年持有股票	
场内简称	-	
基金主代码	970041	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 23 日	
基金管理人	国海证券股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	306,648,637.53 份	
基金合同存续期	三年	
下属分级基金的基金简称	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	970041	970042
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	20,463,806.93 份	286,184,830.60 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保障必要流动性的前提下，谋求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划将利用多因子策略研究框架，找到优质股票的共性（比如低估值、高成长、超预期、盈利稳定等），筛选出能持续稳定跑赢中证 500 指数的股票组合，并利用多种风险控制技术优化投资组合的收益与风险，在可控的风险承受范围内力争获取较高收益。多因子模型因子主要包括价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征	本集合计划为股票型集合计划，理论上其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划、债券型基金和债券型集合

	计划、混合型基金和混合型集合计划。
--	-------------------

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		国海证券股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈嘉斌	郭明
	联系电话	010-88576333	(010) 66105799
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95563	95588
传真		021-60338151	(010) 66105798
注册地址		广西桂林市辅星路 13 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		何春梅	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ghzq.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国海证券股份有限公司	上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层
-	-	-

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
本期已实现收益	-4,455,607.30	-63,174,294.10
本期利润	-4,441,013.39	-63,514,493.22
加权平均基金份额 本期利润	-0.2028	-0.2097
本期加权平均净	-12.91%	-13.37%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	-12.06%	-12.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	9,233,071.21	128,534,479.37
期末可供分配基金份额利润	0.4512	0.4491
期末基金资产净值	30,646,059.91	428,049,147.02
期末基金份额净值	1.4976	1.4957
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-11.71%	-11.82%

注：1、本基金合同于 2021 年 8 月 23 日生效，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。详情请参阅相关公告。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。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。

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

国海量化优选一年持有股票 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
过去一个月	-6.03%	0.97%	-6.55%	0.91%	0.52%	0.06%
过去三个月	-4.75%	1.23%	-6.16%	1.09%	1.41%	0.14%
过去六个月	-12.06%	1.49%	-8.46%	1.53%	-3.60%	-0.04%
过去一年	-16.56%	1.19%	-16.71%	1.21%	0.15%	-0.02%

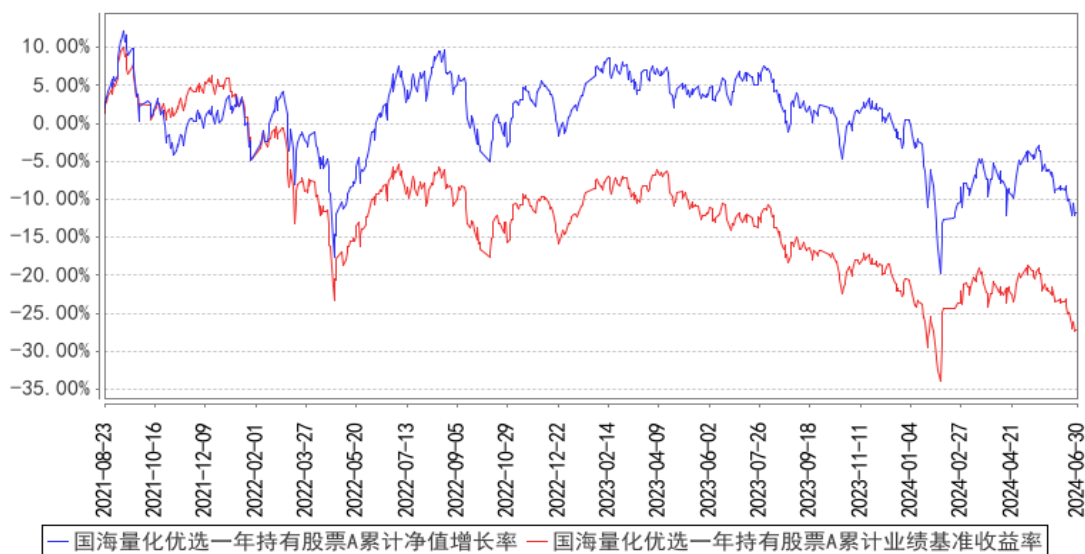
自基金合同生效起至今	-11.71%	1.17%	-27.15%	1.14%	15.44%	0.03%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

国海量化优选一年持有股票 C

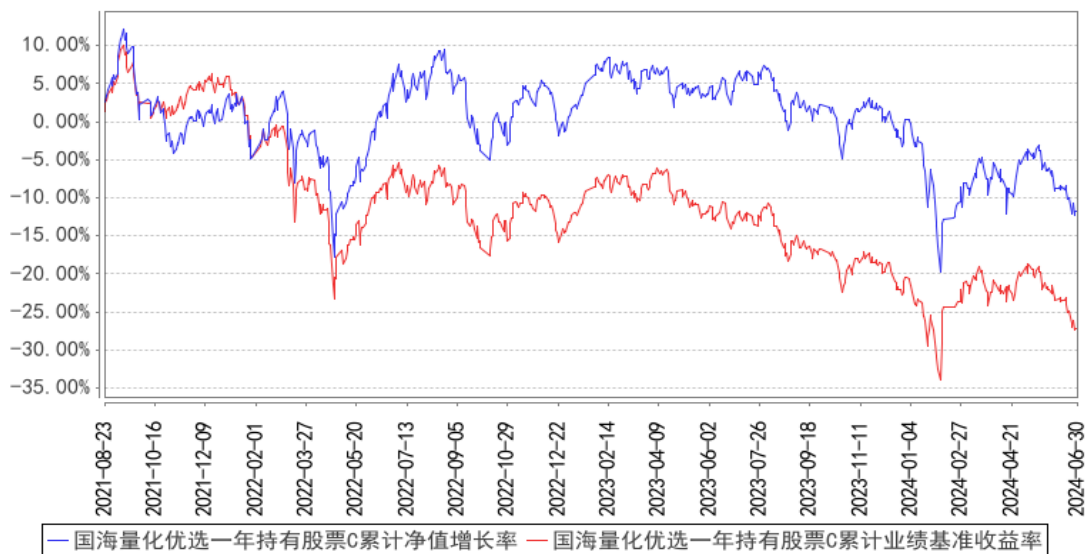
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.03%	0.98%	-6.55%	0.91%	0.52%	0.07%
过去三个月	-4.75%	1.23%	-6.16%	1.09%	1.41%	0.14%
过去六个月	-12.06%	1.49%	-8.46%	1.53%	-3.60%	-0.04%
过去一年	-16.56%	1.19%	-16.71%	1.21%	0.15%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-11.82%	1.17%	-27.15%	1.14%	15.33%	0.03%

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

国海量化优选一年持有股票A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



国海量化优选一年持有股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2024年1月1日至2024年6月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2024年6月30日）
-	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海证券是一家涵盖证券、基金、期货、私募股权投资、另类投资等多元业务体系的全国性上市综合金融服务企业。公司成立于1988年，前身为广西证券公司，是国内首批设立也是在广西区内注册的唯一一家证券公司。2011年8月，借壳桂林集琦药业股份有限公司登陆A股市场，成为国内第16家上市证券公司（股票代码：000750）。截至2024年6月末，公司在全国22个省级区域设有31家分公司、88家营业部，控股国海富兰克林基金管理有限公司、国海良时期货有限公司，全资设立国海创新资本投资管理有限公司、国海证券投资有限公司，形成了以零售财富、企业金融、机构服务与投资、资产管理、精品研究等为支撑的业务体系，为个人、企业、机构及政府客户提供多元化金融服务。

公司控股股东、实际控制人广西投资集团为广西壮族自治区本级国有资本投资公司，同时位列世界500强和中国企业500强，公司其他重要股东为实力雄厚的国有企业和上市公司。依托多元化的股权结构，公司建立了完善的法人治理体系和市场化的经营管理机制，将党的领导与公司

治理有机融合，打造了市场化的选人用人机制和激励约束机制，使公司经营管理兼具稳健和市场化特点，为公司持续健康发展提供充足动力。近年来，特别是“十三五”以来，公司经营业绩、综合实力快速成长，公司各项指标位居行业前列。

国海证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至 2022 年 12 月 31 日，旗下四只大集合产品均已完成公募化改造，为“国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划”、“国海证券安盈债券型集合资产管理计划”、“国海证券现金宝货币型集合资产管理计划”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石雨萌	本基金的基金经理	2022 年 07 月 21 日	-	7	石雨萌先生，墨尔本大学信息技术硕士，7 年证券从业经验。2017 年加入国海证券资产管理分公司，历任投资助理、投资经理助理。

注：对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
-	公募基金	-	-	-
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	-	-	-

注：本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无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 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量 5% 的情况。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，国内经济基本延续修复态势，上半年 GDP 同比增速 5.2%，结构呈现分化。生产端维持较强势头，1-5 月工业增加值累计同比增速录得 6.2%，领先于经济增速。而在需求端，净出口贡献明显，内需则受到房地产行业销售低迷影响。随着 5 月地产新政的效果逐步落地，下半年销售端有望企稳回升。

国内权益市场在 2024 年上半年波动加剧，市场在 2 月春节前快速探底后反弹，在 5 月下旬开始再次进入调整区间。风格方面，大盘相对小盘占优，价值相对成长占优。

今年以来量化策略经历了多方面的挑战，但量化策略的中长期有效性未发生变化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.4976 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为-12.06%；C 类份额基金份额净值为 1.4957 元，本报告期份额净值增长率为-12.06%，同期业绩比较基准收益率为-8.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政策环境方面，预期后续货币政策仍然将维持偏宽松，持续为经济提供支持，但是当前信贷增长受需求端约束，后续可能将以结构性工具调控为主。而财政政策方面，超长期特别国债发行、新一轮财税改革有望平衡当前政府收支，为后续财政政策拓展空间。

海外方面，地缘因素持续扰动，加之 2024 年被称为“全球选举年”，政局的变动和动荡会带来不确定的前景，海外政治事件或将成为短期核心变量。

总体来看，我们对后续股票量化策略的表现持谨慎乐观态度，同时也会持续创新和迭代，客

观认真分析模型的局限性，提升风险控制、做好风险预案，努力为投资者带来更好的投资回报和更稳健体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括投资风险负责人、基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——国海证券股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国海证券股份有限公司编制和披露的本基金 2024 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确

和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	30,800,648.43	36,446,807.69
结算备付金		12,649,655.74	4,916,042.33
存出保证金		1,811,043.54	1,642,637.03
交易性金融资产	6.4.7.2	412,723,340.14	539,200,393.92
其中：股票投资		412,723,340.14	539,200,393.92
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		3,396,207.55	14,271,522.19
应收股利		-	-
应收申购款		3,396.60	116,092.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		461,384,292.00	596,593,495.96
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		1,260,155.91	13,782,569.96
应付赎回款		276,461.34	142,747.71
应付管理人报酬		392,003.00	497,037.12
应付托管费		39,200.29	49,703.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	721,264.53	470,255.16
负债合计		2,689,085.07	14,942,313.11
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	306,648,637.53	341,967,652.17
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	152,046,569.40	239,683,530.68
净资产合计		458,695,206.93	581,651,182.85
负债和净资产总计		461,384,292.00	596,593,495.96

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 306,648,637.53 份，其中国海量化优选一年持有股票 A 基金份额总额 20,463,806.93 份，基金份额净值 1.4976 元。国海量化优选一年持有股票 C 基金份额总额 286,184,830.60 份，基金份额净值 1.4957 元；

6.2 利润表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-65,087,801.71	55,372,342.60
1. 利息收入		169,832.34	175,142.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	169,832.34	175,142.94
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-64,932,028.84	44,867,597.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-71,168,830.55	37,791,407.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-

资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	975,651.54	250,269.01
股利收益	6.4.7.19	5,261,150.17	6,825,920.94
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-325,605.21	10,329,601.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		2,867,704.90	4,564,134.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,532,487.84	3,940,672.66
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	253,235.97	357,909.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	181,914.01
8. 其他费用	6.4.7.23	81,981.09	83,638.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-67,955,506.61	50,808,207.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-67,955,506.61	50,808,207.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-67,955,506.61	50,808,207.86

6.3 净资产变动表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30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	341,967,652.17	-	239,683,530.68	581,651,182.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	341,967,652.17	-	239,683,530.68	581,651,182.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-35,319,014.64	-	-87,636,961.28	-122,955,975.92
(一)、综合收益总额	-	-	-67,955,506.61	-67,955,506.61
(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)	-35,319,014.64	-	-19,681,454.67	-55,000,469.31
其中：1. 基金申购款	2,863,807.27	-	1,611,950.89	4,475,758.16
2. 基金赎回款	-38,182,821.91	-	-21,293,405.56	-59,476,227.47
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	306,648,637.53	-	152,046,569.40	458,695,206.93
项目	上年度可比期间			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-64,323,159.08	-	-339,924.72	-64,663,083.80
(一)、综合收益总额	-	-	50,808,207.86	50,808,207.86
(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)	-64,323,159.08	-	-51,148,132.58	-115,471,291.66
其中：1. 基金申购款	38,775,357.04	-	31,121,767.89	69,897,124.93
2. 基金赎回款	- 103,098,516.12	-	-82,269,900.47	-185,368,416.59
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	377,276,966.01	-	299,085,995.37	676,362,961.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

何春梅

基金管理人负责人

谭志华

主管会计工作负责人

韦海乐

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由国海金贝壳 8 号集合资产管理计划变更而来。国海金贝壳 8 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划,2012 年 4 月 13 日经中国证券监督管理委员会出具的证监许可[2012]516 号核准设立,自

2012 年 7 月 5 日起开始募集，于 2012 年 8 月 3 日结束募集工作，并于 2012 年 8 月 9 日募集成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”）自管理人公告的生效之日起生效，原《国海金贝壳 8 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式，存续期为自集合计划变更合同生效之日起 3 年，本集合计划变更合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。本集合计划管理人为国海证券股份有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和集合计划合同的有关规定，本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证

监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年半年度的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财税[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[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号文《财政部、国家税务总局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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、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 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19 号发布和国务院令[2011]第 588 号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、增值税

根据财税[2016]140 号文件的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财税[2017]56 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日(含)起，资管产品管理人运营资管产

品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：(1) 提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；(2) 转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费，包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等，按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算，由管理人申报缴纳。

2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55 号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128 号)文件的规定，管理人运用资产管理计划买卖股票，出股票按 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	30,800,648.43
等于：本金	30,797,475.97
加：应计利息	3,172.46
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
-	-
其他存款	-

等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	30,800,648.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	424,848,974.85	-	412,723,340.14	-12,125,634.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	-	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	424,848,974.85	-	412,723,340.14	-12,125,634.71

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	15,040,840.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	15,040,840.00	-	-	-
其他衍	-	-	-	-

生工具				
合计	15,040,840.00	-	-	

注：在股指期货当日无负债结算制度下，本计划所持有的股指期货合约产生的持仓损益每日通过中国金融期货交易所结算备付金账户转入或转出。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款（结算所得的持仓损益）抵销后无余额。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2409	中证 500 股指期货 2409	14.00	13,650,560.00	-1,390,280.00
合计				-1,390,280.00
减：可抵销期货暂收款				-1,390,280.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
净额				-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日						
	债券代码	债券名称	约定返售日	估值单价	数量（张）	估值总额	其中：已售或再质押总

							额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6月30日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价	账面价值	累计减

					值变动		值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-	-

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日					
	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	601,701.41
其中：交易所市场	601,701.41
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	119,563.12
合计	721,264.53

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,681,249.41	22,681,249.41
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-2,217,442.48	-2,217,442.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	20,463,806.93	20,463,806.93

国海量化优选一年持有股票 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	319,286,402.76	319,286,402.76
本期申购	2,863,807.27	2,863,807.27
本期赎回（以“-”号填列）	-35,965,379.43	-35,965,379.43
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	286,184,830.60	286,184,830.60

6.4.7.11 其他综合收益

单位：人民币元

项目	期初余额	本期发生金额				期末余额
		本期所得 税前发生 额	减：前期 计入其他 综合收益 当期转入 损益	减：前期 计入其他 综合收益 当期转入 留存收益	减：所得 税费用	
一、不能重 分类进损益 的其他综合 收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他 权益工具投 资公允价值 变动	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

二、将重分类进损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他债权投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
其他债权投资信用减值准备	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,782,350.63	1,159,686.60	15,942,037.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,782,350.63	1,159,686.60	15,942,037.23
本期利润	-4,455,607.30	14,593.91	-4,441,013.39
本期基金份额交易产生的变动数	-1,093,672.12	-225,098.74	-1,318,770.86
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,093,672.12	-225,098.74	-1,318,770.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,233,071.21	949,181.77	10,182,252.98

国海量化优选一年持有股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	207,356,321.37	16,385,172.08	223,741,493.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	207,356,321.37	16,385,172.08	223,741,493.45
本期利润	-63,174,294.10	-340,199.12	-63,514,493.22
本期基金份额交易产生的变动数	-15,647,547.90	-2,715,135.91	-18,362,683.81
其中：基金申购款	1,428,781.61	183,169.28	1,611,950.89
基金赎回款	-17,076,329.51	-2,898,305.19	-19,974,634.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	128,534,479.37	13,329,837.05	141,864,316.42

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	63,883.05
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	104,962.00
其他	987.29
合计	169,832.34

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-71,168,830.55
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-71,168,830.55

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	5,916,246,918.10
减：卖出股票成本总额	5,979,631,988.87
减：交易费用	7,783,759.78
买卖股票差价收入	-71,168,830.55

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
减：交易费用	-
证券出借差价收入	-

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	-

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应计利息总额	-
减：交易费用	-

-	-
申购差价收入	-

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回资产支持证券成本总额	-
减：赎回资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购资产支持证券成本总额	-
减：申购资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-

-	-
申购差价收入	-

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-
买卖贵金属差价收入	-

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回贵金属份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	975,651.54

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,261,150.17
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	5,261,150.17

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	451,754.79
股票投资	451,754.79
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-777,360.00
权证投资	-
期货投资	-777,360.00
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	-325,605.21
----	-------------

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
-	-
合计	-

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-
其他	-
-	-
合计	-

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,417.97
合计	81,981.09

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本集合资产管理计划仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本资产管理计划无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
广西投资集团有限公司	基金管理人的股东
广西产投资本运营集团有限公司（原名：广西融桂物流集团有限公司）	基金管理人的股东
广西梧州中恒集团股份有限公司	基金管理人的股东
广西投资集团金融控股有限公司	基金管理人的股东
广西能源股份有限公司（2023 年 6 月 1 日更名，原名：广西桂东电力股份有限公司）	基金管理人的股东
广西永盛石油化工有限公司	基金管理人的股东
广西金融投资集团有限公司	基金管理人的股东
国海富兰克林基金管理（上海）有限公司	基金管理人的子公司
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的子公司
国海良时期货有限公司	基金管理人的子公司
国海良时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
国海创新资本投资管理有限公司	基金管理人的子公司
西安国海景恒创业投资有限公司	基金管理人的子公司
深圳市国海贰号投资发展合伙企业（有限合伙）	基金管理人的子公司
深圳市国海叁号投资发展合伙企业（有限合伙）	基金管理人的子公司
国海证券投资有限公司	基金管理人的子公司
中国工商银行股份有限公司	托管人

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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 (%)

国海证券	11,768,950,098.40	100.00	11,662,057,726.16	100.00
------	-------------------	--------	-------------------	--------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未发生债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回 购 成交总额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未发生债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期权证 成交总额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未发生权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30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 (%)
国海证券	4,070,846.69	100.00	601,701.41	100.00

关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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 (%)
国海证券	3,863,490.11	100.00	401,258.91	100.00

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,532,487.84	3,940,672.66
其中：应支付销售机构的客户维 护费	1,079,139.91	-
应支付基金管理人的净管理费	1,453,347.93	3,940,672.66

注：① 集合计划管理费计提方法：A类、C类份额的管理费率均为1.0%，本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.0%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

② 集合计划管理费计算公式为：每日应计提的集合计划管理费=前一日集合计划资产净值×管理费率÷当年天数；

③ 管理人业绩报酬计提方法：

1) A类份额业绩报酬计提方法：管理人对A类份额持有人每笔认/申购份额年化收益率在5%（不含）至25%（含）的部分提取20%作为业绩报酬；对A类份额持有人每笔认/申购份额年化收益率超过25%（不含）的部分提取30%作为业绩报酬；业绩报酬在集合计划分红日、集合计划份额持有人赎回确认日和集合计划终止日计提；

2) C类份额业绩报酬计提方法：在C类份额持有人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据集合计划份额持有人持有本集合计划的期间年化收益率（R），对本集合计划份额期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。

④ 此处的管理费包含管理费2,532,359.91元，管理人业绩报酬127.93元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	253,235.97	357,909.17

注：①本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提，每日计提，逐日累计至

每月月末，按月支付；

② 集合计划托管费计算公式为：每日应计提的集合计划托管费 = 前一日集合计划资产净值 × 年托管费率 ÷ 当年天数；

6.4.10.2.3 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期

2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 23 日）持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期初持有的基金份额	1,131,926.77	12,425,702.16
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	2,000,000.00
报告期末持有的基金份额	1,131,926.77	10,425,702.16
报告期末持有的基金份额	5.53%	3.64%

占基金总份额比例		
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 23 日）持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期初持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	1,131,926.77	13,425,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.70%	3.80%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国海量化优选一年持有股票 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
-	-	-	-	-

份额单位：份

国海量化优选一年持有股票 C

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
-	-	-	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	30,800,648.43	63,883.05	37,683,614.78	75,431.14

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人保管，按银行同业利率计息。本集合计划用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A								
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
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-
国海量化优选一年持有股票 C								
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
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
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：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300630	普利制药	2024 年 05 月 06 日	重大事项停牌	12.35	-	-	37,700	548,361.49	465,595.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额

-	-	-	-	-	-
合计				-	-

注：本基金本期末未开展银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未开展交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由公司投资决策与风险控制委员会、资产管理业务发展与风险管理委员会、资管分公司产品评审与投资决策委员会、资管分公司公募产品投资决策与风险管理委员会组成的四级风险管理体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他公开募集性质的集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本集合计划本报告期末未持有债券投资、同业存单投资、资产支持证券投资，无重大信用风险。

6.4.13.2.1 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-

资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持证券主要在证券交易所上市，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 6.4.12（如有）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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中利率敏感性金融工具配置比例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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,800,648.43	-	-	-	30,800,648.43
结算备付金	12,649,655.74	-	-	-	12,649,655.74
存出保证金	1,811,043.54	-	-	-	1,811,043.54
交易性金融资产	-	-	-	-412,723,340.14	412,723,340.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	3,396.60	3,396.60
应收清算款	-	-	-	3,396,207.55	3,396,207.55
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	45,261,347.71	-	-	-416,122,944.29	461,384,292.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	276,461.34	276,461.34
应付管理人报酬	-	-	-	392,003.00	392,003.00
应付托管费	-	-	-	39,200.29	39,200.29
应付清算款	-	-	-	1,260,155.91	1,260,155.91
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	721,264.53	721,264.53
负债总计	-	-	-	2,689,085.07	2,689,085.07
利率敏感度缺口	45,261,347.71	-	-	-413,433,859.22	458,695,206.93
上年度末 2023年12月31日					
资产					
货币资金	36,446,807.69	-	-	-	36,446,807.69
结算备付金	4,916,042.33	-	-	-	4,916,042.33
存出保证金	1,642,637.03	-	-	-	1,642,637.03
交易性金融资产	-	-	-	-539,200,393.92	539,200,393.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	116,092.80	116,092.80
应收清算款	-	-	-	14,271,522.19	14,271,522.19
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	43,005,487.05	-	-	553,588,008.91	596,593,495.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	142,747.71	142,747.71
应付管理人报酬	-	-	-	497,037.12	497,037.12
应付托管费	-	-	-	49,703.16	49,703.16
应付清算款	-	-	-	13,782,569.96	13,782,569.96
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	470,255.16	470,255.16
负债总计	-	-	-	14,942,313.11	14,942,313.11
利率敏感度缺口	43,005,487.05	-	-	-538,645,695.80	581,651,182.85

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	-	-	-

注：本集合计划本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本集合计划净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	-	-	-
	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的 资产				
货币资金	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	-	-	-

注：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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票等资产损失的可能性。

本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023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	412,723,340.14	89.98	539,200,393.92	92.70
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	412,723,340.14	89.98	539,200,393.92	92.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	20,876,581.37	27,887,896.29
业绩比较基准下降5%	-20,876,581.37	-27,887,896.29	

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-
----	---

	-		
	-		
分析	风险价值 (单位: 人民币元)	本期末 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	-	-	-
	合计	-	-

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次, 由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值;

第三层次: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	412,257,745.14	539,020,345.92
第二层次	465,595.00	180,048.00
第三层次	-	-
合计	412,723,340.14	539,200,393.92

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

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划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。对于公开市场交易的股票、债券等投资, 若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况,

本集合计划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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

-

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

-

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、暂估业绩报酬对集合计划份额净值的影响

截至资产负债表日，集合计划份额总额 306,648,637.53 份，集合计划暂估业绩报酬前的资产总净值 458,695,206.93 元，其中 A 型集合计划暂估业绩报酬前的资产净值 30,646,059.91 元，该净值未体现暂估业绩报酬，C 型集合计划暂估业绩报酬前的资产净值 428,049,147.02 元，该净值未体现暂估业绩报酬 2,470.74 元，暂估业绩报酬后的资产净值 428,046,676.28 元。

暂估业绩报酬为假设本集合计划以本报告期最后一个交易日(同资产管理合同约定)为清算确认日，按照当日本集合计划份额净值(计提业绩报酬前)清算，根据计划份额持有人各自持有的份额(包括未到期份额)于当日按照期末净值(计提业绩报酬前)虚拟计提业绩报酬汇总数。上述暂估金额是各计划持有人的暂估业绩报酬的合计，各计划委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

2、除暂估业绩报酬外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	412,723,340.14	89.45
	其中：股票	412,723,340.14	89.45
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	43,450,304.17	9.42
-	-	-	-
8	其他各项资产	5,210,647.69	1.13
9	合计	461,384,292.00	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,012,744.00	0.44
B	采矿业	20,858,583.35	4.55
C	制造业	255,190,854.84	55.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,673,995.00	3.64
E	建筑业	8,097,406.50	1.77
F	批发和零售业	14,116,449.28	3.08
G	交通运输、仓储和邮政业	14,344,440.38	3.13
H	住宿和餐饮业	341,286.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,219,776.10	4.19
J	金融业	36,336,850.24	7.92
K	房地产业	6,816,716.00	1.49
L	租赁和商务服务业	3,415,619.78	0.74
M	科学研究和技术服务业	2,855,447.71	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	4,322,090.56	0.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	600,219.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,237,571.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	4,501,668.00	0.98
S	综合	1,781,622.40	0.39
	合计	412,723,340.14	89.98

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
可选消费	-	-
主要消费	-	-
医药卫生	-	-

金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	-	-

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	46,841	4,944,067.55	1.08
2	002463	沪电股份	112,949	4,122,638.50	0.90
3	002340	格林美	466,500	2,971,605.00	0.65
4	000975	银泰黄金	179,000	2,915,910.00	0.64
5	600160	巨化股份	116,700	2,815,971.00	0.61
6	601168	西部矿业	154,269	2,769,128.55	0.60
7	002966	苏州银行	361,770	2,713,275.00	0.59
8	002028	思源电气	37,100	2,481,990.00	0.54
9	002156	通富微电	104,200	2,333,038.00	0.51
10	002422	科伦药业	76,500	2,320,245.00	0.51
11	002078	太阳纸业	165,200	2,304,540.00	0.50
12	601233	桐昆股份	142,791	2,278,944.36	0.50
13	601128	常熟银行	299,885	2,270,129.45	0.49
14	300207	欣旺达	149,100	2,261,847.00	0.49
15	601058	赛轮轮胎	158,600	2,220,400.00	0.48
16	600988	赤峰黄金	132,400	2,163,416.00	0.47
17	600161	天坛生物	86,320	2,106,208.00	0.46
18	600157	永泰能源	1,770,300	2,088,954.00	0.46
19	601577	长沙银行	251,800	2,059,724.00	0.45
20	300003	乐普医疗	138,600	2,056,824.00	0.45
21	600985	淮北矿业	119,000	1,992,060.00	0.43
22	601077	渝农商行	389,400	1,954,788.00	0.43
23	000683	远兴能源	277,900	1,920,289.00	0.42
24	002409	雅克科技	30,500	1,918,755.00	0.42
25	601717	郑煤机	124,900	1,848,520.00	0.40
26	601666	平煤股份	162,200	1,816,640.00	0.40
27	688169	石头科技	4,597	1,804,782.20	0.39
28	000703	恒逸石化	248,300	1,760,447.00	0.38
29	300866	安克创新	24,688	1,758,032.48	0.38
30	600879	航天电子	225,500	1,752,135.00	0.38
31	000960	锡业股份	113,000	1,750,370.00	0.38
32	300144	宋城演艺	215,700	1,732,071.00	0.38
33	600038	中直股份	41,800	1,718,398.00	0.37

34	000423	东阿阿胶	27,400	1,715,240.00	0.37
35	688188	上海柏楚电子科技	9,235	1,704,319.25	0.37
36	601997	贵阳银行	321,700	1,695,359.00	0.37
37	300724	捷佳伟创	31,292	1,690,080.92	0.37
38	601179	中国西电	206,000	1,656,240.00	0.36
39	300285	国瓷材料	92,300	1,647,555.00	0.36
40	002472	双环传动	73,300	1,614,066.00	0.35
41	000830	鲁西化工	137,100	1,588,989.00	0.35
42	600673	东阳光	224,300	1,579,072.00	0.34
43	601555	东吴证券	254,179	1,499,656.10	0.33
44	603816	顾家家居	46,400	1,498,256.00	0.33
45	300251	光线传媒	177,500	1,492,775.00	0.33
46	603939	益丰药房	60,564	1,486,846.20	0.32
47	002064	华峰化学	203,200	1,456,944.00	0.32
48	601991	大唐发电	480,800	1,447,208.00	0.32
49	601696	中银证券	155,344	1,410,523.52	0.31
50	601016	节能风电	470,100	1,405,599.00	0.31
51	600970	中材国际	116,000	1,398,960.00	0.30
52	002958	青农商行	515,100	1,380,468.00	0.30
53	300487	蓝晓科技	32,800	1,369,728.00	0.30
54	600177	雅戈尔	190,560	1,356,787.20	0.30
55	601636	旗滨集团	210,300	1,356,435.00	0.30
56	002507	涪陵榨菜	109,840	1,345,540.00	0.29
57	688002	睿创微纳	47,951	1,341,189.47	0.29
58	601966	玲珑轮胎	72,800	1,337,336.00	0.29
59	603893	瑞芯微	22,600	1,337,242.00	0.29
60	000887	中鼎股份	108,600	1,329,264.00	0.29
61	603606	东方电缆	27,000	1,317,870.00	0.29
62	002152	广电运通	123,331	1,290,042.26	0.28
63	601216	君正集团	339,400	1,252,386.00	0.27
64	002557	洽洽食品	44,300	1,248,817.00	0.27
65	600566	济川药业	38,800	1,230,348.00	0.27
66	002532	天山铝业	151,600	1,229,476.00	0.27
67	000563	陕国投 A	447,000	1,229,250.00	0.27
68	002019	亿帆医药	97,200	1,201,392.00	0.26
69	688234	天岳先进	25,424	1,192,894.08	0.26
70	601187	厦门银行	218,900	1,166,737.00	0.25
71	300001	特锐德	57,800	1,162,936.00	0.25
72	002273	水晶光电	66,600	1,130,868.00	0.25
73	000709	河钢股份	580,800	1,126,752.00	0.25
74	603883	老百姓	60,390	1,108,760.40	0.24
75	600642	申能股份	124,600	1,100,218.00	0.24
76	603338	浙江鼎力	18,200	1,099,644.00	0.24

77	002138	顺络电子	39,100	1,073,686.00	0.23
78	000998	隆平高科	109,100	1,072,453.00	0.23
79	000559	万向钱潮	237,800	1,060,588.00	0.23
80	603517	绝味食品	68,400	1,053,360.00	0.23
81	600315	上海家化	58,900	1,047,242.00	0.23
82	002065	东华软件	230,582	1,042,230.64	0.23
83	603233	大参林	71,100	1,016,730.00	0.22
84	600873	梅花生物	101,100	1,013,022.00	0.22
85	000050	深天马 A	138,500	1,008,280.00	0.22
86	600399	抚顺特钢	178,600	1,005,518.00	0.22
87	600079	人福医药	58,055	996,804.35	0.22
88	000785	居然之家	407,600	990,468.00	0.22
89	600498	烽火通信	62,000	985,800.00	0.21
90	688281	华秦科技实业	11,800	983,176.00	0.21
91	688099	晶晨半导体	16,521	980,025.72	0.21
92	600208	新湖中宝	619,400	978,652.00	0.21
93	300558	贝达药业	29,200	950,460.00	0.21
94	603160	汇顶科技	13,800	948,750.00	0.21
95	600928	西安银行	288,145	942,234.15	0.21
96	002008	大族激光	43,800	911,040.00	0.20
97	002266	浙富控股	326,500	910,935.00	0.20
98	603305	旭升集团	85,100	898,656.00	0.20
99	002563	森马服饰	154,090	895,262.90	0.20
100	002423	中粮资本	118,200	885,318.00	0.19
101	603317	天味食品	77,196	880,806.36	0.19
102	002673	西部证券	141,758	877,482.02	0.19
103	001227	兰州银行	366,300	871,794.00	0.19
104	000089	深圳机场	136,200	870,318.00	0.19
105	002468	申通快递	101,800	855,120.00	0.19
106	002399	海普瑞	97,800	847,926.00	0.18
107	600956	新天绿能	102,300	835,791.00	0.18
108	002831	裕同科技	32,400	829,116.00	0.18
109	600282	南钢股份	165,180	822,596.40	0.18
110	600141	兴发集团	43,100	822,348.00	0.18
111	600521	华海药业	47,900	816,695.00	0.18
112	600549	厦门钨业	47,300	815,925.00	0.18
113	688728	格科微有限公司	67,257	814,482.27	0.18
114	002511	中顺洁柔	115,700	800,644.00	0.17
115	002155	湖南黄金	44,200	800,020.00	0.17
116	603866	桃李面包	157,300	797,511.00	0.17
117	601598	中国外运	141,600	797,208.00	0.17
118	600021	上海电力	80,500	796,145.00	0.17
119	600820	隧道股份	121,400	792,742.00	0.17

120	600369	西南证券	219,500	785,810.00	0.17
121	600583	海油工程	128,900	761,799.00	0.17
122	600167	联美控股	145,000	755,450.00	0.16
123	002032	苏泊尔	14,900	746,490.00	0.16
124	002558	巨人网络	79,000	745,760.00	0.16
125	600299	安迪苏	76,000	737,200.00	0.16
126	300373	扬杰科技	18,800	731,320.00	0.16
127	688208	道通科技	30,283	731,031.62	0.16
128	603589	口子窖	18,500	725,015.00	0.16
129	300776	帝尔激光	15,600	716,976.00	0.16
130	600699	均胜电子	47,500	703,950.00	0.15
131	600582	天地科技	100,200	690,378.00	0.15
132	002120	韵达股份	87,900	680,346.00	0.15
133	603658	安图生物	14,520	668,936.40	0.15
134	000027	深圳能源	91,300	666,490.00	0.15
135	002430	杭氧股份	29,800	663,050.00	0.14
136	603568	伟明环保	31,930	657,119.40	0.14
137	601866	中远海发	250,700	646,806.00	0.14
138	600380	XD 健康元	57,500	642,275.00	0.14
139	000930	中粮科技	127,500	641,325.00	0.14
140	601880	辽港股份	515,150	633,634.50	0.14
141	601156	东航物流	31,100	632,885.00	0.14
142	600707	彩虹股份	92,100	627,201.00	0.14
143	600801	华新水泥	45,000	618,750.00	0.13
144	002607	中公教育	392,300	600,219.00	0.13
145	002244	滨江集团	81,700	593,142.00	0.13
146	002195	二三四五	227,000	569,770.00	0.12
147	002791	坚朗五金	21,900	566,553.00	0.12
148	600827	百联股份	76,531	564,798.78	0.12
149	000825	太钢不锈	162,400	548,912.00	0.12
150	000402	金融街	232,600	546,610.00	0.12
151	600066	宇通客车	21,100	544,380.00	0.12
152	600871	石化油服	306,800	533,832.00	0.12
153	688105	诺唯赞生物	26,552	531,305.52	0.12
154	300394	天孚通信	5,940	525,214.80	0.11
155	002241	歌尔股份	26,600	518,966.00	0.11
156	600143	金发科技	78,500	518,885.00	0.11
157	688608	恒玄科技	3,526	516,135.88	0.11
158	300383	光环新网	61,000	515,450.00	0.11
159	002745	木林森	63,900	515,034.00	0.11
160	600183	生益科技	24,400	513,864.00	0.11
161	688213	思特威电子科技	10,576	512,936.00	0.11
162	601872	招商轮船	60,700	512,915.00	0.11

163	002948	青岛银行	151,800	511,566.00	0.11
164	300679	电连技术	12,700	510,921.00	0.11
165	002249	大洋电机	107,600	508,948.00	0.11
166	603439	贵州三力	39,800	507,848.00	0.11
167	601326	秦港股份	160,200	507,834.00	0.11
168	002245	蔚蓝锂芯	65,400	506,850.00	0.11
169	603995	甬金股份	28,900	506,328.00	0.11
170	601137	博威合金	33,200	505,968.00	0.11
171	002498	汉缆股份	153,700	505,673.00	0.11
172	002534	西子洁能	50,500	505,505.00	0.11
173	603693	江苏新能	43,500	505,470.00	0.11
174	601799	星宇股份	4,500	504,180.00	0.11
175	000065	北方国际	48,600	503,982.00	0.11
176	002318	久立特材	21,600	503,928.00	0.11
177	601963	重庆银行	65,000	503,750.00	0.11
178	688008	澜起科技	8,804	503,236.64	0.11
179	600547	山东黄金	18,360	502,696.80	0.11
180	300408	三环集团	17,200	502,068.00	0.11
181	601868	中国能建	236,800	502,016.00	0.11
182	300428	立中集团	27,000	501,930.00	0.11
183	600125	铁龙物流	84,000	501,480.00	0.11
184	600874	创业环保	89,700	501,423.00	0.11
185	603187	海容冷链	43,000	501,380.00	0.11
186	601877	正泰电器	26,300	501,278.00	0.11
187	000928	中钢国际	90,300	501,165.00	0.11
188	600662	外服控股	124,978	501,161.78	0.11
189	600475	华光环能	57,500	500,825.00	0.11
190	601068	中铝国际	118,950	500,779.50	0.11
191	600711	盛屯矿业	136,400	500,588.00	0.11
192	300747	锐科激光	28,200	500,550.00	0.11
193	600916	中国黄金	52,000	500,240.00	0.11
194	300662	科锐国际	31,000	500,030.00	0.11
195	603299	苏盐井神	52,600	499,700.00	0.11
196	000990	诚志股份	67,100	499,224.00	0.11
197	688349	三一重能	20,097	499,209.48	0.11
198	000828	东莞控股	55,400	499,154.00	0.11
199	002206	海利得	130,600	498,892.00	0.11
200	002978	安宁股份	17,900	498,694.00	0.11
201	600926	杭州银行	38,200	498,510.00	0.11
202	600660	福耀玻璃	10,400	498,160.00	0.11
203	300226	上海钢联	29,400	498,036.00	0.11
204	603055	台华新材	49,100	497,383.00	0.11
205	002135	东南网架	125,600	497,376.00	0.11

206	002202	金风科技	74,000	497,280.00	0.11
207	300039	上海凯宝	92,900	497,015.00	0.11
208	600682	南京新百	99,600	497,004.00	0.11
209	600618	氯碱化工	56,600	496,948.00	0.11
210	603501	韦尔股份	5,000	496,850.00	0.11
211	000567	海德股份	88,500	496,485.00	0.11
212	002573	清新环境	128,200	496,134.00	0.11
213	601969	海南矿业	78,200	495,788.00	0.11
214	002053	云南能投	41,000	495,690.00	0.11
215	002034	旺能环境	38,100	495,681.00	0.11
216	600903	贵州燃气	79,400	495,456.00	0.11
217	002001	新和成	25,800	495,360.00	0.11
218	603093	南华期货	57,200	495,352.00	0.11
219	600346	恒力石化	35,500	495,225.00	0.11
220	301087	可孚医疗	14,600	494,940.00	0.11
221	603229	奥翔药业	49,200	494,460.00	0.11
222	002601	龙佰集团	26,600	493,962.00	0.11
223	600004	白云机场	52,100	493,908.00	0.11
224	002701	奥瑞金	118,700	493,792.00	0.11
225	601689	拓普集团	9,200	493,212.00	0.11
226	600718	东软集团	59,600	492,892.00	0.11
227	603567	珍宝岛	46,800	492,804.00	0.11
228	002697	红旗连锁	106,400	492,632.00	0.11
229	002608	江苏国信	63,500	492,125.00	0.11
230	001338	永顺泰	50,200	491,960.00	0.11
231	688526	武汉科前生物	33,441	491,248.29	0.11
232	300841	康华生物	9,700	491,208.00	0.11
233	605507	国邦医药	29,500	491,175.00	0.11
234	300130	新国都	29,500	490,880.00	0.11
235	605369	拱东医疗	12,300	490,770.00	0.11
236	002959	小熊电器	10,200	490,722.00	0.11
237	002961	瑞达期货	44,800	490,560.00	0.11
238	300755	华致酒行	35,900	490,394.00	0.11
239	000557	西部创业	130,300	489,928.00	0.11
240	688798	艾为电子	8,644	489,423.28	0.11
241	601100	恒立液压	10,500	489,090.00	0.11
242	000718	苏宁环球	291,100	489,048.00	0.11
243	002041	登海种业	60,500	488,840.00	0.11
244	301071	力量钻石	17,640	488,804.40	0.11
245	002191	劲嘉股份	135,200	488,072.00	0.11
246	002212	天融信	100,200	487,974.00	0.11
247	600861	北京人力	29,900	487,968.00	0.11
248	603899	晨光股份	15,600	487,968.00	0.11

249	300451	创业慧康	141,000	487,860.00	0.11
250	688326	经纬恒润	8,500	487,305.00	0.11
251	600845	宝信软件	15,240	486,613.20	0.11
252	000786	北新建材	16,400	486,424.00	0.11
253	601865	福莱特	24,200	486,420.00	0.11
254	600837	海通证券	56,800	486,208.00	0.11
255	603659	璞泰来	34,400	486,072.00	0.11
256	603806	福斯特	32,972	484,688.40	0.11
257	002727	一心堂	31,900	481,371.00	0.10
258	000963	华东医药	17,260	480,000.60	0.10
259	603486	科沃斯	10,100	476,518.00	0.10
260	002867	周大生	36,200	472,772.00	0.10
261	688789	杭州宏华数码 科技	4,368	470,870.40	0.10
262	002926	华西证券	71,100	468,549.00	0.10
263	000581	威孚高科	28,700	467,236.00	0.10
264	601333	广深铁路	144,200	467,208.00	0.10
265	002850	科达利	6,100	465,918.00	0.10
266	300630	普利制药	37,700	465,595.00	0.10
267	000933	神火股份	22,900	463,267.00	0.10
268	002237	恒邦股份	40,200	462,702.00	0.10
269	600458	时代新材	45,700	461,570.00	0.10
270	601022	宁波远洋	52,300	461,286.00	0.10
271	000968	蓝焰控股	72,500	461,100.00	0.10
272	002274	华昌化工	62,100	460,782.00	0.10
273	000552	甘肃能化	132,400	459,428.00	0.10
274	600420	国药现代	42,900	458,172.00	0.10
275	603786	科博达	7,100	455,465.00	0.10
276	002837	英维克	21,250	454,537.50	0.10
277	688018	乐鑫科技	4,600	453,928.00	0.10
278	002203	海亮股份	56,800	453,264.00	0.10
279	603179	新泉股份	11,500	451,260.00	0.10
280	603896	寿仙谷	19,200	450,624.00	0.10
281	688187	时代电气	9,115	450,098.70	0.10
282	603733	仙鹤股份	25,600	450,048.00	0.10
283	603345	安井食品	6,000	445,860.00	0.10
284	300957	贝泰妮	9,200	444,544.00	0.10
285	688111	金山办公	1,951	443,852.50	0.10
286	300482	万孚生物	18,000	439,200.00	0.10
287	601989	中国重工	87,400	430,882.00	0.09
288	600400	红豆股份	198,100	429,877.00	0.09
289	600760	中航沈飞	10,620	425,862.00	0.09
290	300973	立高食品	15,100	424,159.00	0.09
291	688012	中微半导体设	3,000	423,780.00	0.09

		备			
292	601808	中海油服	24,600	423,120.00	0.09
293	600219	南山铝业	110,700	421,767.00	0.09
294	603983	丸美股份	15,300	421,209.00	0.09
295	300628	亿联网络	11,400	419,178.00	0.09
296	300595	欧普康视	26,700	418,656.00	0.09
297	000157	中联重科	54,500	418,560.00	0.09
298	601669	中国电建	74,700	417,573.00	0.09
299	601618	中国中冶	134,700	417,570.00	0.09
300	600528	中铁工业	57,000	417,240.00	0.09
301	002236	大华股份	26,900	415,874.00	0.09
302	601916	浙商银行	150,400	415,104.00	0.09
303	600600	青岛啤酒	5,700	414,789.00	0.09
304	600015	华夏银行	64,700	414,080.00	0.09
305	601169	北京银行	70,900	414,056.00	0.09
306	002311	海大集团	8,800	414,040.00	0.09
307	000999	华润三九	9,720	413,877.60	0.09
308	600010	包钢股份	295,500	413,700.00	0.09
309	600332	白云山	14,100	413,553.00	0.09
310	000617	中油资本	74,900	413,448.00	0.09
311	601838	成都银行	27,200	413,168.00	0.09
312	600426	华鲁恒升	15,500	412,920.00	0.09
313	300316	晶盛机电	14,300	410,839.00	0.09
314	688536	思瑞浦股份	4,200	410,802.00	0.09
315	001979	招商蛇口	46,700	410,493.00	0.09
316	600585	海螺水泥	17,400	410,466.00	0.09
317	002074	国轩高科	21,400	409,810.00	0.09
318	600196	复星医药	18,500	409,590.00	0.09
319	002920	德赛西威	4,700	409,323.00	0.09
320	601211	国泰君安	30,200	409,210.00	0.09
321	601688	华泰证券	32,900	407,631.00	0.09
322	000937	冀中能源	60,600	406,020.00	0.09
323	300832	新产业	6,000	404,640.00	0.09
324	000708	中信特钢	29,800	404,386.00	0.09
325	002304	洋河股份	5,000	403,700.00	0.09
326	600999	招商证券	28,900	401,999.00	0.09
327	601901	方正证券	51,900	401,187.00	0.09
328	300661	圣邦股份	4,800	397,344.00	0.09
329	600335	国机汽车	67,800	391,206.00	0.09
330	603348	文灿股份	14,100	390,429.00	0.09
331	001286	C 陕西能	32,600	375,878.00	0.08
332	002583	海能达	91,800	373,626.00	0.08
333	601001	晋控煤业	22,600	373,352.00	0.08

334	000600	建投能源	59,200	372,960.00	0.08
335	002984	森麒麟	15,400	370,986.00	0.08
336	601975	招商南油	102,900	369,411.00	0.08
337	002555	三七互娱	28,200	368,010.00	0.08
338	688516	奥特维科技	8,800	367,928.00	0.08
339	002402	和而泰	34,300	367,353.00	0.08
340	601369	陕鼓动力	45,800	367,316.00	0.08
341	688617	惠泰医疗	805	367,160.50	0.08
342	000661	长春高新	4,000	367,080.00	0.08
343	688363	华熙生物	6,470	366,007.90	0.08
344	688777	中控技术	9,704	365,840.80	0.08
345	300054	鼎龙股份	16,100	365,148.00	0.08
346	600717	天津港	85,500	365,085.00	0.08
347	000923	河钢资源	21,200	365,064.00	0.08
348	601101	昊华能源	39,700	364,843.00	0.08
349	300888	稳健医疗	14,400	364,320.00	0.08
350	601766	中国中车	48,400	363,484.00	0.08
351	002859	洁美科技	18,100	363,448.00	0.08
352	600557	康缘药业	23,100	362,670.00	0.08
353	600459	贵研铂业	26,800	362,068.00	0.08
354	300457	赢合科技	20,300	361,949.00	0.08
355	601619	嘉泽新能	119,400	361,782.00	0.08
356	301219	腾远钴业	9,400	359,644.00	0.08
357	603323	苏农银行	74,700	359,307.00	0.08
358	300596	利安隆	13,200	358,116.00	0.08
359	002901	大博医疗	13,806	356,608.98	0.08
360	600477	杭萧钢构	153,000	356,490.00	0.08
361	601800	中国交建	39,800	355,812.00	0.08
362	600050	中国联通	75,700	355,790.00	0.08
363	600657	信达地产	116,600	355,630.00	0.08
364	688029	南微医学科技	5,773	355,385.88	0.08
365	002004	华邦健康	93,500	355,300.00	0.08
366	688139	海尔生物	9,523	354,255.60	0.08
367	002242	九阳股份	33,800	354,224.00	0.08
368	002185	华天科技	43,300	352,895.00	0.08
369	601390	中国中铁	54,100	352,732.00	0.08
370	002371	北方华创	1,100	351,879.00	0.08
371	000725	京东方 A	86,000	351,740.00	0.08
372	002517	恺英网络	36,800	351,440.00	0.08
373	300136	信维通信	17,900	350,482.00	0.08
374	600016	民生银行	92,400	350,196.00	0.08
375	000001	平安银行	34,300	348,145.00	0.08
376	688041	海光信息	4,800	337,536.00	0.07

377	000400	许继电气	9,773	336,288.93	0.07
378	600096	云天化	17,100	332,082.00	0.07
379	002508	老板电器	15,000	331,500.00	0.07
380	603328	依顿电子	40,300	316,758.00	0.07
381	601139	深圳燃气	46,800	312,624.00	0.07
382	300638	广和通	18,200	311,220.00	0.07
383	002797	第一创业	60,700	308,963.00	0.07
384	002782	可立克	27,700	306,916.00	0.07
385	300820	英杰电气	7,800	306,852.00	0.07
386	600529	山东药玻	12,100	306,614.00	0.07
387	301291	C 明阳电	10,200	306,510.00	0.07
388	301155	海力风电	7,600	305,748.00	0.07
389	688800	瑞可达连接系 统	10,875	305,370.00	0.07
390	003021	兆威机电	6,600	304,590.00	0.07
391	300012	华测检测	30,200	303,812.00	0.07
392	603583	捷昌驱动	14,900	303,662.00	0.07
393	603596	伯特利	7,800	303,420.00	0.07
394	601311	骆驼股份	37,800	303,156.00	0.07
395	002023	海特高新	33,100	302,865.00	0.07
396	002979	雷赛智能	16,600	302,120.00	0.07
397	000035	中国天楹	66,600	301,698.00	0.07
398	601609	金田股份	53,300	301,678.00	0.07
399	600508	XD 上海能源	21,300	301,395.00	0.07
400	000969	安泰科技	38,000	301,340.00	0.07
401	002204	大连重工	70,500	301,035.00	0.07
402	300470	中密控股	8,900	300,909.00	0.07
403	002267	陕天然气	39,800	300,888.00	0.07
404	000795	英洛华	54,300	300,822.00	0.07
405	000758	中色股份	59,200	300,736.00	0.07
406	600490	鹏欣资源	115,600	300,560.00	0.07
407	600862	中航高科	16,000	300,480.00	0.07
408	002276	万马股份	41,900	300,423.00	0.07
409	002724	海洋王	67,500	300,375.00	0.07
410	603118	共进股份	44,800	300,160.00	0.07
411	600210	紫江企业	56,400	300,048.00	0.07
412	002807	江阴银行	79,500	299,715.00	0.07
413	002839	张家港行	74,500	299,490.00	0.07
414	001337	四川黄金	12,900	299,409.00	0.07
415	603308	应流股份	24,100	299,322.00	0.07
416	002051	中工国际	43,000	299,280.00	0.07
417	601528	瑞丰银行	63,300	298,776.00	0.07
418	002550	千红制药	55,400	298,606.00	0.07
419	002556	辉隆股份	71,600	298,572.00	0.07

420	002967	广电计量	25,300	298,540.00	0.07
421	600502	安徽建工	69,400	298,420.00	0.07
422	300323	华灿光电	68,600	298,410.00	0.07
423	002706	良信股份	43,500	298,410.00	0.07
424	600017	日照港	111,764	298,409.88	0.07
425	600888	新疆众和	42,200	298,354.00	0.07
426	003039	顺控发展	23,800	298,214.00	0.07
427	300953	震裕科技	5,500	298,100.00	0.06
428	603212	赛伍技术	27,000	298,080.00	0.06
429	301078	孩子王	58,900	298,034.00	0.06
430	000821	京山轻机	26,300	297,979.00	0.06
431	300634	彩讯股份	17,700	297,891.00	0.06
432	600480	凌云股份	30,300	297,849.00	0.06
433	600787	中储股份	61,900	297,739.00	0.06
434	603013	亚普股份	22,100	297,687.00	0.06
435	002048	宁波华翔	23,000	297,620.00	0.06
436	600366	宁波韵升	57,000	297,540.00	0.06
437	300768	迪普科技	25,100	297,435.00	0.06
438	600011	华能国际	30,900	297,258.00	0.06
439	601860	紫金银行	118,900	297,250.00	0.06
440	002396	星网锐捷	22,500	297,225.00	0.06
441	603128	华贸物流	51,500	297,155.00	0.06
442	002906	华阳集团	11,100	297,036.00	0.06
443	603071	物产环能	23,700	296,961.00	0.06
444	002545	东方铁塔	43,600	296,916.00	0.06
445	300233	金城医药	19,900	296,908.00	0.06
446	000650	仁和药业	50,300	296,770.00	0.06
447	000063	中兴通讯	10,600	296,482.00	0.06
448	603297	永新光学	4,900	296,401.00	0.06
449	601330	绿色动力	50,900	296,238.00	0.06
450	601108	财通证券	44,800	296,128.00	0.06
451	600482	中国动力	15,200	296,096.00	0.06
452	002489	浙江永强	124,900	296,013.00	0.06
453	002158	汉钟精机	17,700	295,944.00	0.06
454	002108	沧州明珠	96,700	295,902.00	0.06
455	000517	荣安地产	110,400	295,872.00	0.06
456	603368	柳药集团	16,900	295,750.00	0.06
457	000025	特力 A	22,000	295,680.00	0.06
458	002283	天润工业	68,900	295,581.00	0.06
459	000915	华特达因	9,800	295,568.00	0.06
460	605020	永和股份	15,400	295,372.00	0.06
461	601600	中国铝业	38,700	295,281.00	0.06
462	002020	京新药业	28,200	295,254.00	0.06

463	000735	罗牛山	68,100	294,873.00	0.06
464	600604	市北高新	85,200	294,792.00	0.06
465	688686	奥普特科技	4,600	294,538.00	0.06
466	000555	神州信息	31,600	294,512.00	0.06
467	688776	国光电气	5,316	294,506.40	0.06
468	300409	道氏技术	34,400	294,464.00	0.06
469	002838	道恩股份	32,500	294,450.00	0.06
470	603713	密尔克卫	5,500	294,360.00	0.06
471	603113	金能科技	53,800	294,286.00	0.06
472	600510	黑牡丹	79,100	294,252.00	0.06
473	300702	天宇股份	16,500	294,195.00	0.06
474	300119	瑞普生物	21,600	294,192.00	0.06
475	301171	易点天下	20,000	294,000.00	0.06
476	300079	数码视讯	72,400	293,944.00	0.06
477	601886	江河集团	60,200	293,776.00	0.06
478	300406	九强生物	19,100	293,758.00	0.06
479	300687	赛意信息	21,100	293,712.00	0.06
480	002320	海峡股份	56,900	293,604.00	0.06
481	600966	博汇纸业	61,400	293,492.00	0.06
482	605376	博迁新材	13,000	293,410.00	0.06
483	600810	神马股份	47,300	293,260.00	0.06
484	601949	中国出版	49,600	293,136.00	0.06
485	600882	妙可蓝多	23,500	293,045.00	0.06
486	300170	汉得信息	47,700	292,878.00	0.06
487	600989	宝丰能源	16,900	292,877.00	0.06
488	601595	上海电影	14,800	292,744.00	0.06
489	688315	诺禾致源科技	26,800	292,656.00	0.06
490	002646	天佑德酒	28,600	292,578.00	0.06
491	600643	爱建集团	77,600	292,552.00	0.06
492	300463	迈克生物	25,700	292,466.00	0.06
493	600037	歌华有线	48,900	292,422.00	0.06
494	600893	航发动力	8,000	292,400.00	0.06
495	603103	横店影视	21,100	292,024.00	0.06
496	300792	壹网壹创	19,400	291,970.00	0.06
497	688383	新益昌科技	5,600	291,816.00	0.06
498	300725	药石科技	10,900	291,793.00	0.06
499	603719	良品铺子	25,000	291,750.00	0.06
500	002768	国恩股份	15,600	291,720.00	0.06
501	002219	新里程	156,800	291,648.00	0.06
502	300377	赢时胜	57,400	291,592.00	0.06
503	002088	鲁阳节能	24,100	291,369.00	0.06
504	000560	我爱我家	131,100	291,042.00	0.06
505	300653	正海生物	14,300	291,005.00	0.06

506	688158	优刻得科技	28,442	290,961.66	0.06
507	688116	天奈科技	12,600	290,808.00	0.06
508	300166	东方国信	47,500	290,700.00	0.06
509	000030	富奥股份	59,100	290,181.00	0.06
510	001311	多利科技	12,000	290,160.00	0.06
511	601009	南京银行	27,900	289,881.00	0.06
512	002068	黑猫股份	40,800	289,680.00	0.06
513	300308	中际旭创	2,100	289,548.00	0.06
514	600905	三峡能源	66,400	289,504.00	0.06
515	600556	天下秀	79,500	289,380.00	0.06
516	300685	艾德生物	16,400	289,296.00	0.06
517	603039	泛微网络	9,100	289,016.00	0.06
518	600362	江西铜业	12,200	288,896.00	0.06
519	605338	巴比食品	21,800	288,850.00	0.06
520	600031	三一重工	17,500	288,750.00	0.06
521	002440	闰土股份	53,100	288,333.00	0.06
522	600266	城建发展	77,000	287,980.00	0.06
523	601186	中国铁建	33,600	287,952.00	0.06
524	688046	药康生物	28,165	287,846.30	0.06
525	002946	新乳业	32,800	287,328.00	0.06
526	600009	上海机场	8,900	287,025.00	0.06
527	603986	兆易创新	3,000	286,860.00	0.06
528	000813	德展健康	137,800	286,624.00	0.06
529	000538	云南白药	5,600	286,440.00	0.06
530	300369	绿盟科技	56,000	286,160.00	0.06
531	300037	新宙邦	10,000	285,600.00	0.06
532	688023	安恒信息	7,133	285,391.33	0.06
533	601607	上海医药	14,800	282,828.00	0.06
534	688351	微创电生理股份	12,806	282,244.24	0.06
535	300124	汇川技术	5,500	282,150.00	0.06
536	605499	东鹏饮料	1,300	280,475.00	0.06
537	300015	爱尔眼科	27,100	279,672.00	0.06
538	300271	华宇软件	59,400	277,992.00	0.06
539	600048	保利发展	31,700	277,692.00	0.06
540	000582	北部湾港	37,300	277,512.00	0.06
541	000598	兴蓉环境	36,900	277,488.00	0.06
542	600486	扬农化工	4,900	276,605.00	0.06
543	603171	税友股份	10,200	275,808.00	0.06
544	300146	汤臣倍健	20,200	273,710.00	0.06
545	603355	莱克电气	12,600	272,160.00	0.06
546	002025	航天电器	5,800	269,004.00	0.06
547	002128	电投能源	12,700	267,970.00	0.06
548	301267	华夏眼科	12,900	267,288.00	0.06

549	600155	华创云信	45,200	267,132.00	0.06
550	600104	上汽集团	19,100	264,726.00	0.06
551	300134	大富科技	38,800	264,616.00	0.06
552	600958	东方证券	34,500	262,200.00	0.06
553	002142	宁波银行	11,800	260,308.00	0.06
554	000636	风华高科	19,900	259,894.00	0.06
555	000729	燕京啤酒	29,400	259,602.00	0.06
556	601665	齐鲁银行	52,400	257,284.00	0.06
557	600348	XD 华阳股份	25,700	255,972.00	0.06
558	000807	云铝股份	18,500	249,935.00	0.05
559	601117	中国化学	30,300	249,672.00	0.05
560	600089	特变电工	17,900	248,273.00	0.05
561	600535	天士力	19,700	247,826.00	0.05
562	000039	中集集团	26,700	247,242.00	0.05
563	600233	圆通速递	15,700	245,705.00	0.05
564	600674	川投能源	13,100	245,625.00	0.05
565	300059	东方财富	23,200	244,992.00	0.05
566	600085	同仁堂	6,400	244,544.00	0.05
567	300413	芒果超媒	11,700	244,530.00	0.05
568	601336	新华保险	8,100	243,243.00	0.05
569	603296	华勤技术	4,400	243,012.00	0.05
570	603259	药明康德	6,200	242,978.00	0.05
571	601021	春秋航空	4,300	242,219.00	0.05
572	300442	润泽科技	10,100	241,895.00	0.05
573	300122	智飞生物	8,600	241,058.00	0.05
574	688271	XD 联影医疗	2,191	240,352.70	0.05
575	000002	万科 A	34,600	239,778.00	0.05
576	002493	荣盛石化	24,800	239,568.00	0.05
577	600737	中粮糖业	24,900	238,791.00	0.05
578	002500	山西证券	50,400	236,880.00	0.05
579	601881	中国银河	21,800	236,748.00	0.05
580	002466	天齐锂业	7,900	236,289.00	0.05
581	002414	高德红外	40,000	235,600.00	0.05
582	300014	亿纬锂能	5,900	235,528.00	0.05
583	603379	三美股份	6,000	234,840.00	0.05
584	300253	卫宁健康	39,800	234,820.00	0.05
585	601611	中国核建	28,900	233,801.00	0.05
586	600073	光明肉业	42,400	233,624.00	0.05
587	601788	光大证券	15,900	232,458.00	0.05
588	603885	吉祥航空	20,800	228,592.00	0.05
589	300296	利亚德	50,400	226,800.00	0.05
590	600390	五矿资本	55,400	224,370.00	0.05
591	300034	钢研高纳	14,000	222,460.00	0.05

592	600428	中远海特	35,700	218,484.00	0.05
593	300303	聚飞光电	44,900	218,214.00	0.05
594	600848	上海临港	23,800	216,818.00	0.05
595	002139	拓邦股份	20,400	216,648.00	0.05
596	603609	禾丰股份	33,000	215,820.00	0.05
597	002531	天顺风能	24,100	215,454.00	0.05
598	300183	东软载波	18,600	215,388.00	0.05
599	688381	帝奥微电子	11,040	215,059.20	0.05
600	605222	起帆电缆	14,000	214,760.00	0.05
601	300332	天壕环境	40,300	213,993.00	0.05
602	603444	吉比特	1,200	213,612.00	0.05
603	600062	华润双鹤	10,900	213,422.00	0.05
604	002154	报喜鸟	39,200	213,248.00	0.05
605	000913	钱江摩托	13,500	212,760.00	0.05
606	002434	万里扬	43,400	212,660.00	0.05
607	301175	中科环保	48,400	212,476.00	0.05
608	000902	新洋丰	17,900	212,473.00	0.05
609	600284	浦东建设	39,700	211,998.00	0.05
610	603915	国茂股份	20,600	211,974.00	0.05
611	600271	航天信息	28,800	211,968.00	0.05
612	300158	振东制药	55,400	211,628.00	0.05
613	000789	万年青	46,400	210,656.00	0.05
614	000550	江铃汽车	9,700	210,587.00	0.05
615	688510	航亚科技	11,432	210,463.12	0.05
616	002649	博彦科技	26,400	210,144.00	0.05
617	603098	森特股份	26,700	209,862.00	0.05
618	002390	信邦制药	63,400	209,854.00	0.05
619	300737	科顺股份	48,800	209,840.00	0.05
620	688220	翱捷科技	5,600	209,776.00	0.05
621	603882	金域医学	7,700	209,363.00	0.05
622	002221	东华能源	25,500	209,355.00	0.05
623	600986	浙文互联	49,800	209,160.00	0.05
624	300916	朗特智能	8,300	208,994.00	0.05
625	688226	威腾电气集团 股份	11,951	208,903.48	0.05
626	002612	朗姿股份	15,100	208,682.00	0.05
627	002950	奥美医疗	31,600	208,560.00	0.05
628	603588	高能环境	33,200	208,496.00	0.05
629	688372	伟测科技	5,293	208,173.69	0.05
630	002467	二六三	62,300	208,082.00	0.05
631	603396	金辰股份	6,400	207,808.00	0.05
632	300379	东方通	25,700	207,656.00	0.05
633	002315	焦点科技	7,700	207,592.00	0.05
634	002216	三全食品	18,900	207,522.00	0.05

635	002127	南极电商	79,800	207,480.00	0.05
636	300173	福能东方	55,000	207,350.00	0.05
637	603919	金徽酒	11,400	207,138.00	0.05
638	688338	赛科希德	9,560	206,974.00	0.05
639	002705	新宝股份	14,700	206,829.00	0.05
640	688733	壹石通	13,800	206,310.00	0.04
641	300545	联得装备	8,400	206,220.00	0.04
642	600316	洪都航空	12,400	206,212.00	0.04
643	002483	润邦股份	45,700	206,107.00	0.04
644	601700	风范股份	46,900	205,891.00	0.04
645	603456	九洲药业	15,000	205,800.00	0.04
646	603618	杭电股份	46,900	205,422.00	0.04
647	002441	众业达	27,100	205,418.00	0.04
648	603727	博迈科	15,600	205,296.00	0.04
649	002519	银河电子	41,800	205,238.00	0.04
650	002286	保龄宝	37,200	204,972.00	0.04
651	603209	兴通股份	14,800	204,832.00	0.04
652	300193	佳士科技	27,600	204,792.00	0.04
653	603309	维力医疗	18,600	204,786.00	0.04
654	002616	长青集团	47,400	204,768.00	0.04
655	301015	百洋医药	8,700	204,711.00	0.04
656	603689	皖天然气	24,900	204,678.00	0.04
657	600297	广汇汽车	296,600	204,654.00	0.04
658	000544	中原环保	26,000	204,620.00	0.04
659	300566	激智科技	14,600	204,254.00	0.04
660	603053	成都燃气	21,100	203,826.00	0.04
661	600262	北方股份	12,400	203,732.00	0.04
662	000551	创元科技	23,300	203,409.00	0.04
663	600558	大西洋	56,500	203,400.00	0.04
664	002282	博深股份	31,800	203,202.00	0.04
665	002140	东华科技	26,200	203,050.00	0.04
666	600738	丽尚国潮	55,300	202,951.00	0.04
667	000554	泰山石油	40,000	202,800.00	0.04
668	002026	山东威达	24,414	202,636.20	0.04
669	002083	孚日股份	47,900	202,617.00	0.04
670	600794	保税科技	63,900	202,563.00	0.04
671	000833	粤桂股份	43,280	202,550.40	0.04
672	002953	日丰股份	25,830	202,507.20	0.04
673	601010	文峰股份	119,100	202,470.00	0.04
674	601956	东贝集团	44,200	202,436.00	0.04
675	603817	海峡环保	42,500	202,300.00	0.04
676	600727	鲁北化工	32,100	202,230.00	0.04
677	603367	辰欣药业	14,500	202,130.00	0.04

678	001205	盛航股份	12,500	202,000.00	0.04
679	605158	华达新材	31,400	201,902.00	0.04
680	603897	长城科技	11,500	201,825.00	0.04
681	002454	松芝股份	36,100	201,799.00	0.04
682	688150	莱特光电股份	10,400	201,760.00	0.04
683	600814	杭州解百	34,177	201,644.30	0.04
684	000530	冰山冷热	55,700	201,634.00	0.04
685	300441	鲍斯股份	34,000	201,620.00	0.04
686	600617	国新能源	80,620	201,550.00	0.04
687	002969	嘉美包装	70,700	201,495.00	0.04
688	600693	东百集团	71,700	201,477.00	0.04
689	603681	永冠新材	15,800	201,450.00	0.04
690	002165	红宝丽	61,000	201,300.00	0.04
691	300160	秀强股份	43,000	201,240.00	0.04
692	002757	南兴股份	16,700	201,235.00	0.04
693	600229	XD 城市传媒	29,200	201,188.00	0.04
694	300993	玉马遮阳	22,500	201,150.00	0.04
695	002412	汉森制药	38,900	201,113.00	0.04
696	002566	益盛药业	32,850	201,042.00	0.04
697	603318	水发燃气	35,500	200,930.00	0.04
698	002093	国脉科技	33,100	200,917.00	0.04
699	002613	北玻股份	57,700	200,796.00	0.04
700	600758	辽宁能源	70,200	200,772.00	0.04
701	300673	佩蒂股份	15,300	200,736.00	0.04
702	300384	三联虹普	15,300	200,736.00	0.04
703	300110	华仁药业	64,940	200,664.60	0.04
704	000926	福星股份	63,300	200,661.00	0.04
705	603158	腾龙股份	28,500	200,640.00	0.04
706	603867	新化股份	8,600	200,638.00	0.04
707	300314	戴维医疗	19,400	200,596.00	0.04
708	601008	连云港	58,300	200,552.00	0.04
709	600897	XD 厦门空港	15,900	200,499.00	0.04
710	600713	南京医药	47,500	200,450.00	0.04
711	600866	星湖科技	36,300	200,376.00	0.04
712	688358	祥生医疗科技	7,710	200,228.70	0.04
713	600512	腾达建设	105,900	200,151.00	0.04
714	000797	中国武夷	85,900	200,147.00	0.04
715	000501	武商集团	30,000	200,100.00	0.04
716	002437	誉衡药业	117,700	200,090.00	0.04
717	002688	金河生物	55,100	200,013.00	0.04
718	002303	美盈森	82,941	199,887.81	0.04
719	688468	科美诊断	31,560	199,774.80	0.04
720	002481	双塔食品	51,600	199,692.00	0.04

721	300439	美康生物	21,800	199,688.00	0.04
722	000788	北大医药	40,000	199,600.00	0.04
723	002790	瑞尔特	22,100	199,563.00	0.04
724	600429	三元股份	53,500	199,555.00	0.04
725	603529	爱玛科技	7,300	199,509.00	0.04
726	002301	齐心集团	41,300	199,479.00	0.04
727	300867	圣元环保	18,800	199,468.00	0.04
728	603579	荣泰健康	12,900	199,434.00	0.04
729	605337	李子园	20,300	199,346.00	0.04
730	603601	再升科技	72,200	199,272.00	0.04
731	002988	豪美新材	12,980	199,243.00	0.04
732	603998	方盛制药	19,400	199,238.00	0.04
733	603590	康辰药业	7,800	199,212.00	0.04
734	600300	维维股份	83,000	199,200.00	0.04
735	600819	耀皮玻璃	47,200	199,184.00	0.04
736	002062	宏润建设	57,200	199,056.00	0.04
737	301296	新巨丰	27,600	198,996.00	0.04
738	688553	汇宇制药	16,020	198,968.40	0.04
739	002344	海宁皮城	65,000	198,900.00	0.04
740	002264	新华都	38,900	198,779.00	0.04
741	002225	濮耐股份	48,600	198,774.00	0.04
742	601113	华鼎股份	60,600	198,768.00	0.04
743	002082	万邦德	47,200	198,712.00	0.04
744	600724	宁波富达	54,700	198,561.00	0.04
745	300815	玉禾田	17,044	198,392.16	0.04
746	600222	太龙药业	47,200	198,240.00	0.04
747	600080	金花股份	33,200	198,204.00	0.04
748	001215	千味央厨	7,000	197,890.00	0.04
749	603096	新经典	11,700	197,730.00	0.04
750	300938	信测标准	9,940	197,607.20	0.04
751	688767	杭州博拓生物 科技	7,872	197,351.04	0.04
752	603387	基蛋生物	25,400	197,104.00	0.04
753	688628	优利德科技	6,009	196,914.93	0.04
754	605108	同庆楼	9,200	196,512.00	0.04
755	300438	鹏辉能源	10,700	196,238.00	0.04
756	603901	永创智能	27,600	195,684.00	0.04
757	600967	内蒙一机	27,000	194,400.00	0.04
758	300005	探路者	38,100	190,881.00	0.04
759	300682	朗新科技	22,400	190,624.00	0.04
760	688425	铁建重工	51,800	190,624.00	0.04
761	000958	电投产融	52,000	190,320.00	0.04
762	300244	迪安诊断	15,800	189,600.00	0.04
763	000156	华数传媒	29,900	187,772.00	0.04

764	002010	传化智联	48,400	185,856.00	0.04
765	600597	光明乳业	23,800	184,926.00	0.04
766	000967	盈峰环境	43,700	184,851.00	0.04
767	603218	日月股份	17,900	183,833.00	0.04
768	603026	石大胜华	5,400	182,520.00	0.04
769	600095	湘财股份	29,900	178,204.00	0.04
770	002761	浙江建投	21,900	171,039.00	0.04
771	002925	盈趣科技	13,400	169,778.00	0.04
772	300257	开山股份	16,800	169,680.00	0.04
773	688276	长春百克生物 科技	5,953	168,886.61	0.04
774	002983	芯瑞达	10,100	168,165.00	0.04
775	000419	通程控股	40,700	166,463.00	0.04
776	688690	纳微科技	9,568	166,196.16	0.04
777	300861	美畅股份	8,500	164,475.00	0.04
778	300790	宇瞳光学	12,100	163,350.00	0.04
779	603408	建霖家居	12,000	158,280.00	0.03
780	600851	海欣股份	34,400	157,208.00	0.03
781	300498	温氏股份	7,900	156,578.00	0.03
782	000031	大悦城	66,900	156,546.00	0.03
783	688153	唯捷创芯	4,200	155,400.00	0.03
784	300896	爱美客	900	154,890.00	0.03
785	300592	华凯易佰	13,500	154,305.00	0.03
786	000768	中航西飞	6,400	153,792.00	0.03
787	002841	视源股份	5,200	153,556.00	0.03
788	688348	昱能科技	2,600	153,400.00	0.03
789	002945	华林证券	15,300	152,694.00	0.03
790	603369	今世缘	3,300	152,460.00	0.03
791	600489	XD 中金黄金	10,300	152,440.00	0.03
792	600026	中远海能	9,700	151,417.00	0.03
793	002252	上海莱士	19,200	150,144.00	0.03
794	000938	紫光股份	6,700	149,745.00	0.03
795	600584	长电科技	4,700	149,037.00	0.03
796	600029	南方航空	25,300	149,017.00	0.03
797	600295	鄂尔多斯	15,000	148,800.00	0.03
798	605319	无锡振华	8,400	148,680.00	0.03
799	000877	天山股份	27,500	148,500.00	0.03
800	002180	纳思达	5,600	147,952.00	0.03
801	300782	卓胜微	1,900	147,706.00	0.03
802	300573	兴齐眼药	900	147,600.00	0.03
803	002603	以岭药业	9,600	147,168.00	0.03
804	600150	中国船舶	3,600	146,556.00	0.03
805	601360	三六零	19,000	145,920.00	0.03
806	601236	红塔证券	22,700	145,734.00	0.03

807	002271	东方雨虹	11,800	145,612.00	0.03
808	002007	华兰生物	9,200	145,268.00	0.03
809	000553	安道麦 A	31,900	144,826.00	0.03
810	600754	锦江酒店	6,300	144,774.00	0.03
811	601155	新城控股	16,300	144,581.00	0.03
812	300751	迈为股份	1,200	143,376.00	0.03
813	688065	凯赛生物	3,152	143,069.28	0.03
814	601616	广电电气	49,100	142,881.00	0.03
815	600237	铜峰电子	27,300	142,506.00	0.03
816	603993	洛阳钼业	16,700	141,950.00	0.03
817	300945	曼卡龙	15,700	139,887.00	0.03
818	688663	新风光科技	6,000	139,620.00	0.03
819	002381	双箭股份	20,800	139,568.00	0.03
820	002972	科安达	15,200	139,232.00	0.03
821	002352	顺丰控股	3,900	139,191.00	0.03
822	002580	圣阳股份	22,600	138,990.00	0.03
823	600019	宝钢股份	20,900	138,985.00	0.03
824	603809	豪能股份	17,196	138,943.68	0.03
825	300707	威唐工业	11,200	138,656.00	0.03
826	688737	中自科技	8,545	138,429.00	0.03
827	603121	华培动力	19,400	138,128.00	0.03
828	600829	人民同泰	24,600	138,006.00	0.03
829	605060	联德股份	9,600	137,952.00	0.03
830	301266	宇邦新材	4,500	137,880.00	0.03
831	301028	东亚机械	15,700	137,689.00	0.03
832	603788	宁波高发	11,200	137,536.00	0.03
833	002565	顺灏股份	57,500	137,425.00	0.03
834	603811	诚意药业	21,960	137,250.00	0.03
835	002284	亚太股份	20,300	137,228.00	0.03
836	000153	丰原药业	25,500	137,190.00	0.03
837	002029	七匹狼	27,211	137,143.44	0.03
838	688398	赛特新材	7,800	137,124.00	0.03
839	600513	联环药业	16,900	137,059.00	0.03
840	603101	汇嘉时代	27,800	137,054.00	0.03
841	001228	永泰运	6,500	137,020.00	0.03
842	600887	伊利股份	5,300	136,952.00	0.03
843	601818	光大银行	43,200	136,944.00	0.03
844	600215	派斯林	19,200	136,896.00	0.03
845	002852	道道全	19,000	136,800.00	0.03
846	002661	克明食品	18,300	136,701.00	0.03
847	001217	华尔泰	14,900	136,335.00	0.03
848	002968	新大正	15,300	136,323.00	0.03
849	605080	浙江自然	8,600	136,052.00	0.03

850	600173	卧龙地产	36,300	135,762.00	0.03
851	603697	有友食品	23,400	135,720.00	0.03
852	000558	莱茵体育	63,400	135,676.00	0.03
853	600292	远达环保	28,900	135,541.00	0.03
854	603808	歌力思	21,400	135,462.00	0.03
855	600658	电子城	41,100	135,219.00	0.03
856	688357	建龙微纳	5,800	135,140.00	0.03
857	603777	来伊份	14,400	134,928.00	0.03
858	300453	三鑫医疗	21,100	134,829.00	0.03
859	300999	金龙鱼	4,900	134,015.00	0.03
860	688533	上声电子股份	5,177	133,928.99	0.03
861	002291	遥望科技	30,300	130,290.00	0.03
862	600552	凯盛科技	13,700	129,191.00	0.03
863	002929	润建股份	4,400	128,084.00	0.03
864	002302	西部建设	24,400	126,880.00	0.03
865	600872	中炬高新	5,500	124,795.00	0.03
866	600906	财达证券	21,000	120,330.00	0.03
867	001289	龙源电力	5,600	96,600.00	0.02
868	000415	渤海租赁	35,400	90,270.00	0.02
869	688167	西安炬光科技	1,600	88,000.00	0.02
870	002436	兴森科技	8,500	87,720.00	0.02
871	300065	海兰信	13,200	87,252.00	0.02
872	600126	杭钢股份	21,100	86,721.00	0.02
873	600776	东方通信	8,800	86,504.00	0.02
874	000528	柳工	7,700	86,163.00	0.02
875	000761	本钢板材	34,100	85,591.00	0.02
876	688183	生益电子	4,400	85,272.00	0.02
877	002990	盛视科技	4,200	84,546.00	0.02
878	002201	正威新材	17,500	82,775.00	0.02
879	688678	福立旺精密	7,600	82,308.00	0.02
880	688680	海优新材	2,777	79,810.98	0.02
881	688076	诺泰生物	1,000	78,280.00	0.02
882	603799	华友钴业	3,400	75,242.00	0.02
883	600685	中船防务	2,400	66,960.00	0.01
884	002648	卫星化学	3,700	66,526.00	0.01
885	600875	东方电气	3,600	66,420.00	0.01
886	600027	华电国际	9,500	65,930.00	0.01
887	603979	金诚信	1,300	65,689.00	0.01
888	000977	浪潮信息	1,800	65,466.00	0.01
889	600018	上港集团	11,300	65,314.00	0.01
890	002937	兴瑞科技	2,800	65,268.00	0.01
891	000338	潍柴动力	4,000	64,960.00	0.01
892	600795	国电电力	10,800	64,692.00	0.01

893	002179	中航光电	1,700	64,685.00	0.01
894	000425	徐工机械	9,000	64,350.00	0.01
895	000612	焦作万方	9,900	64,350.00	0.01
896	002540	亚太科技	12,100	64,009.00	0.01
897	600919	江苏银行	8,600	63,898.00	0.01
898	600741	华域汽车	3,900	63,882.00	0.01
899	600694	大商股份	3,800	63,878.00	0.01
900	300433	蓝思科技	3,500	63,875.00	0.01
901	600886	国投电力	3,500	63,840.00	0.01
902	601006	大秦铁路	8,900	63,724.00	0.01
903	601089	福元医药	4,600	63,710.00	0.01
904	002027	分众传媒	10,500	63,630.00	0.01
905	002938	鹏鼎控股	1,600	63,616.00	0.01
906	002916	深南电路	600	63,462.00	0.01
907	601699	潞安环能	3,500	63,455.00	0.01
908	301160	翔楼新材	1,700	63,325.00	0.01
909	000596	古井贡酒	300	63,321.00	0.01
910	601878	浙商证券	5,900	63,248.00	0.01
911	002478	常宝股份	12,700	63,246.00	0.01
912	601377	兴业证券	12,300	62,238.00	0.01
913	600436	片仔癀	300	62,151.00	0.01
914	000776	广发证券	5,100	62,067.00	0.01
915	000166	申万宏源	14,400	62,064.00	0.01
916	300274	阳光电源	1,000	62,030.00	0.01
917	300919	中伟股份	2,000	61,980.00	0.01
918	605007	五洲特纸	4,900	61,887.00	0.01
919	603195	公牛集团	800	61,696.00	0.01
920	000921	海信家电	1,900	61,256.00	0.01
921	688036	传音控股	800	61,232.00	0.01
922	600438	通威股份	3,200	61,152.00	0.01
923	688599	天合光能	3,613	61,131.96	0.01
924	300223	北京君正	1,100	60,984.00	0.01
925	688766	普冉半导体	600	58,302.00	0.01
926	002544	普天科技	3,000	56,070.00	0.01
927	002980	华盛昌	2,000	43,780.00	0.01
928	600218	全柴动力	6,400	42,944.00	0.01
929	603648	畅联股份	5,400	42,768.00	0.01
930	688028	沃尔德金刚石	2,600	42,718.00	0.01
931	300154	瑞凌股份	8,000	42,640.00	0.01
932	002442	龙星化工	9,900	42,570.00	0.01
933	603706	东方环宇	2,900	42,485.00	0.01
934	001207	联科科技	2,900	42,108.00	0.01
935	603399	吉翔股份	6,800	42,092.00	0.01

936	300247	融捷健康	17,300	42,039.00	0.01
937	605389	长龄液压	2,000	41,980.00	0.01
938	688136	科兴生物制药	2,498	41,866.48	0.01
939	301290	东星医疗	2,100	41,811.00	0.01
940	002551	尚荣医疗	17,800	41,474.00	0.01
941	000404	长虹华意	6,700	35,711.00	0.01
942	000988	华工科技	272	8,140.96	0.00
943	002956	西麦食品	400	5,496.00	0.00
944	603116	红蜻蜓	800	3,600.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	20,001,016.90	3.44
2	002463	沪电股份	19,271,639.00	3.31
3	000975	银泰黄金	16,619,376.00	2.86
4	002156	通富微电	14,260,753.92	2.45
5	002517	恺英网络	13,739,638.00	2.36
6	002078	太阳纸业	13,230,992.00	2.27
7	601077	渝农商行	13,218,789.00	2.27
8	600161	天坛生物	13,107,094.00	2.25
9	002966	苏州银行	12,940,066.40	2.22
10	002422	科伦药业	12,684,996.35	2.18
11	688188	上海柏楚电子科技	12,432,067.14	2.14
12	601555	东吴证券	11,920,464.91	2.05
13	002384	东山精密	11,911,055.00	2.05
14	601058	赛轮轮胎	11,864,348.37	2.04
15	600699	均胜电子	11,863,436.00	2.04
16	601966	玲珑轮胎	11,753,499.00	2.02
17	000423	东阿阿胶	11,188,776.00	1.92
18	300394	天孚通信	11,168,671.00	1.92
19	603816	顾家家居	11,136,032.00	1.91
20	600079	人福医药	11,092,825.45	1.91

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	17,371,552.00	2.99
2	002463	沪电股份	17,193,312.50	2.96
3	002517	恺英网络	14,116,591.00	2.43

4	000975	银泰黄金	13,555,282.00	2.33
5	002384	东山精密	12,736,760.00	2.19
6	300394	天孚通信	12,681,438.00	2.18
7	002156	通富微电	12,100,995.22	2.08
8	601077	渝农商行	11,740,369.00	2.02
9	002422	科伦药业	11,430,293.58	1.97
10	600161	天坛生物	11,296,790.00	1.94
11	600699	均胜电子	11,258,454.00	1.94
12	601058	赛轮轮胎	11,248,886.32	1.93
13	002078	太阳纸业	11,204,571.00	1.93
14	688188	上海柏楚电 子科技	10,803,911.29	1.86
15	300001	特锐德	10,780,106.78	1.85
16	601966	玲珑轮胎	10,722,724.00	1.84
17	002138	顺络电子	10,485,117.60	1.80
18	002966	苏州银行	10,449,380.30	1.80
19	601555	东吴证券	10,428,966.00	1.79
20	600109	国金证券	10,286,552.00	1.77

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,852,703,180.30
卖出股票收入（成交）总额	5,916,246,918.10

注：卖出股票收入（成交）总额中扣除了增值税的影响。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

无。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

7.12.3 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	1,811,043.54
2	应收清算款	3,396,207.55
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,396.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	5,210,647.69

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
国海量化 优选一年 持有股票 A	126	162,411.17	3,987,792.94	19.49	16,476,013.99	80.51
国海量化 优选一年 持有股票 C	7,690	37,215.19	18,912,839.72	6.61	267,271,990.88	93.39
合计	7,816	39,233.45	22,900,632.66	7.47	283,748,004.87	92.53

8.2 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	国海量化优选一年持有股票 A	500,196.12	2.44
	国海量化优选一年持有股票 C	4,276,490.07	1.49
	合计	4,776,686.19	1.56

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	国海量化优选一年持有股 票 A	-
	国海量化优选一年持有股 票 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有 本开放式基金	国海量化优选一年持有股 票 A	-
	国海量化优选一年持有股 票 C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日 (2021年8月23)	61,870,332.78	-

日) 基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	22,681,249.41	319,286,402.76
本报告期基金总申购份额	-	2,863,807.27
减: 本报告期基金总赎回份额	2,217,442.48	35,965,379.43
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	20,463,806.93	286,184,830.60

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内, 本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2024 年 2 月 1 日, 公司召开第十届董事会第一次会议, 聘任度万中先生为公司总裁, 度万中先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行总裁职责; 聘任汪成接先生为公司副总裁, 汪成接先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行副总裁职责; 聘任张宁先生为公司首席信息官, 张宁先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行首席信息官职责; 因任期届满, 蒋健先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司副总裁, 温力先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司首席信息官。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内, 无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-

受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

注：本报告期内，基金管理人或其高级管理人员未因资产管理业务相关行为受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

注：本报告期内，基金托管人或其专门基金托管部门负责人未因基金托管业务相关行为受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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 (%)	
国海证券	2	11,768,950,098.40	100.00	4,070,846.69	100.00	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国海证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024年1月3日
2	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024年1月22日
3	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2024年1月22日
4	国海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024年2月6日
5	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024年2月7日
6	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024年3月29日
7	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2023 年年度管理报告	中国证监会规定网站	2024年3月29日
8	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2024 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024年4月22日
9	国海证券量化优选一年持有期股票	中国证监会规定网站	2024年4月22日

	型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告		
10	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 5 月 15 日
11	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划（国海量化优选一年持有股票 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2024 年 6 月 28 日
12	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划（国海量化优选一年持有股票 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2024 年 6 月 28 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划托管协议；
- 4、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；

7、报告期内披露的各项公告。

12.2 存放地点

上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层。

12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

国海证券股份有限公司

2024 年 8 月 30 日