

国海证券量化优选一年持有期股票型集合 资产管理计划 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 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：2023 年 3 月 31 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 2022 年 3 月 30 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 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	24

§ 8 投资组合报告	70
8.1 期末基金资产组合情况	70
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	71
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	71
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	126
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	128
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	128
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	128
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	128
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	129
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	129
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	129
8.12 投资组合报告附注	129
§ 9 基金份额持有人信息	130
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	130
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	130
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	131
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	131
§ 10 开放式基金份额变动	131
§ 11 重大事件揭示	132
11.1 基金份额持有人大会决议	132
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	132
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	132
11.4 基金投资策略的改变	132
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	132
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	132
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	133
11.8 其他重大事件	134
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	137
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	137
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	137
§ 13 备查文件目录	137
13.1 备查文件目录	137
13.2 存放地点	138
13.3 查阅方式	138

§ 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	441,600,125.09 份	
基金合同存续期	不定期	
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	29,481,316.46 份	412,118,808.63 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	余宏伟
	联系电话	010-88576333	021-68089632
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn	yuhongwei@sh.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	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号 25 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年		2021 年 8 月 23 日 (基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 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	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	-2,225,863.44	-11,836,450.20	-611,153.90	-8,531,118.53
本期利润	-2,529,138.73	-26,558,357.14	2,548,564.14	-12,143,449.72
加权平均基金份额本期利润	-0.0608	-0.0627	0.0470	-0.0341
本期加权平均净值利润率	-3.57%	-3.68%	2.71%	-1.97%

本期基金份额净值增长率	-3.89%	-3.94%	3.06%	2.98%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	18,296,444.25	254,834,681.51	33,434,511.85	256,131,381.05
期末可供分配基金份额利润	0.6206	0.6184	0.6519	0.6507
期末基金资产净值	49,530,594.81	691,495,450.37	89,653,803.38	687,620,087.45
期末基金份额净值	1.6801	1.6779	1.7481	1.7468
3.1.3 累计期末指标	2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	-0.95%	-1.08%	3.06%	2.98%

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（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海量化优选一年持有股票 A

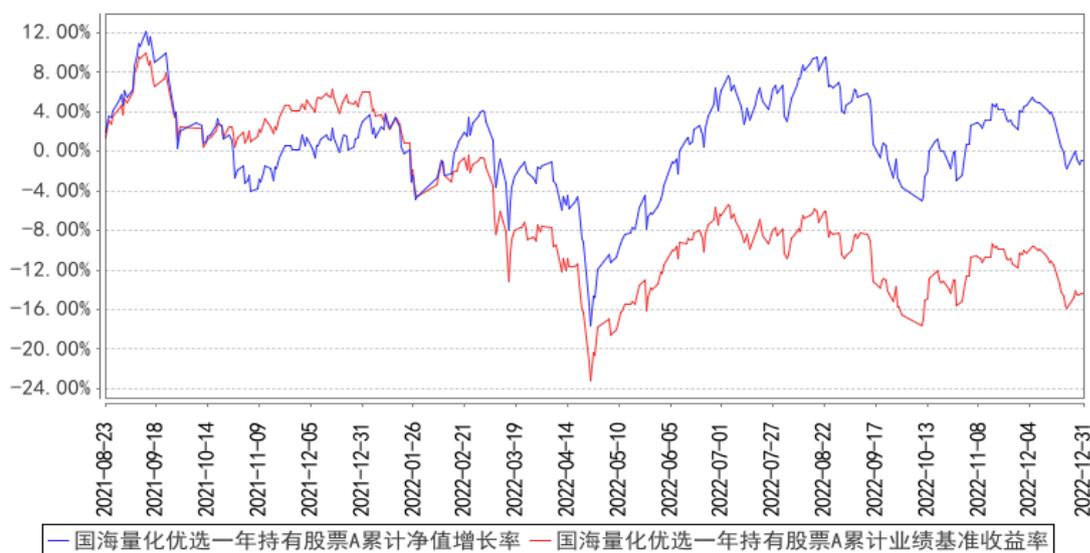
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.75%	0.99%	2.52%	0.97%	0.23%	0.02%
过去六个月	-6.09%	1.06%	-8.66%	1.04%	2.57%	0.02%
过去一年	-3.89%	1.34%	-19.30%	1.31%	15.41%	0.03%
自基金合同生效起至今	-0.95%	1.28%	-14.42%	1.21%	13.47%	0.07%

国海量化优选一年持有股票 C

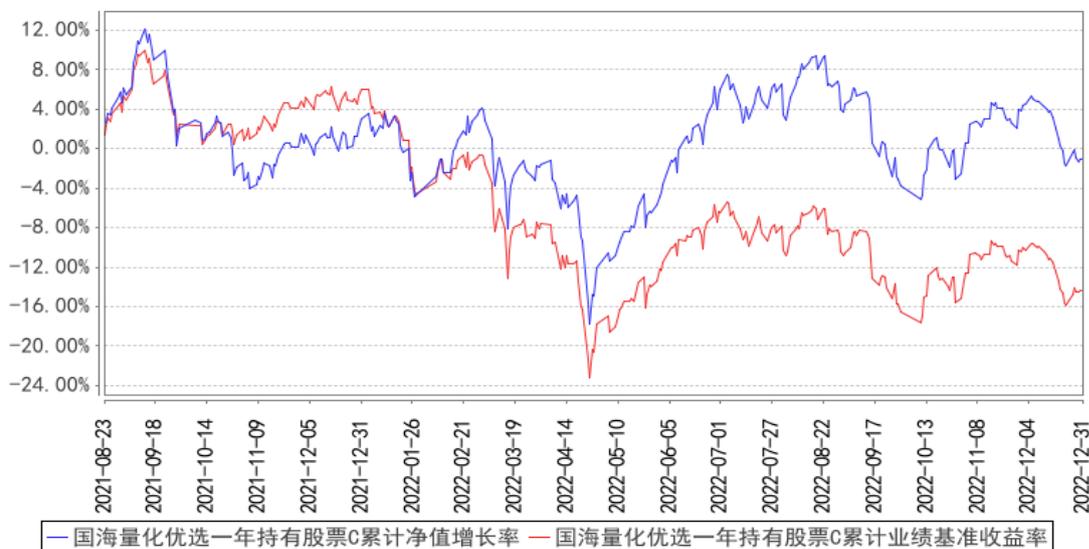
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.75%	0.98%	2.52%	0.97%	0.23%	0.01%
过去六个月	-6.09%	1.06%	-8.66%	1.04%	2.57%	0.02%
过去一年	-3.94%	1.34%	-19.30%	1.31%	15.36%	0.03%
自基金合同生效之日起至今	-1.08%	1.28%	-14.42%	1.21%	13.34%	0.07%

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

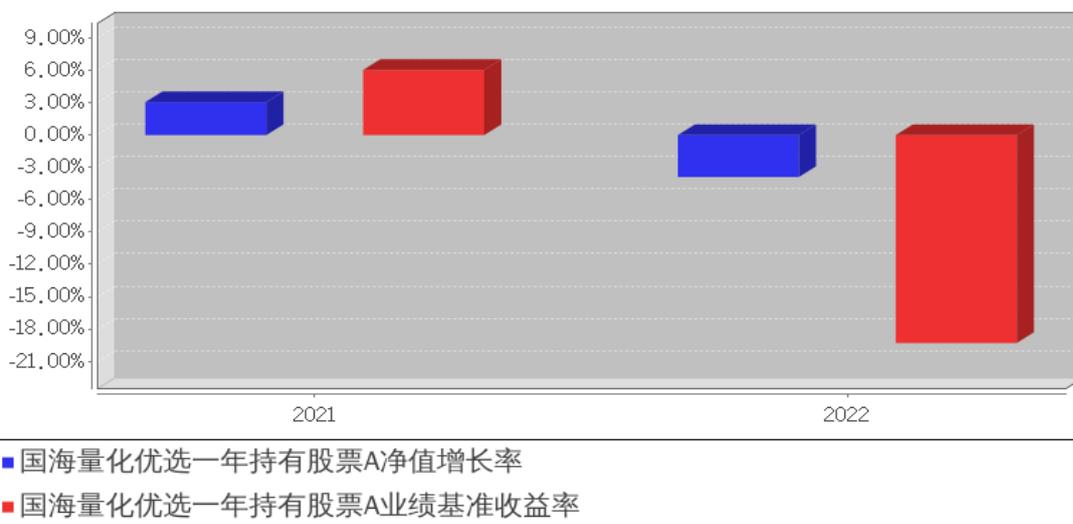


国海量化优选一年持有股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

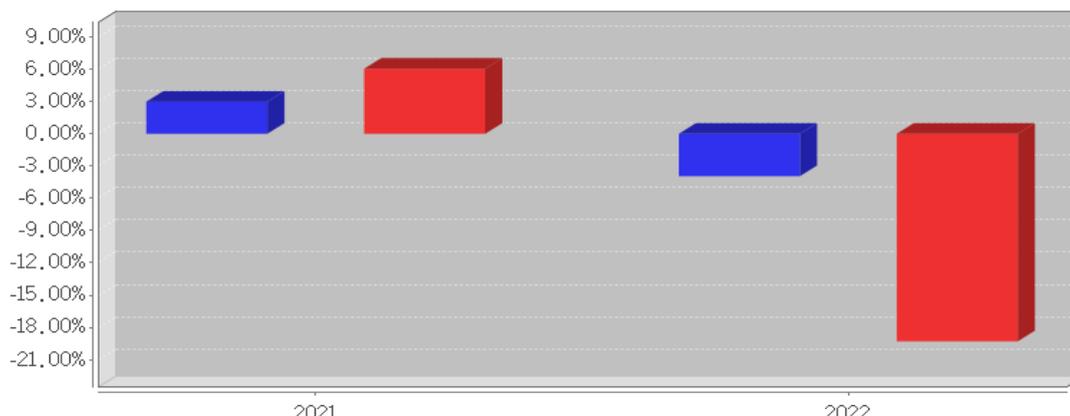


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海量化优选一年持有股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国海量化优选一年持有股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



■ 国海量化优选一年持有股票C净值增长率
 ■ 国海量化优选一年持有股票C业绩基准收益率

3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2022年1月1日至2022年12月31日）
-	-
其他指标	报告期末（2022年12月31日）
-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

国海量化优选一年持有股票 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：报告期间无利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 2022 年 12 月末，公司在全国 21 个省级区域设有 27 家分公司、99 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 7 月 22 日	-	5	石雨萌先生，墨尔本大学信息技术硕士，5 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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理，薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或与产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国海证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，对公平交易的过程和结果进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 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

市场方面，A 股市场在 2022 年整体波动加剧，市场结构分化明显。年初市场在疫情反复、俄乌冲突、美联储加息等多重冲击下大幅下行，成长板块估值受到打压。同时，国内地产行业在与科技、高端制造等新兴产业新旧动能交替之际，在资金与需求层面面临的政策与市场压力在 2022 年中集中爆发，一定程度打击了内需。而 2022 年下半年以来，伴随着国内防疫政策优化，以及国内稳增长、托底地产、互联网平台等政策的逐渐发力，企业及居民的信心逐渐修复，国内经济在年末进入弱复苏的趋势。

而放眼世界，全球经济呈现供需矛盾，衰退信号渐强的局面。2022 年，美联储为抑制前期货币超发引发的通胀，连续 7 次加息，共计 425 个基点，截止 2022 年底来到 4.25%-4.50% 区间。2022 年四季度，美国通胀指标下行，同时经济增长放缓，迫使联储放缓加息节奏，同时减弱进一步加息的预期，一定程度上缓和了全球市场的悲观情绪。

投资策略上，本计划的业绩比较基准为 95%*中证 500 指数收益率+5%*活期存款利息，在 2022 年我们始终保持以高仓位运作，在跟踪业绩比较基准的基础上，采用多因子量化选股策略力求超越基准指数的表现。2022 年量化策略整体表现良好，下半年由于市场风格变动频繁，成交活跃度、截面波动率下行，量化选股因子业绩呈现波动。我们采用的量化模型基于长期历史数据回测，经历长期市场验证。我们也将坚持对量化策略的迭代开发，为投资者争取更加稳健的业绩表现。

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 1.6801 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为 -3.89%；C 类份额基金份额净值为 1.6779 元，本报告期份额净值增长率为 -3.94%，同期业绩比较基准收益率为 -19.30%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政策方面，2022 年末政治局会议定调“稳增长、稳就业、稳物价”，预期 2023 年财政政策、货币政策将加力提效，以更加精准高效的方式实现稳增长的政策目标。

市场流动性方面，国内货币政策预期维持宽松，美联储加息预期节奏逐步放缓，全球权益市场风险偏好趋于稳定，海外资金有望回流。同时，随着国内个人养老金入市等政策相继出台，A

股有望吸引长期资金入市，推动资本市场长期健康运行。

在投资策略方面，当前中证 500 指数估值仍处于历史较低分位点，同时科技、高端制造等新兴产业仍然是经济增长的长期动力，当前时点的投资中证 500 指数安全性较强、长期配置性价比高。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，管理人内部监察稽核主要开展了如下措施：

依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章对产品的投资、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时反馈，督促改进并跟踪改进效果，进一步完善公司内部控制管理机制。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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，本托管人在托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产

管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本托管人依法对国海证券股份有限公司编制和披露的国海量化优选股票一年持有期集合资产管理计划 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2023)第 2536 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划全体份额持有人
审计意见	我们审计了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“国海量化优选一年持有期股票型集合计划”)财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表、净资产(集合计划净值)变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附国海量化优选一年持有期股票型集合计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了国海量化优选一年持有期股票型集合计划 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国海量化优选一年持有期股票型集合计划,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我

	们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系国海量化优选一年持有期股票型集合计划管理人（以下简称“管理人”）根据《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》的规定为其集合计划份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供国海量化优选一年持有期股票型集合计划份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括国海量化优选一年持有期股票型集合计划 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估国海量化优选一年持有期股票型集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉</p>

	<p>及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>3、评价管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>4、对管理人使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国海量化优选一年持有期股票型集合计划持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国海量化优选一年持有期股票型集合计划不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人就国海量化优选一年持有期股票型集合计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	上会会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈大愚 江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号 25 层
审计报告日期	2023 年 03 月 24 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	55,699,125.18	43,901,358.66
结算备付金		10,890,187.67	8,128,894.83
存出保证金		2,100,750.78	2,040,712.23
交易性金融资产	7.4.7.2	672,548,444.77	723,968,928.64
其中：股票投资		672,548,444.77	723,968,928.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		6,657,888.61	4,598,068.72
应收股利		-	-
应收申购款		169,497.50	84,864.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	9,144.81
资产总计		748,065,894.51	782,731,972.06
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,297,688.84	4,173,944.08
应付赎回款		201,987.08	-
应付管理人报酬		662,481.16	646,344.24
应付托管费		66,248.10	64,634.43
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	7.4.7.9	811,444.15	573,158.48
负债合计		7,039,849.33	5,458,081.23
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	441,600,125.09	444,924,658.68
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	299,425,920.09	332,349,232.15
净资产合计		741,026,045.18	777,273,890.83
负债和净资产总计		748,065,894.51	782,731,972.06

注：1) 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 441,600,125.09 份，资产总净值（暂估业绩报酬前）741,026,045.18 元。其中 A 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.6801 元，集

合计划份额总额 29,481,316.46 份，资产净值（暂估业绩报酬前）49,530,594.81 元，相关暂估业绩报酬余额 666,583.88 元，资产净值（暂估业绩报酬后）48,864,010.93 元；C 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.6779 元，集合计划份额总额 412,118,808.63 份，资产净值（暂估业绩报酬前）691,495,450.37 元，相关暂估业绩报酬 52,621.27 元，资产净值（暂估业绩报酬后）691,442,829.10 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) “其他负债”科目的上年年末余额中包含 2021 年年度审计报告资产负债表中“应付交易费用”与“其他负债”科目余额。

7.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 8 月 23 日（基金 合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-19,414,951.76	-799,037.53
1. 利息收入		471,815.33	117,469.53
其中：存款利息收入	7.4.7.13	388,315.11	99,974.79
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		83,500.22	17,494.74
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,911,127.09	-528,392.04
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-10,350,508.48	-1,187,754.88
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-4,241,699.78	-
股利收益	7.4.7.19	9,681,081.17	659,362.84
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-15,025,182.23	-452,613.15
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	49,542.23	64,498.13
减：二、营业总支出		9,672,544.11	8,795,848.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,574,825.80	2,581,215.00
2. 托管费	7.4.10.2.2	790,254.42	258,121.50
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		143,403.13	88,677.47
8. 其他费用	7.4.7.23	164,060.76	5,867,834.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-29,087,495.87	-9,594,885.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-29,087,495.87	-9,594,885.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-29,087,495.87	-9,594,885.58

注：“其他费用”科目上年度可比期间发生额中包含“交易费用”与“其他费用”科目金额。

7.3 净资产（基金净值）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：2022年1月1日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	444,924,658.68	-	332,349,232.15	777,273,890.83

资产(基金净值)				
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末期初净资产(基金净值)	444,924,658.68	-	332,349,232.15	777,273,890.83
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,324,533.59	-	-32,923,312.06	-36,247,845.65
(一)、综合收益总额	-	-	-29,087,495.87	-29,087,495.87
(二)、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)	-3,324,533.59	-	-3,835,816.19	-7,160,349.78
其中:1.基金申购款	111,775,143.79	-	83,367,082.28	195,142,226.07
2.基金赎回款	-115,099,677.38	-	-87,202,898.47	-202,302,575.85
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18
项目	上年度可比期间			
	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	61,870,332.78	-	43,074,399.57	104,944,732.35
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	61,870,332.78	-	43,074,399.57	104,944,732.35
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	383,054,325.90	-	289,274,832.58	672,329,158.48
(一)、综合收益总额	-	-	-9,594,885.58	-9,594,885.58
(二)、本期基	383,054,325.90	-	298,869,718.16	681,924,044.06

基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）				
其中：1. 基金申购款	393,637,735.03	-	306,125,802.14	699,763,537.17
2. 基金赎回款	-10,583,409.13	-	-7,256,083.98	-17,839,493.11
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产（基金净值）	444,924,658.68	-	332,349,232.15	777,273,890.83

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(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。

7.4.3 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

除下述变更后的会计政策外，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。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本集合计划根据所管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为以下三类：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本计划根据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债、被指定为有效套期工具的衍生工具。

金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，相关的交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融资产的初始确认与后续计量

① 分类为以摊余成本计量的金融资产

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本集合计划将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。

本集合计划对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入，按摊余成本进行后续计量，其发生减值时或终止确认、修改产生的利得或损失，计入当期损益。除下列情况外，本集合计划根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入：

1) 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，本集合计划自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入。

2) 对于购入或源生的未发生信用减值但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，本集合计划在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，本集合计划转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

② 分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标，则本集合计划将该金融资产分类为以公允价值计量其变动计入其他综合收益的金融资产。

本集合计划对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入。除利息收入、减值损失及汇兑差额确认为当期损益外，其余公允价值变动计入其他综合收益。当该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

以公允价值计量且变动计入其他综合收益的应收票据及应收账款列报为应收款项融资，其他此类金融资产列报为其他债权投资，其中：自资产负债表日起一年内到期的其他债权投资列报为一年内到期的非流动资产，原到期日在一年以内的其他债权投资列报为其他流动资产。

③ 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

在初始确认时，本集合计划可以单项金融资产为基础不可撤销地将非交易性权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

此类金融资产的公允价值变动计入其他综合收益，不需计提减值准备。该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。本集合计划持有该权益工具投资期间，在本集合计划收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很

可能流入本集合计划，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。本集合计划对此类金融资产在其他权益工具投资项目下列报。

权益工具投资满足下列条件之一的,属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：取得该金融资产的目的主要是为了近期出售；初始确认时属于集中管理的可辨认金融资产工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式；属于衍生工具（符合财务担保合同定义的以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外）。

④ 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

不符合分类为以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件、亦不指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产均分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本集合计划对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

本集合计划对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产其他非流动金融资产项目列报。

⑤ 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

在初始确认时，本集合计划为了消除或显著减少会计错配，可以单项金融资产为基础不可撤销地将金融资产指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

混合合同包含一项或多项嵌入衍生工具，且其主合同不属于以上金融资产的，本集合计划可以将其整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。但下列情况除外：

1) 嵌入衍生工具不会对混合合同的现金流量产生重大改变。

2) 在初次确定类似的混合合同是否需要分拆时，几乎不需分析就能明确其包含的嵌入衍生工具不应分拆。如嵌入贷款的提前还款权，允许持有人以接近摊余成本的金额提前偿还贷款，该提前还款权不需要分拆。

本集合计划对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

本集合计划对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产、其他非流动金融资产项目列报。

(2) 金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融负债的后续计量取决于其分类：

① 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

满足下列条件之一的，属于交易性金融负债：承担相关金融负债的目的主要是为了在近期内

出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、符合财务担保合同的衍生工具除外。交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，所有公允价值变动均计入当期损益。

在初始确认时，为了提供更相关的会计信息，本集合计划将满足下列条件之一的金融负债不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：

1) 能够消除或显著减少会计错配。

2) 根据正式书面文件载明的企险风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在本集合计划内部以此为基础向关键管理人员报告。

本集合计划对此类金融负债采用公允价值进行后续计量除由本集合计划自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益之外，其他公允价值变动计入当期损益。除非由本集合计划自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益会造成或扩大损益中的会计错配，本集合计划将所有公允价值变动（包括自身信用风险变动的影响金额）计入当期损益。

② 其他金融负债

除下列各项外，本集合计划将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，对此类金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益：

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债。

3) 不属于本条前两类情形的财务担保合同，以及不属于本条第 1) 类情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。

财务担保合同是指当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求发行方向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，在初始确认后按照损失准备金额以及初始确认金额扣除担保期内的累计摊销额后的余额孰高进行计量。

(3) 金融资产和金融负债的终止确认

① 金融资产满足下列条件之一的，终止确认金融资产，即从其账户和资产负债表内予以转销：

1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止。

2) 该金融资产已转移，且该转移满足金融资产终止确认的规定。

② 金融负债终止确认条件

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，则终止确认该金融负债（或该部分金融负

债)。

本计划与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，或对原金融负债（或其一部分）的合同条款做出实质性修改的，则终止确认原金融负债，同时确认一项新金融负债，账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，计入当期损益。

本计划回购金融负债一部分的，按照继续确认部分和终止确认部分在回购日各自的公允价值占整体公允价值的比例，对该金融负债整体的账面价值进行分配。分配给终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，应当计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本集合计划持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收资金为对外发行的集合计划份额总额或对应的金额。每份集合计划份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收资金的变动分别于集合计划申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收资金增加和转出集合计划的实收资金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于本集合计划申购确认日或计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

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

(7) 转融通证券出借业务中，计划保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能

按期归还产生的罚息扣除在适用情况下由计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本集合计划的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期计划费用。如果影响计划份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交

易不活跃)等情况,本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本集合计划持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、可分离债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本集合计划持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《资产管理产品相关会计处理规定》资产管理产品自2022年1月1日起首次执行《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量(2017年修订)》(财会(2017)7号)、《企业会计准则第23号——金融资产转移(2017年修订)》(财会(2017)8号)、《企业会计准则第24号——套期会计(2017年修订)》(财会(2017)9号)和《企业会计准则第37号——金融工具列报(2017年修订)》(财会(2017)14号)(上述准则统称“新金融工具准则”),应当遵循上述准则的衔接规定。

在新金融工具准则下所有已确认金融资产,其后续均按摊余成本或公允价值计量。资产管理产品应当根据其管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

在新金融工具准则下,对以摊余成本计量的金融资产和分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产,以预期信用损失为基础进行减值会计处理并确认损失准备。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	55,699,125.18	43,901,358.66
等于：本金	55,693,994.55	43,901,358.66
加：应计利息	5,130.63	-
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	55,699,125.18	43,901,358.66

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	685,674,350.63	-	672,548,444.77	-13,125,905.86
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	685,674,350.63	-	672,548,444.77	-13,125,905.86
项目	上年度末			
	2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	722,903,052.27	-	723,968,928.64	1,065,876.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	-	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		722,903,052.27	-	723,968,928.64	1,065,876.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	14,623,200.00	-	-	-
其中：股指期货投资	14,623,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,623,200.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	12,841,680.00	-	-	-
其中：股指期货投资	12,841,680.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-
合计	12,841,680.00	-	-

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。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2303	中证 500 股指期货 2303	12.00	14,098,560.00	-524,640.00
合计				-524,640.00
减：可抵销期货暂收款				-524,640.00
净额				-

7.4.7.3.3 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				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 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 2022 年 12 月 31 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：已出售 或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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：已出售 或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 12 月 31 日				
		初始成本	利息调整	应计利息	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		-	-	-	-	-
项目		上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		初始成本	利息调整	应计利息	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		-	-	-	-	-

7.4.7.5.2 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	-	-	-	-

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-

	-	-	-	-	-	-
小计	-	-	-	-	-	-
资产支持证 券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

7.4.7.6.2 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	-	-	-	-

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动

-	-	-	-
合计	-	-	-

7.4.7.7.2 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 2022 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 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	-	-	-	-	-	-

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	9,144.81
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
-	-	-
合计	-	9,144.81

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-

应付交易费用	651,444.15	556,697.56
其中：交易所市场	651,444.15	556,697.56
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	16,460.92
合计	811,444.15	573,158.48

7.4.7.10 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 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	51,286,923.65	51,286,923.65
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-21,805,607.19	-21,805,607.19
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	29,481,316.46	29,481,316.46

国海量化优选一年持有股票 C

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	393,637,735.03	393,637,735.03
本期申购	111,775,143.79	111,775,143.79
本期赎回（以“-”号填列）	-93,294,070.19	-93,294,070.19
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	412,118,808.63	412,118,808.63

7.4.7.11 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	-	-	-	-	-	-

7.4.7.12 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
本期期初	33,434,511.85	4,932,367.88	38,366,879.73
本期利润	-2,225,863.44	-303,275.29	-2,529,138.73
本期基金份额交易产生的变动数	-12,912,204.16	-2,876,258.49	-15,788,462.65
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-12,912,204.16	-2,876,258.49	-15,788,462.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,296,444.25	1,752,834.10	20,049,278.35

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
本期期初	256,131,381.05	37,850,971.37	293,982,352.42
本期利润	-11,836,450.20	-14,721,906.94	-26,558,357.14
本期基金份额交易产生的变动数	10,539,750.66	1,412,895.80	11,952,646.46
其中：基金申购款	74,233,160.04	9,133,922.24	83,367,082.28
基金赎回款	-63,693,409.38	-7,721,026.44	-71,414,435.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	254,834,681.51	24,541,960.23	279,376,641.74

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月

		31 日
活期存款利息收入	201,414.60	62,185.57
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	183,833.00	36,947.69
其他	3,067.51	841.53
合计	388,315.11	99,974.79

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-10,350,508.48	-1,187,754.88
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	-10,350,508.48	-1,187,754.88

注：股票投资收益中扣除了增值税的影响。

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	10,071,134,184.04	3,035,455,336.51
减：卖出股票成本总额	10,063,096,878.41	3,036,643,091.39
减：交易费用	18,387,814.11	-
买卖股票差价收入	-10,350,508.48	-1,187,754.88

注：卖出股票成交总额中扣除了增值税的影响。

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.16.3 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.16.4 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.17.2 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31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	-	-

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
股指期货投资收益	-4,241,699.78	-
	-	-

注：衍生工具投资收益中扣除了增值税的影响。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	9,681,081.17	659,362.84
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	9,681,081.17	659,362.84

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年8月23日(基金合同生效日)至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-14,191,782.23	-761,373.15
股票投资	-14,191,782.23	-761,373.15
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	-833,400.00	308,760.00
权证投资	-	-
期货投资	-833,400.00	308,760.00
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	-15,025,182.23	-452,613.15

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
基金赎回费收入	49,542.23	64,498.13
-	-	-
合计	49,542.23	64,498.13

7.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-	-

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	40,000.00	10,049.32
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	4,060.76	467.10

账户维护费	-	4,907.77
交易费用	-	5,852,409.89
合计	164,060.76	5,867,834.08

7.4.7.24 分部报告

截至本期末，本资产管理计划无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本资产管理计划无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至 2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国海证券	20,096,701,536.13	100.00	6,709,015,017.91	100.00

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至 2021年12月31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（%）
-	-	-	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日） 至2021年12月31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（%）
国海证券	1,480,000,000.00	100.00	187,800,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至 2021年12月31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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	6,665,463.61	100.00	651,444.15	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	2,220,231.79	100.00	556,697.56	100.00

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年8月23日（基金合 同生效日）至2021年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,574,825.80	2,581,215.00
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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7,902,544.36元，管理人业绩报酬672,281.44元。本报告期内，管理人共收取业绩报酬957,072.81元，其中2022年7月1日前提取的业绩报酬284,791.37元未包

含在上述管理费中。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	790,254.42	258,121.50

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；

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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		
	2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-	-	-

上年度可比期间 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	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
	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 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
	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	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 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2022年1月1日至2022年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31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	-	-
报告期末持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.48%	3.04%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日	2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31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	-
报告期间申购/买入总份额	-	13,425,702.16
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.48%	3.02%

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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	上年度末
	2022年12月31日	2021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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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 (%)
国海良时期 货有限公司	-	-	5,585,097.47	1.4188

注：

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份 有限公司	55,699,125.18	201,414.60	43,901,358.66	62,185.57

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期	流通受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单 位：股)	期末 成本总额	期末估 值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券	证券	成功	受限期	流通受限	认购	期末估	数量	期末	期末估	备注

代码	名称	认购日		类型	价格	值单价	(单 位: 份)	成本总额	值总额	
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复 牌 日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项停牌	46.41	-	-	3,800	172,209.35	176,358.00	-
002387	维信诺	2022年12月31日	重大事项停牌	6.34	-	-	17,100	96,899.88	108,414.00	-
300850	新强联	2022年12月31日	重大事项停牌	53.28	-	-	900	59,304.17	47,952.00	-
000153	丰原药业	2022年12月31日	重大事项停牌	13.56	-	-	3,100	40,014.65	42,036.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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。

7.4.13.2.2 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	上年度末
--------	-----	------

	2022 年 12 月 31 日	2021 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。

7.4.13.2.3 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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。

7.4.13.2.4 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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。

7.4.13.2.5 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 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。

7.4.13.2.6 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	上年度末
--------	-----	------

	2022 年 12 月 31 日	2021 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。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 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 2022 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	-	-	-	-
上年度末 2021 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	-	-	-	-

7.4.13.3.2 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 7.4.12（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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	55,699,125.18	-	-	-	55,699,125.18
结算备付金	10,890,187.67	-	-	-	10,890,187.67
存出保证金	2,100,750.78	-	-	-	2,100,750.78
交易性金融资产	-	-	-	672,548,444.77	672,548,444.77
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	-	-	-	169,497.50	169,497.50
应收清算款	-	-	-	6,657,888.61	6,657,888.61
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	68,690,063.63	-	-	679,375,830.88	748,065,894.51
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	201,987.08	201,987.08
应付管理人报酬	-	-	-	662,481.16	662,481.16
应付托管费	-	-	-	66,248.10	66,248.10
应付清算款	-	-	-	5,297,688.84	5,297,688.84
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	-	-	-	811,444.15	811,444.15
负债总计	-	-	-	7,039,849.33	7,039,849.33
利率敏感度缺口	68,690,063.63	-	-	672,335,981.55	741,026,045.18
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	43,901,358.66	-	-	-	43,901,358.66
结算备付金	8,128,894.83	-	-	-	8,128,894.83
存出保证金	2,040,712.23	-	-	-	2,040,712.23
交易性金融资产	-	-	-	723,968,928.64	723,968,928.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	84,864.17	84,864.17
应收证券清算款	-	-	-	4,598,068.72	4,598,068.72
其他资产	-	-	-	9,144.81	9,144.81
资产总计	54,070,965.72	-	-	728,661,006.34	782,731,972.06
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	646,344.24	646,344.24
应付托管费	-	-	-	64,634.43	64,634.43
应付证券清算款	-	-	-	4,173,944.08	4,173,944.08
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	573,158.48	573,158.48
负债总计	-	-	-	5,458,081.23	5,458,081.23

利率敏感度缺口	54,070,965.72	-	-723,202,925.11	777,273,890.83
---------	---------------	---	-----------------	----------------

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	-	-	-

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。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
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 2021 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其它资产	-	-	-	-
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	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	-	-	-

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。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）		
相关风险变量的变动	本期末（2022年12月31日）		上年度末（2021年12月31日）
	分析	-	-

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021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	672,548,444.77	90.76	723,968,928.64	93.14
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	672,548,444.77	90.76	723,968,928.64	93.14

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	36,672,449.06	45,213,687.03
	业绩比较基准下降5%	-36,672,449.06	-45,213,687.03

7.4.13.4.4 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（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	-	-	-
	合计	-	-

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	672,173,684.77	723,968,928.64
第二层次	374,760.00	-
第三层次	-	-
合计	672,548,444.77	723,968,928.64

注：根据《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>》的要求，本集合计划期末使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期股票投资、违约债、非指数收益法估值长期停牌股票等估值模型中使用不可观察输入值进行估值的金融资产公允价值由第二层次划分为第三层次，同时本集合计划对上年度末可比数字按照此标准进行了追溯调整。

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划政策以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本集合计划本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益	-	-	-

的利得或损失			
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比同期 2021年8月23日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除债权投资外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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 441,600,125.09 份，集合计划暂估业绩报酬前的资产总净值 741,026,045.18 元，其中 A 型集合计划暂估业绩报酬前的资产净值 49,530,594.81 元，该净值未体现暂估业绩报酬 666,583.88 元，暂估业绩报酬后的资产净值 48,687,720.59 元，C 型集合计划暂估业绩报酬前的资产净值 691,495,450.37 元，该净值未体现暂估业绩报酬 52,621.27 元，暂估业绩报酬后的资产净值 691,442,829.10 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	672,548,444.77	89.90
	其中：股票	672,548,444.77	89.90
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	66,589,312.85	8.90

-	-	-	-
8	其他各项资产	8,928,136.89	1.19
9	合计	748,065,894.51	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	7,649,929.00	1.03
B	采矿业	26,745,443.08	3.61
C	制造业	415,197,921.20	56.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,740,415.77	2.80
E	建筑业	8,467,974.60	1.14
F	批发和零售业	29,544,401.11	3.99
G	交通运输、仓储和邮政业	17,503,419.59	2.36
H	住宿和餐饮业	1,215,639.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,299,924.23	5.98
J	金融业	44,194,173.25	5.96
K	房地产业	21,612,482.04	2.92
L	租赁和商务服务业	8,359,158.62	1.13
M	科学研究和技术服务业	8,577,046.63	1.16
N	水利、环境和公共设施管理业	4,864,984.04	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,055,435.00	0.28
Q	卫生和社会工作	3,201,182.11	0.43
R	文化、体育和娱乐业	6,596,290.86	0.89
S	综合	1,722,624.64	0.23
	合计	672,548,444.77	90.76

8.2.2 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（%）
-	-	-
合计	-	-

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600188	兖矿能源	83,600	2,807,288.00	0.38
2	300059	东方财富	141,140	2,738,116.00	0.37
3	002756	永兴材料	21,600	1,990,872.00	0.27
4	601003	柳钢股份	526,288	1,968,317.12	0.27

5	600325	华发股份	205,300	1,860,018.00	0.25
6	300724	捷佳伟创	15,900	1,812,918.00	0.24
7	601328	交通银行	377,000	1,786,980.00	0.24
8	300450	先导智能	44,200	1,779,050.00	0.24
9	601088	中国神华	64,240	1,774,308.80	0.24
10	300750	宁德时代	4,400	1,731,048.00	0.23
11	300390	天华超净	30,900	1,726,692.00	0.23
12	300363	博腾股份	41,600	1,699,360.00	0.23
13	601988	中国银行	534,000	1,687,440.00	0.23
14	300073	当升科技	29,800	1,680,720.00	0.23
15	002497	雅化集团	72,124	1,676,883.00	0.23
16	300769	德方纳米	7,295	1,674,859.05	0.23
17	601288	农业银行	548,500	1,596,135.00	0.22
18	600327	大东方	322,723	1,578,115.47	0.21
19	000878	云南铜业	132,700	1,559,225.00	0.21
20	300763	锦浪科技	8,600	1,548,430.00	0.21
21	300037	新宙邦	35,280	1,533,621.60	0.21
22	002797	第一创业	269,900	1,519,537.00	0.21
23	000932	华菱钢铁	321,500	1,511,050.00	0.20
24	300373	扬杰科技	28,600	1,504,360.00	0.20
25	600705	中航产融	455,100	1,492,728.00	0.20
26	300136	信维通信	90,300	1,490,853.00	0.20
27	600348	华阳股份	104,600	1,490,550.00	0.20
28	300316	晶盛机电	23,200	1,474,592.00	0.20
29	600389	江山股份	32,899	1,450,187.92	0.20
30	300482	万孚生物	45,200	1,440,524.00	0.19
31	300418	昆仑万维	99,700	1,436,677.00	0.19
32	300253	卫宁健康	139,200	1,430,976.00	0.19
33	300058	蓝色光标	283,000	1,429,150.00	0.19
34	600390	五矿资本	280,601	1,425,453.08	0.19
35	300496	中科创达	14,200	1,424,260.00	0.19
36	300274	阳光电源	12,700	1,419,860.00	0.19
37	601038	一拖股份	125,200	1,414,760.00	0.19
38	300014	亿纬锂能	16,000	1,406,400.00	0.19
39	300088	长信科技	234,900	1,402,353.00	0.19
40	300003	乐普医疗	60,532	1,390,420.04	0.19
41	300760	迈瑞医疗	4,400	1,390,268.00	0.19
42	300676	华大基因	26,700	1,380,123.00	0.19
43	300001	特锐德	89,458	1,360,656.18	0.18
44	002423	中粮资本	190,000	1,360,400.00	0.18
45	300296	利亚德	239,987	1,358,326.42	0.18
46	300383	光环新网	166,300	1,357,008.00	0.18
47	300568	星源材质	63,489	1,349,776.14	0.18

48	000550	江铃汽车	100,503	1,349,755.29	0.18
49	600095	湘财股份	177,100	1,338,876.00	0.18
50	300661	圣邦股份	7,688	1,326,948.80	0.18
51	300677	英科医疗	62,880	1,322,366.40	0.18
52	002003	伟星股份	130,320	1,318,838.40	0.18
53	600906	财达证券	174,000	1,317,180.00	0.18
54	300618	寒锐钴业	32,786	1,313,079.30	0.18
55	300115	长盈精密	126,700	1,308,811.00	0.18
56	000617	中油资本	234,700	1,307,279.00	0.18
57	600873	梅花生物	127,900	1,302,022.00	0.18
58	002250	联化科技	83,650	1,296,575.00	0.17
59	600830	香溢融通	205,000	1,291,500.00	0.17
60	601788	光大证券	86,600	1,287,742.00	0.17
61	300881	盛德鑫泰	40,100	1,286,809.00	0.17
62	600318	新力金融	190,200	1,285,752.00	0.17
63	300748	金力永磁	43,900	1,284,514.00	0.17
64	600153	建发股份	94,000	1,283,100.00	0.17
65	000666	经纬纺机	127,702	1,280,851.06	0.17
66	000958	电投产融	287,100	1,280,466.00	0.17
67	300122	智飞生物	14,549	1,277,838.67	0.17
68	600581	八一钢铁	321,200	1,271,952.00	0.17
69	600010	包钢股份	662,100	1,271,232.00	0.17
70	002647	仁东控股	188,800	1,270,624.00	0.17
71	300601	康泰生物	40,220	1,268,136.60	0.17
72	300408	三环集团	40,800	1,252,968.00	0.17
73	300759	康龙化成	18,337	1,246,916.00	0.17
74	300896	爱美客	2,200	1,245,970.00	0.17
75	300751	迈为股份	3,000	1,235,520.00	0.17
76	002443	金洲管道	195,700	1,232,910.00	0.17
77	300413	芒果超媒	41,030	1,231,720.60	0.17
78	300015	爱尔眼科	39,600	1,230,372.00	0.17
79	300142	沃森生物	30,500	1,225,795.00	0.17
80	300433	蓝思科技	116,007	1,221,553.71	0.16
81	300347	泰格医药	11,600	1,215,680.00	0.16
82	300595	欧普康视	34,000	1,213,800.00	0.16
83	300033	同花顺	12,309	1,213,790.49	0.16
84	300124	汇川技术	17,400	1,209,300.00	0.16
85	300223	北京君正	17,100	1,204,524.00	0.16
86	300207	欣旺达	56,947	1,204,429.05	0.16
87	300782	卓胜微	10,500	1,200,150.00	0.16
88	601666	平煤股份	109,700	1,185,857.00	0.16
89	601225	陕西煤业	63,100	1,172,398.00	0.16
90	300002	神州泰岳	267,300	1,160,082.00	0.16

91	600985	淮北矿业	90,600	1,159,680.00	0.16
92	000090	天健集团	208,999	1,141,134.54	0.15
93	600971	恒源煤电	156,600	1,121,256.00	0.15
94	000001	平安银行	84,300	1,109,388.00	0.15
95	000036	华联控股	269,700	1,092,285.00	0.15
96	600765	中航重机	34,840	1,083,175.60	0.15
97	002240	盛新锂能	28,200	1,057,218.00	0.14
98	600383	金地集团	101,382	1,037,137.86	0.14
99	600395	盘江股份	154,200	1,036,224.00	0.14
100	600350	山东高速	181,710	1,033,929.90	0.14
101	603878	武进不锈	96,084	1,033,863.84	0.14
102	600027	华电国际	175,500	1,031,940.00	0.14
103	000937	冀中能源	161,400	1,026,504.00	0.14
104	600282	南钢股份	325,600	1,025,640.00	0.14
105	000519	中兵红箭	51,800	1,017,352.00	0.14
106	601658	邮储银行	216,500	1,000,230.00	0.13
107	002763	汇洁股份	129,400	988,616.00	0.13
108	600098	广州发展	177,500	985,125.00	0.13
109	601006	大秦铁路	147,300	983,964.00	0.13
110	600729	重庆百货	40,962	968,751.30	0.13
111	002238	天威视讯	146,500	968,365.00	0.13
112	002948	青岛银行	284,720	956,659.20	0.13
113	002567	唐人神	134,800	954,384.00	0.13
114	603886	元祖股份	48,000	941,760.00	0.13
115	000831	中国稀土	28,600	940,368.00	0.13
116	600376	首开股份	161,500	918,935.00	0.12
117	600479	千金药业	95,600	917,760.00	0.12
118	601098	中南传媒	91,300	911,174.00	0.12
119	600177	雅戈尔	143,520	908,481.60	0.12
120	000629	钒钛股份	192,000	908,160.00	0.12
121	002419	天虹股份	131,600	905,408.00	0.12
122	600372	中航电子	56,300	899,111.00	0.12
123	002056	横店东磁	47,961	898,789.14	0.12
124	601000	唐山港	327,000	895,980.00	0.12
125	600895	张江高科	78,700	892,458.00	0.12
126	002231	奥维通信	107,500	889,025.00	0.12
127	000581	威孚高科	49,665	880,560.45	0.12
128	600028	中国石化	201,800	879,848.00	0.12
129	002085	万丰奥威	147,700	878,815.00	0.12
130	600316	洪都航空	34,700	874,093.00	0.12
131	600435	北方导航	75,300	873,480.00	0.12
132	600036	招商银行	23,100	860,706.00	0.12
133	601009	南京银行	82,500	859,650.00	0.12

134	002318	久立特材	51,200	851,968.00	0.11
135	300107	建新股份	163,200	838,848.00	0.11
136	002885	京泉华	28,100	837,942.00	0.11
137	600548	深高速	92,000	826,160.00	0.11
138	601169	北京银行	191,100	823,641.00	0.11
139	600048	保利发展	54,400	823,072.00	0.11
140	002603	以岭药业	27,400	820,904.00	0.11
141	603858	步长制药	38,361	805,964.61	0.11
142	002737	葵花药业	34,600	802,028.00	0.11
143	002088	鲁阳节能	34,558	798,980.96	0.11
144	300811	铂科新材	9,200	795,524.00	0.11
145	002466	天齐锂业	10,056	794,323.44	0.11
146	601126	四方股份	54,163	790,779.80	0.11
147	600023	浙能电力	225,900	788,391.00	0.11
148	600096	云天化	37,357	785,991.28	0.11
149	000402	金融街	149,200	783,300.00	0.11
150	601216	君正集团	195,900	781,641.00	0.11
151	600019	宝钢股份	139,700	780,923.00	0.11
152	600157	永泰能源	506,600	775,098.00	0.10
153	002407	多氟多	22,821	760,395.72	0.10
154	301026	浩通科技	18,095	759,990.00	0.10
155	002933	新兴装备	24,200	757,702.00	0.10
156	300065	海兰信	56,900	751,649.00	0.10
157	300719	安达维尔	66,200	748,722.00	0.10
158	002475	立讯精密	23,500	746,125.00	0.10
159	688070	纵横股份	17,613	744,501.51	0.10
160	002516	旷达科技	151,700	743,330.00	0.10
161	601890	亚星锚链	83,700	739,071.00	0.10
162	600256	广汇能源	81,548	735,562.96	0.10
163	688682	霍莱沃	9,243	734,448.78	0.10
164	002303	美盈森	207,200	733,488.00	0.10
165	603156	养元饮品	32,900	732,683.00	0.10
166	300123	亚光科技	123,700	731,067.00	0.10
167	300581	晨曦航空	41,700	730,584.00	0.10
168	002389	航天彩虹	35,500	730,235.00	0.10
169	003009	中天火箭	18,500	729,825.00	0.10
170	600642	申能股份	132,800	729,072.00	0.10
171	601677	明泰铝业	40,100	727,414.00	0.10
172	000656	金科股份	379,800	725,418.00	0.10
173	000723	美锦能源	80,400	725,208.00	0.10
174	000561	烽火电子	79,600	722,768.00	0.10
175	600016	民生银行	208,700	720,015.00	0.10
176	600704	物产中大	148,900	716,209.00	0.10

177	600459	贵研铂业	45,400	714,596.00	0.10
178	002716	金贵银业	237,300	714,273.00	0.10
179	601702	华峰铝业	47,700	713,115.00	0.10
180	000633	合金投资	87,700	710,370.00	0.10
181	600377	宁沪高速	86,245	708,933.90	0.10
182	603045	福达合金	49,740	708,795.00	0.10
183	601600	中国铝业	158,500	708,495.00	0.10
184	002340	格林美	95,200	707,336.00	0.10
185	002367	康力电梯	94,300	707,250.00	0.10
186	300498	温氏股份	36,000	706,680.00	0.10
187	600339	中油工程	237,100	706,558.00	0.10
188	600711	盛屯矿业	119,800	705,622.00	0.10
189	300835	龙磁科技	19,600	705,600.00	0.10
190	003038	鑫铂股份	16,000	705,280.00	0.10
191	300337	银邦股份	90,800	704,608.00	0.10
192	002379	宏创控股	167,500	703,500.00	0.09
193	600674	川投能源	57,500	703,225.00	0.09
194	000969	安泰科技	90,400	700,600.00	0.09
195	000795	英洛华	107,900	700,271.00	0.09
196	600338	西藏珠峰	30,500	699,060.00	0.09
197	600111	北方稀土	27,900	698,895.00	0.09
198	603260	合盛硅业	8,400	696,696.00	0.09
199	002824	和胜股份	23,600	696,672.00	0.09
200	601668	中国建筑	127,800	693,954.00	0.09
201	000002	万科 A	37,900	689,780.00	0.09
202	601969	海南矿业	92,372	684,476.52	0.09
203	601818	光大银行	222,900	684,303.00	0.09
204	002884	凌霄泵业	41,168	683,800.48	0.09
205	000762	西藏矿业	17,600	679,536.00	0.09
206	601939	建设银行	120,600	678,978.00	0.09
207	600594	益佰制药	122,302	676,330.06	0.09
208	001203	大中矿业	52,000	672,360.00	0.09
209	600777	新潮能源	307,400	670,132.00	0.09
210	002839	张家港行	144,700	667,067.00	0.09
211	600261	阳光照明	206,525	658,814.75	0.09
212	002233	塔牌集团	92,737	658,432.70	0.09
213	002629	仁智股份	161,800	656,908.00	0.09
214	002312	川发龙蟒	62,300	655,396.00	0.09
215	600066	宇通客车	86,900	652,619.00	0.09
216	300502	新易盛	27,400	650,750.00	0.09
217	000789	万年青	75,900	648,186.00	0.09
218	002183	怡亚通	100,400	645,572.00	0.09
219	603355	莱克电气	22,980	644,359.20	0.09

220	600121	郑州煤电	127,800	644,112.00	0.09
221	601998	中信银行	129,000	642,420.00	0.09
222	600398	海澜之家	121,200	642,360.00	0.09
223	600606	绿地控股	215,500	642,190.00	0.09
224	600056	中国医药	37,100	639,233.00	0.09
225	002828	贝肯能源	72,900	638,604.00	0.09
226	002554	惠博普	165,000	638,550.00	0.09
227	002207	准油股份	89,800	638,478.00	0.09
228	000961	中南建设	290,500	636,195.00	0.09
229	300586	美联新材	36,300	635,250.00	0.09
230	600522	中天科技	39,300	634,695.00	0.09
231	600900	长江电力	30,000	630,000.00	0.09
232	002384	东山精密	25,203	623,270.19	0.08
233	600823	世茂股份	263,200	621,152.00	0.08
234	002121	科陆电子	66,908	620,906.24	0.08
235	600603	广汇物流	75,048	613,892.64	0.08
236	300537	广信材料	46,000	609,500.00	0.08
237	000970	中科三环	44,650	609,026.00	0.08
238	002372	伟星新材	28,500	608,190.00	0.08
239	603077	和邦生物	199,700	607,088.00	0.08
240	002563	森马服饰	115,800	606,792.00	0.08
241	600160	巨化股份	38,900	603,339.00	0.08
242	601166	兴业银行	34,000	598,060.00	0.08
243	600062	华润双鹤	33,400	597,526.00	0.08
244	002110	三钢闽光	126,714	595,555.80	0.08
245	002146	荣盛发展	274,000	594,580.00	0.08
246	002169	智光电气	76,900	588,285.00	0.08
247	000915	华特达因	12,900	586,950.00	0.08
248	601615	明阳智能	23,179	585,501.54	0.08
249	300109	新开源	24,000	580,800.00	0.08
250	601601	中国太保	23,600	578,672.00	0.08
251	603689	皖天然气	73,500	577,710.00	0.08
252	688556	高测股份	7,675	575,778.50	0.08
253	603538	美诺华	22,233	572,499.75	0.08
254	300869	康泰医学	17,537	571,180.09	0.08
255	002422	科伦药业	21,300	566,793.00	0.08
256	688019	安集科技	3,140	565,200.00	0.08
257	600741	华域汽车	32,600	564,958.00	0.08
258	300308	中际旭创	20,886	564,548.58	0.08
259	600190	锦州港	159,800	564,094.00	0.08
260	605296	神农集团	22,500	563,175.00	0.08
261	000895	双汇发展	21,700	562,681.00	0.08
262	002807	江阴银行	141,400	561,358.00	0.08

263	000567	海德股份	40,295	560,906.40	0.08
264	002357	富临运业	69,800	559,796.00	0.08
265	300688	创业黑马	33,400	558,448.00	0.08
266	600730	中国高科	89,700	555,243.00	0.07
267	600272	开开实业	57,900	554,682.00	0.07
268	600008	首创环保	195,400	552,982.00	0.07
269	000632	三木集团	121,200	552,672.00	0.07
270	002947	恒铭达	27,960	552,210.00	0.07
271	000690	宝新能源	84,481	549,126.50	0.07
272	600149	廊坊发展	88,300	547,460.00	0.07
273	002432	九安医疗	10,700	546,877.00	0.07
274	600525	长园集团	116,600	545,688.00	0.07
275	000411	英特集团	47,000	543,790.00	0.07
276	603920	世运电路	37,700	542,126.00	0.07
277	600624	复旦复华	94,600	541,112.00	0.07
278	000048	京基智农	30,300	540,855.00	0.07
279	002820	桂发祥	39,300	538,410.00	0.07
280	601016	节能风电	141,290	538,314.90	0.07
281	300942	易瑞生物	31,400	538,196.00	0.07
282	601012	隆基绿能	12,600	532,476.00	0.07
283	603613	国联股份	6,020	532,408.80	0.07
284	002185	华天科技	64,100	531,389.00	0.07
285	300013	新宁物流	107,700	529,884.00	0.07
286	600428	中远海特	88,900	529,844.00	0.07
287	002601	龙佰集团	27,992	529,608.64	0.07
288	601636	旗滨集团	46,400	528,496.00	0.07
289	002326	永太科技	24,200	528,286.00	0.07
290	000548	湖南投资	99,100	522,257.00	0.07
291	000715	中兴商业	58,400	520,928.00	0.07
292	300012	华测检测	23,300	519,590.00	0.07
293	300193	佳士科技	71,206	518,379.68	0.07
294	002793	罗欣药业	67,300	516,191.00	0.07
295	002917	金奥博	42,300	514,791.00	0.07
296	600233	圆通速递	25,600	514,304.00	0.07
297	301060	兰卫医学	26,200	513,782.00	0.07
298	002173	创新医疗	78,700	513,124.00	0.07
299	002923	润都股份	29,200	511,000.00	0.07
300	002566	益盛药业	63,000	510,300.00	0.07
301	002728	特一药业	22,600	509,630.00	0.07
302	000705	浙江震元	64,200	509,106.00	0.07
303	000716	黑芝麻	63,500	508,000.00	0.07
304	600833	第一医药	45,000	507,600.00	0.07
305	002873	新天药业	35,000	506,800.00	0.07

306	603716	塞力医疗	45,900	506,736.00	0.07
307	000788	北大医药	68,000	505,920.00	0.07
308	002551	尚荣医疗	108,800	505,920.00	0.07
309	300030	阳普医疗	73,400	505,726.00	0.07
310	600080	金花股份	64,700	505,307.00	0.07
311	000590	启迪药业	56,500	505,110.00	0.07
312	002758	浙农股份	35,900	504,754.00	0.07
313	000919	金陵药业	64,900	504,273.00	0.07
314	600613	神奇制药	61,200	503,676.00	0.07
315	600499	科达制造	35,436	503,545.56	0.07
316	002907	华森制药	24,700	502,892.00	0.07
317	600829	人民同泰	78,700	502,106.00	0.07
318	603345	安井食品	3,100	501,828.00	0.07
319	301126	达嘉维康	33,700	501,793.00	0.07
320	002693	双成药业	69,000	501,630.00	0.07
321	600863	内蒙华电	143,700	501,513.00	0.07
322	600664	哈药股份	166,600	501,466.00	0.07
323	300777	中简科技	10,200	501,330.00	0.07
324	300534	陇神戎发	56,500	501,155.00	0.07
325	603811	诚意药业	35,800	500,842.00	0.07
326	002594	比亚迪	1,946	500,063.62	0.07
327	002589	瑞康医药	121,300	499,756.00	0.07
328	002750	龙津药业	44,900	499,737.00	0.07
329	002817	黄山胶囊	55,700	499,072.00	0.07
330	301111	粤万年青	25,400	498,348.00	0.07
331	300147	香雪制药	82,100	498,347.00	0.07
332	605199	葫芦娃	31,100	498,222.00	0.07
333	603069	海汽集团	18,900	498,204.00	0.07
334	002898	赛隆药业	41,000	498,150.00	0.07
335	300086	康芝药业	80,000	497,600.00	0.07
336	600222	太龙药业	78,100	497,497.00	0.07
337	002424	贵州百灵	60,900	496,944.00	0.07
338	002435	长江健康	106,300	496,421.00	0.07
339	002550	千红制药	79,300	496,418.00	0.07
340	603963	大理药业	38,000	496,280.00	0.07
341	603000	人民网	29,400	495,978.00	0.07
342	002370	亚太药业	100,800	495,936.00	0.07
343	002349	精华制药	41,048	495,859.84	0.07
344	300039	上海凯宝	61,500	495,690.00	0.07
345	601975	招商南油	125,800	495,652.00	0.07
346	600037	歌华有线	60,800	494,912.00	0.07
347	600371	万向德农	34,900	494,184.00	0.07
348	002462	嘉事堂	34,300	493,577.00	0.07

349	300246	宝莱特	30,200	492,864.00	0.07
350	002932	明德生物	8,600	492,522.00	0.07
351	300254	仟源医药	72,600	491,502.00	0.07
352	002900	哈三联	36,000	491,400.00	0.07
353	300244	迪安诊断	19,547	491,216.11	0.07
354	002627	三峡旅游	82,400	491,104.00	0.07
355	000886	海南高速	101,200	490,820.00	0.07
356	603669	灵康药业	85,300	489,622.00	0.07
357	300158	振东制药	65,500	487,975.00	0.07
358	300937	药易购	16,900	487,734.00	0.07
359	000597	东北制药	77,170	486,942.70	0.07
360	002562	兄弟科技	103,500	486,450.00	0.07
361	002492	恒基达鑫	78,200	486,404.00	0.07
362	600021	上海电力	48,534	485,825.34	0.07
363	300436	广生堂	12,400	485,584.00	0.07
364	600119	长江投资	72,000	485,280.00	0.07
365	300189	神农科技	119,500	485,170.00	0.07
366	002864	盘龙药业	12,500	484,875.00	0.07
367	000813	德展健康	130,600	484,526.00	0.07
368	300204	舒泰神	35,600	484,160.00	0.07
369	002769	普路通	58,600	484,036.00	0.07
370	001202	炬申股份	33,600	482,832.00	0.07
371	301089	拓新药业	6,700	482,400.00	0.07
372	603648	畅联股份	53,300	482,365.00	0.07
373	002682	龙洲股份	99,100	481,626.00	0.06
374	002156	通富微电	29,200	481,216.00	0.06
375	300878	维康药业	19,400	481,120.00	0.06
376	300753	爱朋医疗	26,600	480,662.00	0.06
377	300966	共同药业	17,800	480,600.00	0.06
378	002180	纳思达	9,253	480,138.17	0.06
379	300199	翰宇药业	27,300	479,934.00	0.06
380	002800	天顺股份	19,000	479,180.00	0.06
381	301075	多瑞医药	14,800	478,632.00	0.06
382	002210	飞马国际	205,400	478,582.00	0.06
383	000755	山西路桥	88,400	478,244.00	0.06
384	002719	麦趣尔	28,600	478,192.00	0.06
385	002093	国脉科技	63,000	478,170.00	0.06
386	301211	亨迪药业	13,800	478,170.00	0.06
387	002732	燕塘乳业	20,100	477,576.00	0.06
388	300434	金石亚药	35,000	476,350.00	0.06
389	600491	龙元建设	75,600	475,524.00	0.06
390	300655	晶瑞电材	32,353	474,942.04	0.06
391	300240	飞力达	63,500	474,345.00	0.06

392	600585	海螺水泥	17,300	473,674.00	0.06
393	600418	江淮汽车	36,000	472,680.00	0.06
394	688390	固德威	1,459	471,388.31	0.06
395	300584	海辰药业	14,600	470,120.00	0.06
396	000756	新华制药	15,600	469,560.00	0.06
397	002273	水晶光电	39,700	468,063.00	0.06
398	601778	晶科科技	84,700	465,850.00	0.06
399	002245	蔚蓝锂芯	31,300	465,744.00	0.06
400	603066	音飞储存	41,500	464,800.00	0.06
401	002317	众生药业	17,200	464,228.00	0.06
402	600808	马钢股份	164,900	463,369.00	0.06
403	002002	鸿达兴业	142,900	462,996.00	0.06
404	301116	益客食品	26,900	459,721.00	0.06
405	002582	好想你	48,300	459,333.00	0.06
406	300793	佳禾智能	26,900	458,914.00	0.06
407	001219	青岛食品	17,800	458,884.00	0.06
408	600549	厦门钨业	23,400	457,470.00	0.06
409	002315	焦点科技	25,300	455,653.00	0.06
410	001317	三羊马	10,600	453,680.00	0.06
411	603939	益丰药房	7,100	453,264.00	0.06
412	002695	煌上煌	32,600	452,488.00	0.06
413	603998	方盛制药	56,400	451,764.00	0.06
414	002371	北方华创	2,005	451,726.50	0.06
415	003030	祖名股份	15,500	451,360.00	0.06
416	601579	会稽山	32,100	449,721.00	0.06
417	002324	普利特	28,100	449,600.00	0.06
418	002702	海欣食品	65,200	449,228.00	0.06
419	002895	川恒股份	17,200	448,404.00	0.06
420	000016	深康佳A	99,400	448,294.00	0.06
421	600962	国投中鲁	34,000	448,120.00	0.06
422	600566	济川药业	16,443	447,578.46	0.06
423	600886	国投电力	41,300	447,279.00	0.06
424	002910	庄园牧场	29,500	446,925.00	0.06
425	301035	润丰股份	5,120	445,952.00	0.06
426	300892	品渥食品	15,200	445,360.00	0.06
427	002330	得利斯	58,500	444,600.00	0.06
428	300268	佳沃食品	18,900	444,339.00	0.06
429	000929	兰州黄河	36,600	444,324.00	0.06
430	000983	山西焦煤	38,100	443,865.00	0.06
431	300094	国联水产	73,100	443,717.00	0.06
432	600429	三元股份	83,300	443,156.00	0.06
433	605179	一鸣食品	34,700	442,078.00	0.06
434	000798	中水渔业	40,200	441,798.00	0.06

435	300967	晓鸣股份	25,600	440,320.00	0.06
436	600060	海信视像	32,400	438,696.00	0.06
437	002157	正邦科技	103,700	438,651.00	0.06
438	600381	青海春天	35,600	438,236.00	0.06
439	002878	元隆雅图	28,200	438,228.00	0.06
440	000505	京粮控股	54,100	438,210.00	0.06
441	605198	安德利	23,300	438,040.00	0.06
442	002726	龙大美食	47,600	436,492.00	0.06
443	600238	海南椰岛	27,200	435,200.00	0.06
444	600313	农发种业	42,500	435,200.00	0.06
445	002478	常宝股份	77,300	435,199.00	0.06
446	000713	丰乐种业	48,300	435,183.00	0.06
447	600732	爱旭股份	11,500	434,930.00	0.06
448	002082	万邦德	49,300	434,826.00	0.06
449	002329	皇氏集团	56,900	434,147.00	0.06
450	601991	大唐发电	155,400	433,566.00	0.06
451	605337	李子园	18,500	433,455.00	0.06
452	300957	贝泰妮	2,900	432,796.00	0.06
453	603605	珀莱雅	2,580	432,098.40	0.06
454	603311	金海高科	35,300	431,366.00	0.06
455	600354	敦煌种业	54,900	430,965.00	0.06
456	002986	宇新股份	19,800	430,452.00	0.06
457	600257	大湖股份	71,800	430,082.00	0.06
458	002868	绿康生化	8,100	430,029.00	0.06
459	002738	中矿资源	6,403	426,823.98	0.06
460	603777	来伊份	19,700	425,717.00	0.06
461	000014	沙河股份	41,760	425,534.40	0.06
462	603650	彤程新材	13,800	425,454.00	0.06
463	603212	赛伍技术	13,419	425,382.30	0.06
464	300505	川金诺	18,700	425,238.00	0.06
465	000671	阳光城	226,000	424,880.00	0.06
466	002339	积成电子	61,100	423,423.00	0.06
467	000828	东莞控股	47,000	421,590.00	0.06
468	002444	巨星科技	22,200	421,356.00	0.06
469	300716	国立科技	30,600	420,750.00	0.06
470	300898	熊猫乳品	17,200	420,540.00	0.06
471	002831	裕同科技	12,700	419,989.00	0.06
472	002048	宁波华翔	30,200	419,780.00	0.06
473	600171	上海贝岭	23,900	416,577.00	0.06
474	002460	赣锋锂业	5,960	414,279.60	0.06
475	002137	实益达	56,100	412,335.00	0.06
476	000726	鲁泰 A	55,617	410,453.46	0.06
477	002584	西陇科学	59,100	409,563.00	0.06

478	600844	丹化科技	128,300	407,994.00	0.06
479	300673	佩蒂股份	23,000	405,950.00	0.05
480	601231	环旭电子	25,000	405,750.00	0.05
481	600438	通威股份	10,500	405,090.00	0.05
482	603078	江化微	19,700	404,047.00	0.05
483	688618	三旺通信	5,054	403,814.60	0.05
484	688122	西部超导	4,256	403,000.64	0.05
485	600636	国新文化	42,600	402,996.00	0.05
486	605090	九丰能源	19,500	402,675.00	0.05
487	300212	易华录	19,700	402,077.00	0.05
488	600104	上汽集团	27,900	402,039.00	0.05
489	000009	中国宝安	33,100	400,179.00	0.05
490	000428	华天酒店	60,700	398,799.00	0.05
491	300442	润泽科技	9,400	398,184.00	0.05
492	002055	得润电子	46,100	397,382.00	0.05
493	002299	圣农发展	16,700	395,623.00	0.05
494	002467	二六三	79,000	392,630.00	0.05
495	002995	天地在线	14,700	392,343.00	0.05
496	603456	九洲药业	9,200	390,356.00	0.05
497	600039	四川路桥	35,100	390,312.00	0.05
498	603200	上海洗霸	23,537	390,008.09	0.05
499	002557	洽洽食品	7,800	390,000.00	0.05
500	300393	中来股份	26,200	388,284.00	0.05
501	002747	埃斯顿	17,900	388,072.00	0.05
502	000070	特发信息	55,881	386,696.52	0.05
503	300081	恒信东方	57,800	385,526.00	0.05
504	002908	德生科技	24,500	384,650.00	0.05
505	300565	科信技术	16,500	383,790.00	0.05
506	300513	恒实科技	34,000	383,520.00	0.05
507	600820	隧道股份	72,700	383,129.00	0.05
508	300305	裕兴股份	25,800	382,098.00	0.05
509	300364	中文在线	38,500	381,920.00	0.05
510	603559	中通国脉	34,400	381,840.00	0.05
511	002168	惠程科技	95,300	381,200.00	0.05
512	300679	电连技术	10,300	381,100.00	0.05
513	600355	精伦电子	117,500	380,700.00	0.05
514	002104	恒宝股份	51,300	380,133.00	0.05
515	300578	会畅通讯	24,500	379,995.00	0.05
516	603602	纵横通信	33,260	379,829.20	0.05
517	300009	安科生物	40,510	379,173.60	0.05
518	000851	高鸿股份	78,800	379,028.00	0.05
519	000892	欢瑞世纪	84,100	377,609.00	0.05
520	000586	汇源通信	45,600	377,568.00	0.05

521	300603	立昂技术	40,400	377,336.00	0.05
522	002103	广博股份	69,400	376,842.00	0.05
523	000032	深桑达 A	18,700	376,805.00	0.05
524	002279	久其软件	53,300	376,298.00	0.05
525	002897	意华股份	6,400	376,256.00	0.05
526	002528	英飞拓	33,500	375,870.00	0.05
527	300592	华凯易佰	24,800	375,720.00	0.05
528	300785	值得买	11,100	375,180.00	0.05
529	600130	波导股份	84,100	374,245.00	0.05
530	300911	亿田智能	8,100	373,734.00	0.05
531	600050	中国联通	83,300	373,184.00	0.05
532	000681	视觉中国	30,339	373,169.70	0.05
533	002507	涪陵榨菜	14,471	372,917.67	0.05
534	000157	中联重科	68,500	372,640.00	0.05
535	000679	大连友谊	51,800	371,924.00	0.05
536	000600	建投能源	70,800	371,700.00	0.05
537	300481	濮阳惠成	13,900	371,547.00	0.05
538	002915	中欣氟材	18,400	371,496.00	0.05
539	603323	苏农银行	79,200	371,448.00	0.05
540	003010	若羽臣	19,700	371,345.00	0.05
541	002305	南国置业	127,600	371,316.00	0.05
542	603129	春风动力	3,300	371,316.00	0.05
543	603192	汇得科技	16,400	370,476.00	0.05
544	600633	浙数文化	45,200	370,188.00	0.05
545	600647	同达创业	28,900	369,920.00	0.05
546	002354	天娱数科	94,600	369,886.00	0.05
547	002385	大北农	41,550	369,795.00	0.05
548	603825	华扬联众	26,000	368,680.00	0.05
549	000006	深振业 A	58,500	368,550.00	0.05
550	300359	全通教育	47,800	368,538.00	0.05
551	600141	兴发集团	12,700	368,300.00	0.05
552	603721	中广天择	21,800	368,202.00	0.05
553	603699	纽威股份	33,100	367,410.00	0.05
554	002181	粤传媒	67,100	366,366.00	0.05
555	600298	安琪酵母	8,100	366,282.00	0.05
556	002095	生意宝	13,300	365,750.00	0.05
557	603879	永悦科技	60,250	365,717.50	0.05
558	000797	中国武夷	100,700	365,541.00	0.05
559	600892	大晟文化	69,200	365,376.00	0.05
560	000029	深深房 A	26,300	365,307.00	0.05
561	000909	数源科技	45,700	364,686.00	0.05
562	688099	晶晨股份	5,172	364,677.72	0.05
563	001218	丽臣实业	17,120	364,142.40	0.05

564	000637	茂化实华	67,900	363,944.00	0.05
565	000863	三湘印象	85,400	363,804.00	0.05
566	000514	渝开发	84,800	363,792.00	0.05
567	000422	湖北宜化	24,700	363,337.00	0.05
568	603970	中农立华	12,400	363,320.00	0.05
569	600223	鲁商发展	34,300	363,237.00	0.05
570	002556	辉隆股份	41,500	363,125.00	0.05
571	002659	凯文教育	79,800	363,090.00	0.05
572	603786	科博达	5,513	362,920.79	0.05
573	300052	中青宝	18,100	362,905.00	0.05
574	300740	水羊股份	24,000	362,880.00	0.05
575	000599	青岛双星	86,600	362,854.00	0.05
576	000011	深物业 A	31,300	362,767.00	0.05
577	600661	昂立教育	33,400	362,724.00	0.05
578	301118	恒光股份	12,000	362,520.00	0.05
579	000526	学大教育	20,300	362,355.00	0.05
580	300398	飞凯材料	21,100	362,287.00	0.05
581	600884	杉杉股份	19,900	362,180.00	0.05
582	002430	杭氧股份	9,200	362,112.00	0.05
583	600466	蓝光发展	309,200	361,764.00	0.05
584	002621	美吉姆	83,900	361,609.00	0.05
585	601858	中国科传	33,400	361,054.00	0.05
586	002838	道恩股份	20,400	360,672.00	0.05
587	000899	赣能股份	36,900	360,513.00	0.05
588	002999	天禾股份	36,000	360,360.00	0.05
589	600322	天房发展	159,400	360,244.00	0.05
590	000554	泰山石油	65,100	360,003.00	0.05
591	600487	亨通光电	23,900	359,934.00	0.05
592	000159	国际实业	51,700	359,832.00	0.05
593	002748	世龙实业	35,800	359,790.00	0.05
594	002165	红宝丽	88,800	359,640.00	0.05
595	300848	美瑞新材	13,600	359,584.00	0.05
596	000573	粤宏远 A	84,400	359,544.00	0.05
597	000635	英力特	41,500	359,390.00	0.05
598	002246	北化股份	37,600	359,080.00	0.05
599	002395	双象股份	36,900	359,037.00	0.05
600	603949	雪龙集团	19,900	358,996.00	0.05
601	000822	山东海化	45,500	358,995.00	0.05
602	002201	正威新材	27,800	358,620.00	0.05
603	301069	凯盛新材	13,000	358,540.00	0.05
604	688777	中控技术	3,947	358,506.01	0.05
605	000792	盐湖股份	15,800	358,502.00	0.05
606	002054	德美化工	47,790	358,425.00	0.05

607	002170	芭田股份	57,600	358,272.00	0.05
608	003022	联泓新科	11,800	358,130.00	0.05
609	600249	两面针	68,200	358,050.00	0.05
610	000881	中广核技	46,300	357,899.00	0.05
611	600230	沧州大化	21,700	357,833.00	0.05
612	600684	珠江股份	93,900	357,759.00	0.05
613	002176	江特电机	20,500	357,725.00	0.05
614	605117	德业股份	1,080	357,696.00	0.05
615	300576	容大感光	17,300	357,245.00	0.05
616	600657	信达地产	69,500	357,230.00	0.05
617	000665	湖北广电	54,600	357,084.00	0.05
618	600328	中盐化工	24,300	356,967.00	0.05
619	601208	东材科技	31,200	356,616.00	0.05
620	002244	滨江集团	40,300	355,849.00	0.05
621	603810	丰山集团	21,200	355,736.00	0.05
622	000965	天保基建	75,500	355,605.00	0.05
623	002045	国光电器	28,700	355,593.00	0.05
624	300917	特发服务	13,000	355,550.00	0.05
625	300409	道氏技术	24,200	355,498.00	0.05
626	603798	康普顿	30,900	355,350.00	0.05
627	002825	纳尔股份	29,800	355,216.00	0.05
628	300437	清水源	20,600	354,320.00	0.05
629	002094	青岛金王	82,300	353,890.00	0.05
630	600996	贵广网络	23,752	353,667.28	0.05
631	002172	澳洋健康	85,600	353,528.00	0.05
632	300758	七彩化学	29,700	353,430.00	0.05
633	000301	东方盛虹	27,100	353,384.00	0.05
634	603213	镇洋发展	26,700	352,974.00	0.05
635	002409	雅克科技	7,000	352,590.00	0.05
636	002805	丰元股份	8,700	352,524.00	0.05
637	000953	河化股份	50,400	351,792.00	0.05
638	603580	艾艾精工	24,200	351,626.00	0.05
639	000620	新华联	95,400	351,072.00	0.05
640	603330	天洋新材	26,400	350,856.00	0.05
641	600885	宏发股份	10,500	350,805.00	0.05
642	300261	雅本化学	31,800	350,754.00	0.05
643	001217	华尔泰	26,800	350,544.00	0.05
644	002205	国统股份	31,800	350,118.00	0.05
645	002037	保利联合	30,300	349,359.00	0.05
646	000698	沈阳化工	63,000	349,020.00	0.05
647	688559	海目星	6,017	348,023.28	0.05
648	301100	风光股份	15,700	347,912.00	0.05
649	600166	福田汽车	123,800	347,878.00	0.05

650	603133	碳元科技	28,900	347,667.00	0.05
651	000736	中交地产	19,400	347,454.00	0.05
652	000758	中色股份	73,100	347,225.00	0.05
653	002909	集泰股份	39,200	346,528.00	0.05
654	000037	深南电 A	43,200	346,464.00	0.05
655	002383	合众思壮	53,000	345,560.00	0.05
656	000615	奥园美谷	41,800	345,268.00	0.05
657	600644	乐山电力	44,300	345,097.00	0.05
658	002096	南岭民爆	26,400	344,784.00	0.05
659	600396	金山股份	119,000	343,910.00	0.05
660	002666	德联集团	70,700	343,602.00	0.05
661	603378	亚士创能	29,800	343,594.00	0.05
662	003042	中农联合	13,200	343,464.00	0.05
663	300847	中船汉光	21,700	342,860.00	0.05
664	000408	藏格矿业	13,200	342,804.00	0.05
665	002459	晶澳科技	5,700	342,513.00	0.05
666	002186	全聚德	15,000	342,450.00	0.05
667	600217	中再资环	69,600	342,432.00	0.05
668	002610	爱康科技	119,900	341,715.00	0.05
669	002015	协鑫能科	26,000	341,120.00	0.05
670	000421	南京公用	69,700	340,833.00	0.05
671	000068	华控赛格	88,900	340,487.00	0.05
672	300288	朗玛信息	30,700	340,463.00	0.05
673	000711	京蓝科技	120,300	340,449.00	0.05
674	603126	中材节能	49,500	340,065.00	0.05
675	000605	渤海股份	56,200	340,010.00	0.05
676	300140	中环装备	46,500	339,915.00	0.05
677	003019	宸展光电	15,940	339,681.40	0.05
678	000407	胜利股份	88,200	339,570.00	0.05
679	002596	海南瑞泽	99,865	339,541.00	0.05
680	000040	东旭蓝天	92,500	339,475.00	0.05
681	002658	雪迪龙	41,600	339,040.00	0.05
682	002866	传艺科技	7,400	338,698.00	0.05
683	000920	沃顿科技	37,300	338,684.00	0.05
684	300335	迪森股份	74,200	338,352.00	0.05
685	600333	长春燃气	66,200	338,282.00	0.05
686	600379	宝光股份	28,000	337,960.00	0.05
687	000593	德龙汇能	45,000	337,950.00	0.05
688	600460	士兰微	10,300	337,737.00	0.05
689	300632	光莆股份	27,800	337,492.00	0.05
690	603393	新天然气	15,500	337,435.00	0.05
691	600903	贵州燃气	43,500	337,125.00	0.05
692	300631	久吾高科	12,086	336,595.10	0.05

693	003039	顺控发展	19,900	336,509.00	0.05
694	600150	中国船舶	15,101	336,450.28	0.05
695	000722	湖南发展	25,200	335,916.00	0.05
696	000917	电广传媒	64,800	335,664.00	0.05
697	002591	恒大高新	44,700	335,250.00	0.05
698	002911	佛燃能源	27,900	334,521.00	0.05
699	300952	恒辉安防	18,000	334,440.00	0.05
700	300779	惠城环保	9,800	334,180.00	0.05
701	600399	抚顺特钢	23,300	333,423.00	0.04
702	601555	东吴证券	51,026	333,199.78	0.04
703	002561	徐家汇	23,700	332,037.00	0.04
704	603317	天味食品	12,000	329,760.00	0.04
705	300105	龙源技术	41,600	329,056.00	0.04
706	002090	金智科技	27,000	328,050.00	0.04
707	300068	南都电源	15,400	328,020.00	0.04
708	600392	盛和资源	23,400	327,600.00	0.04
709	002630	华西能源	110,840	325,869.60	0.04
710	300787	海能实业	11,980	325,496.60	0.04
711	003027	同兴环保	13,300	325,052.00	0.04
712	000888	峨眉山 A	34,300	324,821.00	0.04
713	600192	长城电工	56,700	323,757.00	0.04
714	300827	上能电气	5,500	323,620.00	0.04
715	002258	利尔化学	18,013	323,513.48	0.04
716	000738	航发控制	12,600	323,064.00	0.04
717	000610	西安旅游	15,700	322,949.00	0.04
718	600486	扬农化工	3,100	322,090.00	0.04
719	000513	丽珠集团	9,900	321,552.00	0.04
720	605378	野马电池	15,100	321,328.00	0.04
721	603025	大豪科技	16,900	321,100.00	0.04
722	300510	金冠股份	60,000	321,000.00	0.04
723	300772	运达股份	21,580	320,894.60	0.04
724	002184	海得控制	28,000	320,880.00	0.04
725	003020	立方制药	9,900	319,770.00	0.04
726	002705	新宝股份	19,200	319,680.00	0.04
727	002112	三变科技	42,800	319,288.00	0.04
728	600537	亿晶光电	57,200	319,176.00	0.04
729	600973	宝胜股份	66,900	319,113.00	0.04
730	002334	英威腾	40,100	318,795.00	0.04
731	601058	赛轮轮胎	31,800	318,636.00	0.04
732	002882	金龙羽	28,900	318,478.00	0.04
733	601699	潞安环能	18,900	318,465.00	0.04
734	000803	山高环能	28,000	318,360.00	0.04
735	600405	动力源	55,100	317,927.00	0.04

736	600268	国电南自	41,500	317,890.00	0.04
737	002617	露笑科技	34,400	317,512.00	0.04
738	002714	牧原股份	6,500	316,875.00	0.04
739	601700	风范股份	62,000	316,820.00	0.04
740	603728	鸣志电器	9,500	316,635.00	0.04
741	603396	金辰股份	3,800	316,312.00	0.04
742	603507	振江股份	10,600	315,986.00	0.04
743	002665	首航高科	88,200	315,756.00	0.04
744	002527	新时达	51,700	315,370.00	0.04
745	000887	中鼎股份	21,774	315,069.78	0.04
746	002622	皓宸医疗	85,100	314,870.00	0.04
747	300693	盛弘股份	5,800	314,824.00	0.04
748	300111	向日葵	96,500	314,590.00	0.04
749	300010	豆神教育	72,300	314,505.00	0.04
750	603628	清源股份	20,500	314,470.00	0.04
751	600207	安彩高科	50,300	314,375.00	0.04
752	002606	大连电瓷	33,500	314,230.00	0.04
753	000568	泸州老窖	1,400	313,992.00	0.04
754	002580	圣阳股份	32,700	313,920.00	0.04
755	002474	榕基软件	37,200	313,596.00	0.04
756	002937	兴瑞科技	13,796	312,479.40	0.04
757	002733	雄韬股份	18,200	312,130.00	0.04
758	601872	招商轮船	55,800	311,922.00	0.04
759	301090	华润材料	31,000	311,860.00	0.04
760	600859	王府井	11,080	311,791.20	0.04
761	300130	新国都	25,800	311,406.00	0.04
762	001208	华菱线缆	31,700	310,343.00	0.04
763	002368	太极股份	11,000	309,430.00	0.04
764	603530	神马电力	20,600	309,206.00	0.04
765	600415	小商品城	58,900	308,636.00	0.04
766	603600	永艺股份	31,650	308,587.50	0.04
767	002642	荣联科技	41,300	308,511.00	0.04
768	601108	财通证券	43,300	308,296.00	0.04
769	000537	广宇发展	23,300	308,259.00	0.04
770	600706	曲江文旅	23,100	308,154.00	0.04
771	002657	中科金财	19,700	308,108.00	0.04
772	002421	达实智能	88,900	307,594.00	0.04
773	600988	赤峰黄金	17,000	306,850.00	0.04
774	603898	好莱客	27,100	306,772.00	0.04
775	000913	钱江摩托	16,600	306,768.00	0.04
776	600847	万里股份	20,000	306,400.00	0.04
777	002241	歌尔股份	18,200	306,306.00	0.04
778	300730	科创信息	25,000	306,250.00	0.04

779	000625	长安汽车	24,860	306,026.60	0.04
780	000404	长虹华意	56,000	305,760.00	0.04
781	002723	小崧股份	21,900	305,505.00	0.04
782	002216	三全食品	16,504	305,489.04	0.04
783	301041	金百泽	15,900	304,167.00	0.04
784	002290	禾盛新材	33,300	303,696.00	0.04
785	002078	太阳纸业	26,338	303,413.76	0.04
786	600756	浪潮软件	22,300	302,611.00	0.04
787	300570	太辰光	20,900	302,214.00	0.04
788	603927	中科软	10,200	302,022.00	0.04
789	002990	盛视科技	11,000	301,730.00	0.04
790	603931	格林达	11,100	301,698.00	0.04
791	300639	凯普生物	17,880	301,278.00	0.04
792	603918	金桥信息	40,900	301,024.00	0.04
793	300468	四方精创	30,100	301,000.00	0.04
794	603366	日出东方	49,800	300,792.00	0.04
795	002308	威创股份	70,400	300,608.00	0.04
796	002676	顺威股份	71,200	300,464.00	0.04
797	300925	法本信息	23,200	300,440.00	0.04
798	003023	彩虹集团	12,900	300,183.00	0.04
799	002197	证通电子	32,000	300,160.00	0.04
800	300991	创益通	22,300	300,158.00	0.04
801	003026	中晶科技	6,200	300,080.00	0.04
802	002362	汉王科技	19,300	299,729.00	0.04
803	300264	佳创视讯	49,700	299,691.00	0.04
804	300479	神思电子	17,500	299,075.00	0.04
805	600210	紫江企业	59,800	299,000.00	0.04
806	000521	长虹美菱	71,000	298,910.00	0.04
807	002418	康盛股份	102,700	298,857.00	0.04
808	603773	沃格光电	15,300	298,809.00	0.04
809	002380	科远智慧	21,200	298,708.00	0.04
810	002512	达华智能	86,300	298,598.00	0.04
811	603186	华正新材	13,200	298,584.00	0.04
812	000948	南天信息	14,300	298,298.00	0.04
813	300845	捷安高科	16,300	297,964.00	0.04
814	603665	康隆达	8,200	297,906.00	0.04
815	603189	网达软件	21,400	297,888.00	0.04
816	002709	天赐材料	6,788	297,721.68	0.04
817	002028	思源电气	7,789	297,695.58	0.04
818	000701	厦门信达	50,800	297,688.00	0.04
819	002530	金财互联	41,100	297,564.00	0.04
820	300872	天阳科技	23,000	297,390.00	0.04
821	301159	三维天地	11,400	297,312.00	0.04

822	688051	佳华科技	9,600	297,312.00	0.04
823	300339	润和软件	16,000	297,120.00	0.04
824	300249	依米康	35,300	296,873.00	0.04
825	300542	新晨科技	25,500	296,820.00	0.04
826	300895	铜牛信息	10,700	296,711.00	0.04
827	600476	湘邮科技	17,500	296,450.00	0.04
828	600855	航天长峰	24,100	296,430.00	0.04
829	603232	格尔软件	19,500	296,400.00	0.04
830	600536	中国软件	5,080	296,316.40	0.04
831	002808	恒久科技	41,300	296,121.00	0.04
832	002537	海联金汇	38,600	296,062.00	0.04
833	600571	信雅达	32,100	295,962.00	0.04
834	603138	海量数据	14,400	295,920.00	0.04
835	000721	西安饮食	17,100	295,830.00	0.04
836	002845	同兴达	21,700	295,771.00	0.04
837	603106	恒银科技	57,400	295,610.00	0.04
838	002369	卓翼科技	62,400	295,152.00	0.04
839	002987	京北方	11,100	295,149.00	0.04
840	300247	融捷健康	83,100	295,005.00	0.04
841	300761	立华股份	8,600	294,550.00	0.04
842	000709	河钢股份	130,300	294,478.00	0.04
843	002782	可立克	17,100	294,462.00	0.04
844	300146	汤臣倍健	12,900	294,378.00	0.04
845	600875	东方电气	14,000	294,280.00	0.04
846	605365	立达信	18,300	294,264.00	0.04
847	300605	恒锋信息	21,400	294,250.00	0.04
848	603881	数据港	12,500	294,125.00	0.04
849	002189	中光学	20,200	294,112.00	0.04
850	605258	协和电子	11,700	294,021.00	0.04
851	600237	铜峰电子	46,200	293,832.00	0.04
852	300773	拉卡拉	17,400	293,712.00	0.04
853	002547	春兴精工	64,100	293,578.00	0.04
854	003005	竞业达	7,300	293,460.00	0.04
855	300144	宋城演艺	20,100	293,460.00	0.04
856	603599	广信股份	9,980	293,412.00	0.04
857	002420	毅昌科技	39,300	293,178.00	0.04
858	002771	真视通	22,900	293,120.00	0.04
859	300077	国民技术	21,000	292,950.00	0.04
860	603327	福蓉科技	18,200	292,838.00	0.04
861	000100	TCL 科技	78,600	292,392.00	0.04
862	600458	时代新材	32,400	292,248.00	0.04
863	003015	日久光电	34,000	292,060.00	0.04
864	688518	联赢激光	9,998	292,041.58	0.04

865	600360	华微电子	44,300	291,937.00	0.04
866	002388	新亚制程	45,100	291,797.00	0.04
867	600703	三安光电	17,000	291,720.00	0.04
868	000725	京东方 A	86,300	291,694.00	0.04
869	600538	国发股份	64,500	291,540.00	0.04
870	603876	鼎胜新材	7,103	291,507.12	0.04
871	000049	德赛电池	6,700	291,316.00	0.04
872	603005	晶方科技	15,700	291,235.00	0.04
873	300458	全志科技	14,300	291,148.00	0.04
874	603933	睿能科技	24,300	291,114.00	0.04
875	003007	直真科技	10,400	290,888.00	0.04
876	300078	思创医惠	63,200	290,720.00	0.04
877	603659	璞泰来	5,600	290,584.00	0.04
878	600688	上海石化	93,400	290,474.00	0.04
879	603068	博通集成	10,200	290,292.00	0.04
880	301002	崧盛股份	12,900	290,250.00	0.04
881	300706	阿石创	12,600	289,800.00	0.04
882	300545	联得装备	18,300	289,689.00	0.04
883	002219	新里程	73,500	289,590.00	0.04
884	002351	漫步者	32,600	289,488.00	0.04
885	600745	闻泰科技	5,500	289,190.00	0.04
886	300672	国科微	3,400	289,170.00	0.04
887	002953	日丰股份	20,262	289,138.74	0.04
888	003029	吉大正元	8,200	289,132.00	0.04
889	600079	人福医药	12,100	289,069.00	0.04
890	002888	惠威科技	23,200	288,840.00	0.04
891	002812	恩捷股份	2,200	288,838.00	0.04
892	600071	凤凰光学	13,700	288,796.00	0.04
893	300456	赛微电子	19,500	288,210.00	0.04
894	002119	康强电子	25,200	288,036.00	0.04
895	300659	中孚信息	10,800	288,036.00	0.04
896	603738	泰晶科技	14,200	287,976.00	0.04
897	600110	诺德股份	36,200	287,790.00	0.04
898	002449	国星光电	34,600	287,526.00	0.04
899	002636	金安国纪	36,900	287,451.00	0.04
900	300814	中富电路	15,900	287,154.00	0.04
901	003028	振邦智能	6,800	287,028.00	0.04
902	300460	惠伦晶体	25,400	286,766.00	0.04
903	688286	敏芯股份	5,816	286,728.80	0.04
904	601318	中国平安	6,100	286,700.00	0.04
905	300671	富满微	7,000	286,090.00	0.04
906	301117	佳缘科技	3,600	285,480.00	0.04
907	002336	人人乐	15,200	285,152.00	0.04

908	002681	奋达科技	75,600	285,012.00	0.04
909	600967	内蒙一机	34,500	284,970.00	0.04
910	000419	通程控股	36,700	284,792.00	0.04
911	002595	豪迈科技	12,300	284,745.00	0.04
912	300285	国瓷材料	10,300	283,971.00	0.04
913	000598	兴蓉环境	58,000	283,620.00	0.04
914	603259	药明康德	3,500	283,500.00	0.04
915	002981	朝阳科技	9,600	283,392.00	0.04
916	002992	宝明科技	5,100	283,050.00	0.04
917	002955	鸿合科技	12,000	282,600.00	0.04
918	000570	苏常柴 A	59,100	281,907.00	0.04
919	300699	光威复材	3,900	281,775.00	0.04
920	002066	瑞泰科技	25,200	281,232.00	0.04
921	603517	绝味食品	4,600	281,014.00	0.04
922	600876	洛阳玻璃	14,000	280,560.00	0.04
923	300374	中铁装配	21,100	280,208.00	0.04
924	603800	道森股份	10,500	280,140.00	0.04
925	000619	海螺新材	44,100	279,594.00	0.04
926	600152	维科技术	18,900	279,153.00	0.04
927	600668	尖峰集团	21,900	279,006.00	0.04
928	002579	中京电子	25,900	278,943.00	0.04
929	002206	海利得	46,700	278,799.00	0.04
930	688707	振华新材	6,200	278,690.00	0.04
931	300121	阳谷华泰	26,900	278,684.00	0.04
932	002077	大港股份	15,000	278,550.00	0.04
933	002398	垒知集团	48,400	278,300.00	0.04
934	002625	光启技术	16,300	277,426.00	0.04
935	002079	苏州固锝	20,700	277,173.00	0.04
936	601077	渝农商行	78,500	277,105.00	0.04
937	002391	长青股份	39,400	276,982.00	0.04
938	300138	晨光生物	15,600	276,588.00	0.04
939	600329	达仁堂	9,500	276,450.00	0.04
940	002597	金禾实业	8,500	276,250.00	0.04
941	003004	声迅股份	10,500	275,205.00	0.04
942	002623	亚玛顿	9,100	274,274.00	0.04
943	001212	中旗新材	10,700	274,241.00	0.04
944	002162	悦心健康	60,600	273,912.00	0.04
945	600586	金晶科技	31,400	273,494.00	0.04
946	603787	新日股份	15,100	273,310.00	0.04
947	002652	扬子新材	102,800	272,420.00	0.04
948	600563	法拉电子	1,700	271,796.00	0.04
949	600255	鑫科材料	105,300	271,674.00	0.04
950	605188	国光连锁	26,600	271,320.00	0.04

951	002187	广百股份	31,400	270,354.00	0.04
952	002043	兔宝宝	24,800	269,328.00	0.04
953	688180	君实生物	4,297	268,992.20	0.04
954	002277	友阿股份	58,600	267,802.00	0.04
955	300357	我武生物	4,860	267,786.00	0.04
956	000151	中成股份	21,000	267,120.00	0.04
957	600835	上海机电	23,800	267,036.00	0.04
958	002614	奥佳华	28,600	266,838.00	0.04
959	300767	震安科技	5,700	266,475.00	0.04
960	600790	轻纺城	57,114	265,580.10	0.04
961	603589	口子窖	4,600	265,282.00	0.04
962	000829	天音控股	27,200	264,928.00	0.04
963	600693	东百集团	54,100	264,549.00	0.04
964	601958	金钼股份	22,900	264,495.00	0.04
965	000759	中百集团	43,400	264,306.00	0.04
966	601128	常熟银行	35,000	264,250.00	0.04
967	600753	东方银星	18,702	263,511.18	0.04
968	600114	东睦股份	31,000	263,500.00	0.04
969	002821	凯莱英	1,780	263,440.00	0.04
970	600605	汇通能源	25,700	263,168.00	0.04
971	002251	步步高	36,600	263,154.00	0.04
972	000783	长江证券	49,355	263,062.15	0.04
973	300547	川环科技	18,200	262,808.00	0.04
974	601168	西部矿业	25,700	262,140.00	0.04
975	300432	富临精工	18,150	261,904.50	0.04
976	603421	鼎信通讯	31,200	261,144.00	0.04
977	603123	翠微股份	18,400	261,096.00	0.04
978	002472	双环传动	10,184	259,182.80	0.03
979	603026	胜华新材	2,796	258,070.80	0.03
980	601689	拓普集团	4,400	257,752.00	0.03
981	600284	浦东建设	38,200	257,468.00	0.03
982	603558	健盛集团	31,200	257,088.00	0.03
983	600356	恒丰纸业	35,000	256,200.00	0.03
984	603006	黎明股份	29,100	256,080.00	0.03
985	300260	新莱应材	3,800	254,980.00	0.03
986	000058	深赛格	32,200	254,380.00	0.03
987	300494	盛天网络	17,000	253,810.00	0.03
988	300861	美畅股份	5,139	252,633.24	0.03
989	603586	金麒麟	19,150	252,397.00	0.03
990	605128	上海沿浦	4,700	252,296.00	0.03
991	601607	上海医药	14,149	252,276.67	0.03
992	601162	天风证券	87,400	250,838.00	0.03
993	300717	华信新材	17,900	250,600.00	0.03

994	600387	海越能源	35,300	249,924.00	0.03
995	603767	中马传动	34,900	249,884.00	0.03
996	688529	豪森股份	11,268	249,811.56	0.03
997	002801	微光股份	10,050	249,340.50	0.03
998	002929	润建股份	6,343	249,026.18	0.03
999	300035	中科电气	12,100	249,018.00	0.03
1,000	600508	上海能源	17,326	248,281.58	0.03
1,001	002128	电投能源	20,100	248,034.00	0.03
1,002	300358	楚天科技	16,800	247,800.00	0.03
1,003	600109	国金证券	28,300	246,210.00	0.03
1,004	603227	雪峰科技	29,600	245,384.00	0.03
1,005	002223	鱼跃医疗	7,700	245,322.00	0.03
1,006	603609	禾丰股份	20,700	245,088.00	0.03
1,007	603368	柳药集团	13,040	243,456.80	0.03
1,008	000967	盈峰环境	53,531	243,030.74	0.03
1,009	002966	苏州银行	31,200	242,736.00	0.03
1,010	600521	华海药业	11,100	242,646.00	0.03
1,011	300230	永利股份	63,900	241,542.00	0.03
1,012	000728	国元证券	37,900	239,907.00	0.03
1,013	000589	贵州轮胎	49,600	237,584.00	0.03
1,014	300532	今天国际	16,400	237,472.00	0.03
1,015	002129	TCL 中环	6,300	237,258.00	0.03
1,016	600862	中航高科	10,618	236,675.22	0.03
1,017	600006	东风汽车	42,200	235,476.00	0.03
1,018	002484	江海股份	10,500	234,885.00	0.03
1,019	300889	爱克股份	18,300	234,240.00	0.03
1,020	300196	长海股份	16,558	233,964.54	0.03
1,021	300017	网宿科技	41,800	233,244.00	0.03
1,022	000975	银泰黄金	21,116	233,120.64	0.03
1,023	000921	海信家电	17,700	233,109.00	0.03
1,024	688097	博众精工	8,134	232,632.40	0.03
1,025	600497	驰宏锌锗	45,440	229,926.40	0.03
1,026	000999	华润三九	4,900	229,369.00	0.03
1,027	002268	电科网安	7,500	228,975.00	0.03
1,028	600796	钱江生化	42,900	228,657.00	0.03
1,029	603037	凯众股份	14,200	228,336.00	0.03
1,030	002136	安纳达	16,800	228,312.00	0.03
1,031	688196	卓越新能	3,934	228,250.68	0.03
1,032	600809	山西汾酒	800	227,992.00	0.03
1,033	600478	科力远	24,300	227,934.00	0.03
1,034	002294	信立泰	6,900	226,665.00	0.03
1,035	000811	冰轮环境	20,400	226,440.00	0.03
1,036	002192	融捷股份	2,300	225,170.00	0.03

1,037	002049	紫光国微	1,700	224,094.00	0.03
1,038	601696	中银证券	21,200	224,084.00	0.03
1,039	600143	金发科技	23,100	223,839.00	0.03
1,040	603328	依顿电子	34,481	223,781.69	0.03
1,041	002968	新大正	10,260	223,565.40	0.03
1,042	300217	东方电热	39,400	223,398.00	0.03
1,043	600213	亚星客车	18,400	223,192.00	0.03
1,044	601990	南京证券	28,100	222,833.00	0.03
1,045	300399	天利科技	21,880	222,300.80	0.03
1,046	002675	东诚药业	13,400	221,904.00	0.03
1,047	002624	完美世界	17,400	221,328.00	0.03
1,048	300447	全信股份	14,300	220,220.00	0.03
1,049	300511	雪榕生物	34,100	219,945.00	0.03
1,050	600370	三房巷	72,400	219,372.00	0.03
1,051	000680	山推股份	53,000	218,890.00	0.03
1,052	000962	东方钨业	24,600	218,694.00	0.03
1,053	603444	吉比特	699	218,675.16	0.03
1,054	002510	天汽模	56,200	218,618.00	0.03
1,055	603041	美思德	19,483	218,599.26	0.03
1,056	600012	皖通高速	29,900	218,569.00	0.03
1,057	603612	索通发展	8,400	218,568.00	0.03
1,058	300277	海联讯	33,000	218,460.00	0.03
1,059	002674	兴业科技	20,200	218,362.00	0.03
1,060	300801	泰和科技	10,294	218,026.92	0.03
1,061	600981	汇鸿集团	75,300	217,617.00	0.03
1,062	601997	贵阳银行	39,600	217,404.00	0.03
1,063	600570	恒生电子	5,362	216,946.52	0.03
1,064	605388	均瑶健康	14,400	216,576.00	0.03
1,065	002439	启明星辰	8,300	216,464.00	0.03
1,066	002046	国机精工	19,500	215,865.00	0.03
1,067	600026	中远海能	17,900	215,695.00	0.03
1,068	688616	西力科技	20,602	215,496.92	0.03
1,069	002138	顺络电子	8,200	214,676.00	0.03
1,070	300666	江丰电子	3,094	214,104.80	0.03
1,071	000988	华工科技	12,992	213,198.72	0.03
1,072	002235	安妮股份	28,700	212,667.00	0.03
1,073	600901	江苏金租	38,800	212,624.00	0.03
1,074	000998	隆平高科	13,200	212,124.00	0.03
1,075	600883	博闻科技	29,200	211,116.00	0.03
1,076	688589	力合微	6,218	210,292.76	0.03
1,077	300931	通用电梯	31,800	209,562.00	0.03
1,078	600482	中国动力	13,700	209,473.00	0.03
1,079	002780	三夫户外	15,300	208,692.00	0.03

1,080	002673	西部证券	34,091	207,614.19	0.03
1,081	000691	亚太实业	45,700	207,478.00	0.03
1,082	002836	新宏泽	21,920	207,363.20	0.03
1,083	300580	贝斯特	11,100	206,682.00	0.03
1,084	600170	上海建工	79,200	205,920.00	0.03
1,085	300232	洲明科技	37,500	205,875.00	0.03
1,086	300371	汇中股份	18,300	205,875.00	0.03
1,087	688312	燕麦科技	13,228	205,166.28	0.03
1,088	600105	永鼎股份	60,000	204,600.00	0.03
1,089	300948	冠中生态	16,582	204,290.24	0.03
1,090	603968	醋化股份	9,400	204,262.00	0.03
1,091	603326	我乐家居	25,521	203,657.58	0.03
1,092	600805	悦达投资	47,800	203,150.00	0.03
1,093	600546	山煤国际	14,000	202,860.00	0.03
1,094	603233	大参林	5,104	202,118.40	0.03
1,095	002887	绿茵生态	23,800	201,824.00	0.03
1,096	002946	新乳业	15,200	201,096.00	0.03
1,097	300832	新产业	4,000	200,560.00	0.03
1,098	002739	万达电影	14,300	200,200.00	0.03
1,099	603515	欧普照明	12,922	200,032.56	0.03
1,100	603089	正裕工业	24,200	199,892.00	0.03
1,101	300968	格林精密	24,900	199,698.00	0.03
1,102	603488	展鹏科技	30,400	199,424.00	0.03
1,103	002979	雷赛智能	8,800	198,968.00	0.03
1,104	688819	天能股份	5,404	198,542.96	0.03
1,105	000830	鲁西化工	16,000	198,240.00	0.03
1,106	601518	吉林高速	68,100	198,171.00	0.03
1,107	688679	通源环境	18,317	198,006.77	0.03
1,108	600742	一汽富维	23,500	196,460.00	0.03
1,109	300126	锐奇股份	35,200	196,416.00	0.03
1,110	600018	上港集团	36,742	196,202.28	0.03
1,111	002030	达安基因	12,600	196,056.00	0.03
1,112	600481	双良节能	15,145	195,976.30	0.03
1,113	300315	掌趣科技	60,900	195,489.00	0.03
1,114	002092	中泰化学	26,200	195,452.00	0.03
1,115	688091	上海谊众	2,800	195,440.00	0.03
1,116	000623	吉林敖东	13,003	194,914.97	0.03
1,117	300739	明阳电路	15,125	194,810.00	0.03
1,118	002158	汉钟精机	8,100	193,995.00	0.03
1,119	688276	百克生物	2,800	193,508.00	0.03
1,120	000960	锡业股份	13,720	193,452.00	0.03
1,121	603663	三祥新材	15,220	193,446.20	0.03
1,122	002050	三花智控	9,100	193,102.00	0.03

1,123	603797	联泰环保	34,980	193,089.60	0.03
1,124	002304	洋河股份	1,200	192,600.00	0.03
1,125	002938	鹏鼎控股	7,000	192,080.00	0.03
1,126	605218	伟时电子	13,900	191,820.00	0.03
1,127	000729	燕京啤酒	18,000	191,160.00	0.03
1,128	600702	舍得酒业	1,200	191,016.00	0.03
1,129	002956	西麦食品	12,840	190,930.80	0.03
1,130	603529	爱玛科技	4,160	190,819.20	0.03
1,131	688557	兰剑智能	5,632	190,643.20	0.03
1,132	002772	众兴菌业	22,900	190,528.00	0.03
1,133	300445	康斯特	15,600	190,320.00	0.03
1,134	002465	海格通信	23,400	190,008.00	0.03
1,135	002752	昇兴股份	36,500	189,800.00	0.03
1,136	688063	派能科技	600	189,390.00	0.03
1,137	002840	华统股份	11,200	189,168.00	0.03
1,138	300200	高盟新材	27,040	189,009.60	0.03
1,139	603269	海鸥股份	15,300	188,955.00	0.03
1,140	603178	圣龙股份	19,600	188,944.00	0.03
1,141	300407	凯发电气	26,300	188,834.00	0.03
1,142	603198	迎驾贡酒	3,000	188,340.00	0.03
1,143	002363	隆基机械	26,700	188,235.00	0.03
1,144	600970	中材国际	22,083	188,147.16	0.03
1,145	003043	华亚智能	3,081	187,910.19	0.03
1,146	301133	金钟股份	8,960	187,622.40	0.03
1,147	600993	马应龙	8,300	187,580.00	0.03
1,148	002039	黔源电力	12,320	187,510.40	0.03
1,149	300231	银信科技	25,700	187,353.00	0.03
1,150	601101	昊华能源	30,300	187,254.00	0.03
1,151	605066	天正电气	25,100	187,246.00	0.03
1,152	300258	精锻科技	16,100	187,243.00	0.03
1,153	002863	今飞凯达	34,600	186,148.00	0.03
1,154	600551	时代出版	18,200	185,276.00	0.03
1,155	002865	钧达股份	1,000	185,100.00	0.02
1,156	605228	神通科技	21,800	184,864.00	0.02
1,157	600345	长江通信	11,911	184,739.61	0.02
1,158	002153	石基信息	12,300	184,377.00	0.02
1,159	605056	咸亨国际	15,100	184,371.00	0.02
1,160	600879	航天电子	27,100	184,280.00	0.02
1,161	002353	杰瑞股份	6,600	184,206.00	0.02
1,162	002697	红旗连锁	32,700	184,101.00	0.02
1,163	002774	快意电梯	28,666	183,462.40	0.02
1,164	601163	三角轮胎	15,000	183,150.00	0.02
1,165	300382	斯莱克	9,700	183,136.00	0.02

1,166	002997	瑞鹄模具	7,500	183,000.00	0.02
1,167	002468	申通快递	17,700	182,841.00	0.02
1,168	600821	金开新能	25,200	182,448.00	0.02
1,169	601258	庞大集团	165,800	182,380.00	0.02
1,170	300654	世纪天鸿	18,000	182,160.00	0.02
1,171	000868	安凯客车	26,600	181,944.00	0.02
1,172	603081	大丰实业	14,600	181,916.00	0.02
1,173	688505	复旦张江	21,747	181,587.45	0.02
1,174	002213	大为股份	11,300	181,252.00	0.02
1,175	603086	先达股份	13,840	181,165.60	0.02
1,176	603321	梅轮电梯	26,400	181,104.00	0.02
1,177	002144	宏达高科	17,900	180,790.00	0.02
1,178	000858	五粮液	1,000	180,690.00	0.02
1,179	002683	广东宏大	6,700	180,632.00	0.02
1,180	002965	祥鑫科技	3,100	180,451.00	0.02
1,181	603335	迪生力	29,100	180,420.00	0.02
1,182	600686	金龙汽车	30,300	180,285.00	0.02
1,183	600236	桂冠电力	31,292	180,241.92	0.02
1,184	605118	力鼎光电	14,400	180,000.00	0.02
1,185	601127	赛力斯	4,500	179,955.00	0.02
1,186	603127	昭衍新药	3,080	179,902.80	0.02
1,187	002345	潮宏基	34,200	179,892.00	0.02
1,188	002101	广东鸿图	8,300	179,861.00	0.02
1,189	002265	西仪股份	13,200	179,520.00	0.02
1,190	002795	永和智控	20,120	179,470.40	0.02
1,191	000017	深中华 A	37,700	179,452.00	0.02
1,192	603658	安图生物	2,900	179,365.00	0.02
1,193	301031	中熔电气	1,100	179,289.00	0.02
1,194	603668	天马科技	10,000	179,200.00	0.02
1,195	000553	安道麦 A	19,800	179,190.00	0.02
1,196	300385	雪浪环境	30,420	179,173.80	0.02
1,197	603701	德宏股份	9,100	179,088.00	0.02
1,198	002703	浙江世宝	19,300	178,911.00	0.02
1,199	600516	方大炭素	29,200	178,704.00	0.02
1,200	600258	首旅酒店	7,200	178,560.00	0.02
1,201	603982	泉峰汽车	8,800	178,464.00	0.02
1,202	000025	特力 A	10,400	178,360.00	0.02
1,203	600099	林海股份	20,400	178,296.00	0.02
1,204	603105	芯能科技	12,100	178,233.00	0.02
1,205	300816	艾可蓝	7,300	178,120.00	0.02
1,206	000678	襄阳轴承	31,500	177,975.00	0.02
1,207	002033	丽江股份	14,700	177,870.00	0.02
1,208	600629	华建集团	40,500	177,795.00	0.02

1,209	000800	一汽解放	23,000	177,790.00	0.02
1,210	000400	许继电气	8,900	177,733.00	0.02
1,211	600335	国机汽车	22,900	177,704.00	0.02
1,212	600698	湖南天雁	38,200	177,630.00	0.02
1,213	300150	世纪瑞尔	49,200	177,612.00	0.02
1,214	688093	世华科技	10,056	177,588.96	0.02
1,215	600843	上工申贝	35,800	177,568.00	0.02
1,216	605183	确成股份	9,400	177,566.00	0.02
1,217	000927	中国铁物	63,600	177,444.00	0.02
1,218	002553	南方精工	15,700	177,410.00	0.02
1,219	605058	澳弘电子	9,500	177,175.00	0.02
1,220	600234	科新发展	25,400	177,038.00	0.02
1,221	000055	方大集团	37,400	176,902.00	0.02
1,222	603655	朗博科技	7,100	176,790.00	0.02
1,223	000922	佳电股份	19,700	176,709.00	0.02
1,224	300585	奥联电子	9,100	176,540.00	0.02
1,225	000957	中通客车	14,600	176,514.00	0.02
1,226	601019	山东出版	28,100	176,468.00	0.02
1,227	002843	泰嘉股份	8,700	176,436.00	0.02
1,228	600038	中直股份	3,800	176,358.00	0.02
1,229	600739	辽宁成大	14,000	176,260.00	0.02
1,230	002765	蓝黛科技	19,600	176,204.00	0.02
1,231	601869	长飞光纤	5,400	176,202.00	0.02
1,232	002360	同德化工	25,036	176,003.08	0.02
1,233	600262	北方股份	11,000	175,670.00	0.02
1,234	605133	嵘泰股份	6,700	175,607.00	0.02
1,235	300239	东宝生物	23,400	175,500.00	0.02
1,236	601010	文峰股份	60,600	175,134.00	0.02
1,237	601577	长沙银行	25,900	175,084.00	0.02
1,238	603357	设计总院	19,280	175,062.40	0.02
1,239	300504	天邑股份	10,900	174,945.00	0.02
1,240	603038	华立股份	24,456	174,860.40	0.02
1,241	603861	白云电器	23,400	174,798.00	0.02
1,242	300596	利安隆	3,203	174,787.71	0.02
1,243	603890	春秋电子	19,100	174,574.00	0.02
1,244	600173	卧龙地产	33,700	174,566.00	0.02
1,245	601801	皖新传媒	33,500	174,535.00	0.02
1,246	600637	东方明珠	26,237	174,476.05	0.02
1,247	603236	移远通信	1,730	174,418.60	0.02
1,248	600814	杭州解百	23,600	174,404.00	0.02
1,249	601326	秦港股份	63,400	174,350.00	0.02
1,250	002661	克明食品	14,800	174,344.00	0.02
1,251	688571	杭华股份	24,941	174,337.59	0.02

1,252	000719	中原传媒	21,700	174,251.00	0.02
1,253	603682	锦和商管	32,200	174,202.00	0.02
1,254	002124	天邦食品	28,500	174,135.00	0.02
1,255	603903	中持股份	19,260	174,110.40	0.02
1,256	603305	旭升集团	5,400	174,096.00	0.02
1,257	688658	悦康药业	9,000	173,880.00	0.02
1,258	002338	奥普光电	7,800	173,862.00	0.02
1,259	002517	恺英网络	26,500	173,840.00	0.02
1,260	300830	金现代	22,400	173,824.00	0.02
1,261	603900	莱绅通灵	27,000	173,610.00	0.02
1,262	300075	数字政通	9,900	173,547.00	0.02
1,263	688585	上纬新材	21,656	173,464.56	0.02
1,264	300692	中环环保	27,150	173,217.00	0.02
1,265	603179	新泉股份	4,500	173,205.00	0.02
1,266	605599	菜百股份	17,000	173,060.00	0.02
1,267	300100	双林股份	23,600	172,988.00	0.02
1,268	603928	兴业股份	16,300	172,943.00	0.02
1,269	002649	博彦科技	16,800	172,872.00	0.02
1,270	603060	国检集团	13,400	172,860.00	0.02
1,271	002311	海大集团	2,800	172,844.00	0.02
1,272	002541	鸿路钢构	5,900	172,811.00	0.02
1,273	002401	中远海科	15,700	172,700.00	0.02
1,274	600519	贵州茅台	100	172,700.00	0.02
1,275	600386	北巴传媒	43,500	172,695.00	0.02
1,276	600665	天地源	46,800	172,692.00	0.02
1,277	002998	优彩资源	26,300	172,528.00	0.02
1,278	600419	天润乳业	11,000	172,480.00	0.02
1,279	002984	森麒麟	5,600	172,424.00	0.02
1,280	300900	广联航空	6,000	172,380.00	0.02
1,281	002247	聚力文化	68,900	172,250.00	0.02
1,282	300669	沪宁股份	21,450	172,243.50	0.02
1,283	603012	创力集团	32,000	172,160.00	0.02
1,284	600969	郴电国际	23,200	172,144.00	0.02
1,285	002927	泰永长征	17,000	172,040.00	0.02
1,286	601368	绿城水务	32,700	172,002.00	0.02
1,287	600529	山东药玻	6,056	171,990.40	0.02
1,288	603267	鸿远电子	1,700	171,972.00	0.02
1,289	002558	巨人网络	21,600	171,936.00	0.02
1,290	000823	超声电子	18,500	171,865.00	0.02
1,291	300462	华铭智能	20,600	171,804.00	0.02
1,292	000900	现代投资	41,100	171,798.00	0.02
1,293	300969	恒帅股份	2,600	171,730.00	0.02
1,294	603967	中创物流	17,200	171,656.00	0.02

1,295	600575	淮河能源	71,200	171,592.00	0.02
1,296	300438	鹏辉能源	2,200	171,578.00	0.02
1,297	300245	天玑科技	22,600	171,534.00	0.02
1,298	002328	新朋股份	34,300	171,500.00	0.02
1,299	300349	金卡智能	18,300	171,471.00	0.02
1,300	688195	腾景科技	7,500	171,450.00	0.02
1,301	600699	均胜电子	12,200	171,410.00	0.02
1,302	300622	博士眼镜	8,300	171,395.00	0.02
1,303	002463	沪电股份	14,400	171,360.00	0.02
1,304	603869	新智认知	20,400	171,360.00	0.02
1,305	300314	戴维医疗	13,200	171,336.00	0.02
1,306	300602	飞荣达	11,900	171,241.00	0.02
1,307	603959	百利科技	16,200	171,234.00	0.02
1,308	600030	中信证券	8,600	171,226.00	0.02
1,309	600982	宁波能源	40,000	171,200.00	0.02
1,310	600035	楚天高速	50,500	171,195.00	0.02
1,311	603789	星光农机	19,900	171,140.00	0.02
1,312	605488	福莱新材	12,800	171,008.00	0.02
1,313	300775	三角防务	4,500	171,000.00	0.02
1,314	002154	报喜鸟	41,500	170,980.00	0.02
1,315	300664	鹏鹞环保	33,200	170,980.00	0.02
1,316	002295	精艺股份	25,900	170,940.00	0.02
1,317	300341	麦克奥迪	19,400	170,914.00	0.02
1,318	600285	羚锐制药	13,100	170,824.00	0.02
1,319	300634	彩讯股份	11,200	170,800.00	0.02
1,320	300377	赢时胜	20,800	170,768.00	0.02
1,321	000576	甘化科工	16,800	170,688.00	0.02
1,322	600343	航天动力	19,500	170,625.00	0.02
1,323	002590	万安科技	21,300	170,613.00	0.02
1,324	603817	海峡环保	28,200	170,610.00	0.02
1,325	603788	宁波高发	16,000	170,560.00	0.02
1,326	603018	华设集团	22,500	170,550.00	0.02
1,327	000551	创元科技	19,900	170,543.00	0.02
1,328	300153	科泰电源	25,300	170,522.00	0.02
1,329	300395	菲利华	3,100	170,500.00	0.02
1,330	603977	国泰集团	21,200	170,448.00	0.02
1,331	605116	奥锐特	6,900	170,361.00	0.02
1,332	603093	南华期货	18,700	170,357.00	0.02
1,333	300219	鸿利智汇	25,500	170,340.00	0.02
1,334	002392	北京利尔	48,800	170,312.00	0.02
1,335	300284	苏交科	30,400	170,240.00	0.02
1,336	603677	奇精机械	15,200	170,240.00	0.02
1,337	688183	生益电子	18,270	170,093.70	0.02

1,338	002006	精功科技	6,800	170,000.00	0.02
1,339	600133	东湖高新	30,900	169,950.00	0.02
1,340	300134	大富科技	21,900	169,944.00	0.02
1,341	600449	宁夏建材	14,300	169,741.00	0.02
1,342	600724	宁波富达	46,500	169,725.00	0.02
1,343	002302	西部建设	23,400	169,650.00	0.02
1,344	002203	海亮股份	15,000	169,500.00	0.02
1,345	002036	联创电子	13,700	169,469.00	0.02
1,346	600422	昆药集团	12,000	169,440.00	0.02
1,347	605507	国邦医药	6,400	169,408.00	0.02
1,348	300119	瑞普生物	9,100	169,351.00	0.02
1,349	002540	亚太科技	33,400	169,338.00	0.02
1,350	002508	老板电器	6,100	169,336.00	0.02
1,351	300590	移为通信	17,260	169,320.60	0.02
1,352	300227	光韵达	25,500	169,320.00	0.02
1,353	300543	朗科智能	20,300	169,302.00	0.02
1,354	002577	雷柏科技	15,100	169,120.00	0.02
1,355	002016	世荣兆业	27,100	169,104.00	0.02
1,356	300650	太龙股份	18,300	169,092.00	0.02
1,357	300725	药石科技	2,100	169,050.00	0.02
1,358	002139	拓邦股份	16,300	169,031.00	0.02
1,359	002788	鹭燕医药	20,285	168,974.05	0.02
1,360	000034	神州数码	7,700	168,938.00	0.02
1,361	300616	尚品宅配	8,600	168,904.00	0.02
1,362	300828	锐新科技	12,315	168,838.65	0.02
1,363	300384	三联虹普	11,100	168,831.00	0.02
1,364	603150	万朗磁塑	6,500	168,805.00	0.02
1,365	000560	我爱我家	67,500	168,750.00	0.02
1,366	300095	华伍股份	18,800	168,636.00	0.02
1,367	300176	派生科技	28,200	168,636.00	0.02
1,368	300642	透景生命	8,100	168,399.00	0.02
1,369	300687	赛意信息	5,700	168,150.00	0.02
1,370	605266	健之佳	2,100	168,147.00	0.02
1,371	300041	回天新材	10,300	168,096.00	0.02
1,372	600513	联环药业	17,900	168,081.00	0.02
1,373	300319	麦捷科技	21,600	168,048.00	0.02
1,374	000532	华金资本	15,600	168,012.00	0.02
1,375	002991	甘源食品	2,200	167,838.00	0.02
1,376	603309	维力医疗	8,400	167,832.00	0.02
1,377	300016	北陆药业	25,700	167,564.00	0.02
1,378	300762	上海瀚讯	12,700	167,386.00	0.02
1,379	300813	泰林生物	3,600	167,256.00	0.02
1,380	688188	柏楚电子	769	166,934.52	0.02

1,381	600673	东阳光	19,200	166,848.00	0.02
1,382	603017	中衡设计	18,200	166,712.00	0.02
1,383	688468	科美诊断	17,600	166,672.00	0.02
1,384	301180	万祥科技	10,100	166,145.00	0.02
1,385	300629	新劲刚	6,500	166,140.00	0.02
1,386	002906	华阳集团	5,000	166,100.00	0.02
1,387	000039	中集集团	23,557	165,841.28	0.02
1,388	002025	航天电器	2,500	165,625.00	0.02
1,389	301235	华康医疗	4,600	164,542.00	0.02
1,390	600995	南网储能	11,400	164,388.00	0.02
1,391	603908	牧高笛	2,700	164,322.00	0.02
1,392	301096	百诚医药	2,400	163,944.00	0.02
1,393	600909	华安证券	35,700	163,863.00	0.02
1,394	002727	一心堂	5,200	163,852.00	0.02
1,395	600380	健康元	14,500	163,705.00	0.02
1,396	688678	福立旺	8,509	163,287.71	0.02
1,397	600867	通化东宝	17,750	162,945.00	0.02
1,398	600118	中国卫星	7,500	161,625.00	0.02
1,399	002065	东华软件	28,500	161,310.00	0.02
1,400	601198	东兴证券	20,699	159,796.28	0.02
1,401	002191	劲嘉股份	22,100	159,783.00	0.02
1,402	002867	周大生	11,300	158,539.00	0.02
1,403	688009	中国通号	33,057	158,343.03	0.02
1,404	600998	九州通	12,141	158,318.64	0.02
1,405	600369	西南证券	42,200	158,250.00	0.02
1,406	600718	东软集团	15,900	158,205.00	0.02
1,407	603688	石英股份	1,200	157,584.00	0.02
1,408	000739	普洛药业	7,300	157,242.00	0.02
1,409	688029	南微医学	1,912	157,032.56	0.02
1,410	002152	广电运通	15,700	156,058.00	0.02
1,411	688778	厦钨新能	2,000	155,360.00	0.02
1,412	000547	航天发展	16,500	154,935.00	0.02
1,413	301216	万凯新材	5,400	154,872.00	0.02
1,414	000636	风华高科	10,400	154,232.00	0.02
1,415	002936	郑州银行	65,450	153,807.50	0.02
1,416	002131	利欧股份	86,400	152,928.00	0.02
1,417	300474	景嘉微	2,800	152,796.00	0.02
1,418	002408	齐翔腾达	21,700	152,768.00	0.02
1,419	300558	贝达药业	3,100	152,737.00	0.02
1,420	603021	山东华鹏	25,500	152,490.00	0.02
1,421	002506	协鑫集成	52,300	152,193.00	0.02
1,422	000027	深圳能源	23,900	152,004.00	0.02
1,423	002926	华西证券	20,100	151,353.00	0.02

1,424	002348	高乐股份	40,200	151,152.00	0.02
1,425	002572	索菲亚	8,300	150,728.00	0.02
1,426	603619	中曼石油	8,400	150,612.00	0.02
1,427	603466	风语筑	11,100	150,183.00	0.02
1,428	301009	可靠股份	12,500	150,000.00	0.02
1,429	600539	狮头股份	23,000	149,960.00	0.02
1,430	000815	美利云	11,000	149,380.00	0.02
1,431	002212	天融信	14,900	148,851.00	0.02
1,432	600271	航天信息	14,266	148,509.06	0.02
1,433	605299	舒华体育	12,800	148,480.00	0.02
1,434	300945	曼卡龙	10,000	148,400.00	0.02
1,435	002574	明牌珠宝	24,400	148,352.00	0.02
1,436	002731	萃华珠宝	9,400	148,332.00	0.02
1,437	002229	鸿博股份	22,300	148,295.00	0.02
1,438	603185	上机数控	1,400	148,190.00	0.02
1,439	002243	力合科创	19,100	147,452.00	0.02
1,440	300329	海伦钢琴	21,400	147,446.00	0.02
1,441	002084	海鸥住工	33,200	147,408.00	0.02
1,442	002803	吉宏股份	9,300	147,312.00	0.02
1,443	002014	永新股份	18,300	147,132.00	0.02
1,444	002599	盛通股份	28,500	147,060.00	0.02
1,445	600580	卧龙电驱	11,800	147,028.00	0.02
1,446	300993	玉马遮阳	11,300	146,900.00	0.02
1,447	002799	环球印务	10,100	146,753.00	0.02
1,448	002195	二三四五	72,900	146,529.00	0.02
1,449	002489	浙江永强	40,000	146,400.00	0.02
1,450	002721	金一文化	44,900	146,374.00	0.02
1,451	002500	山西证券	27,499	145,744.70	0.02
1,452	002565	顺灏股份	35,700	145,656.00	0.02
1,453	600848	上海临港	12,216	145,614.72	0.02
1,454	688521	芯原股份	3,304	145,607.28	0.02
1,455	002846	英联股份	15,300	145,503.00	0.02
1,456	002585	双星新材	11,400	145,350.00	0.02
1,457	301108	洁雅股份	4,300	145,168.00	0.02
1,458	003006	百亚股份	10,500	145,005.00	0.02
1,459	001914	招商积余	9,400	144,572.00	0.02
1,460	002969	嘉美包装	34,300	143,717.00	0.02
1,461	000663	永安林业	17,300	143,417.00	0.02
1,462	003003	天元股份	12,100	143,264.00	0.02
1,463	002958	青农商行	49,500	143,055.00	0.02
1,464	688185	康希诺	972	141,931.44	0.02
1,465	300024	机器人	15,800	141,884.00	0.02
1,466	688256	寒武纪	2,600	141,856.00	0.02

1,467	603031	安孚科技	3,000	139,950.00	0.02
1,468	600208	新湖中宝	54,800	139,192.00	0.02
1,469	688516	奥特维	690	138,690.00	0.02
1,470	002762	金发拉比	14,800	138,676.00	0.02
1,471	600089	特变电工	6,901	138,572.08	0.02
1,472	002155	湖南黄金	10,700	138,565.00	0.02
1,473	002532	天山铝业	17,900	138,188.00	0.02
1,474	300171	东富龙	5,800	137,634.00	0.02
1,475	603885	吉祥航空	8,500	137,530.00	0.02
1,476	002511	中顺洁柔	10,000	137,400.00	0.02
1,477	603095	越剑智能	6,200	137,392.00	0.02
1,478	000812	陕西金叶	19,900	137,310.00	0.02
1,479	600315	上海家化	4,300	136,955.00	0.02
1,480	603712	七一二	3,900	136,188.00	0.02
1,481	000060	中金岭南	33,200	136,120.00	0.02
1,482	600582	天地科技	26,100	135,720.00	0.02
1,483	601005	重庆钢铁	85,700	135,406.00	0.02
1,484	601992	金隅集团	53,300	135,382.00	0.02
1,485	000997	新大陆	10,400	135,304.00	0.02
1,486	000050	深天马 A	15,600	135,096.00	0.02
1,487	600598	北大荒	9,800	134,848.00	0.02
1,488	600511	国药股份	4,800	133,920.00	0.02
1,489	000810	创维数字	9,600	133,824.00	0.02
1,490	688058	宝兰德	3,257	133,081.02	0.02
1,491	601717	郑煤机	11,900	132,804.00	0.02
1,492	600528	中铁工业	17,400	132,762.00	0.02
1,493	603392	万泰生物	1,045	132,401.50	0.02
1,494	688686	奥普特	1,000	132,000.00	0.02
1,495	603019	中科曙光	5,960	131,954.40	0.02
1,496	688123	聚辰股份	1,303	131,863.60	0.02
1,497	603290	斯达半导	400	131,720.00	0.02
1,498	300070	碧水源	27,800	131,494.00	0.02
1,499	300647	超频三	16,250	131,137.50	0.02
1,500	301004	嘉益股份	4,400	131,032.00	0.02
1,501	600330	天通股份	12,400	130,696.00	0.02
1,502	300856	科思股份	2,500	130,375.00	0.02
1,503	600690	海尔智家	5,300	129,638.00	0.02
1,504	300026	红日药业	22,800	129,504.00	0.02
1,505	300251	光线传媒	14,900	129,034.00	0.02
1,506	600760	中航沈飞	2,200	128,986.00	0.02
1,507	300168	万达信息	15,300	128,979.00	0.02
1,508	600801	华新水泥	8,700	128,934.00	0.02
1,509	688002	睿创微纳	3,466	128,900.54	0.02

1,510	001206	依依股份	5,300	128,896.00	0.02
1,511	600201	生物股份	14,300	128,843.00	0.02
1,512	301042	安联锐视	4,000	128,440.00	0.02
1,513	002939	长城证券	15,500	128,340.00	0.02
1,514	002166	莱茵生物	13,480	128,060.00	0.02
1,515	000021	深科技	11,900	127,211.00	0.02
1,516	688012	中微公司	1,294	126,824.94	0.02
1,517	688677	海泰新光	1,122	126,786.00	0.02
1,518	002920	德赛西威	1,200	126,408.00	0.02
1,519	601868	中国能建	55,200	126,408.00	0.02
1,520	002689	远大智能	26,800	125,960.00	0.02
1,521	603218	日月股份	6,200	125,860.00	0.02
1,522	002786	银宝山新	17,800	125,846.00	0.02
1,523	301011	华立科技	4,500	125,595.00	0.02
1,524	000825	太钢不锈	29,000	125,280.00	0.02
1,525	002373	千方科技	14,000	124,880.00	0.02
1,526	300402	宝色股份	5,500	124,850.00	0.02
1,527	300391	康跃科技	12,800	124,800.00	0.02
1,528	002523	天桥起重	40,800	124,440.00	0.02
1,529	300756	金马游乐	7,500	124,350.00	0.02
1,530	600839	四川长虹	47,100	124,344.00	0.02
1,531	002164	宁波东力	20,100	124,218.00	0.02
1,532	002347	泰尔股份	27,600	124,200.00	0.02
1,533	002209	达意隆	15,500	124,155.00	0.02
1,534	002564	天沃科技	22,800	124,032.00	0.02
1,535	002972	科安达	7,600	123,956.00	0.02
1,536	002613	北玻股份	27,000	123,930.00	0.02
1,537	301032	新柴股份	16,500	123,915.00	0.02
1,538	000856	冀东装备	14,900	123,670.00	0.02
1,539	600827	百联股份	10,200	123,624.00	0.02
1,540	300554	三超新材	5,000	123,500.00	0.02
1,541	300817	双飞股份	7,200	123,480.00	0.02
1,542	002877	智能自控	18,100	123,442.00	0.02
1,543	002249	大洋电机	24,100	123,392.00	0.02
1,544	000816	智慧农业	33,800	123,370.00	0.02
1,545	300910	瑞丰新材	1,000	123,310.00	0.02
1,546	600031	三一重工	7,800	123,240.00	0.02
1,547	002598	山东章鼓	11,000	123,200.00	0.02
1,548	002150	通润装备	6,000	123,180.00	0.02
1,549	000880	潍柴重机	13,200	123,156.00	0.02
1,550	300400	劲拓股份	7,500	123,150.00	0.02
1,551	002931	锋龙股份	12,300	123,123.00	0.02
1,552	002796	世嘉科技	14,200	123,114.00	0.02

1,553	600535	天士力	11,440	123,094.40	0.02
1,554	603986	兆易创新	1,200	122,964.00	0.02
1,555	002272	川润股份	20,300	122,815.00	0.02
1,556	603011	合锻智能	15,000	122,550.00	0.02
1,557	603868	飞科电器	1,820	122,540.60	0.02
1,558	002204	大连重工	23,600	122,484.00	0.02
1,559	301063	海锅股份	3,600	122,472.00	0.02
1,560	688210	统联精密	5,547	122,422.29	0.02
1,561	002490	山东墨龙	29,000	122,380.00	0.02
1,562	601866	中远海发	50,500	122,210.00	0.02
1,563	600243	青海华鼎	29,500	122,130.00	0.02
1,564	603289	泰瑞机器	13,600	122,128.00	0.02
1,565	002896	中大力德	5,400	122,094.00	0.02
1,566	002342	巨力索具	29,700	122,067.00	0.02
1,567	002337	赛象科技	27,300	122,031.00	0.02
1,568	605286	同力日升	2,900	122,003.00	0.02
1,569	002685	华东重机	32,700	121,971.00	0.02
1,570	605001	威奥股份	15,300	121,941.00	0.02
1,571	600302	标准股份	20,800	121,888.00	0.02
1,572	603912	佳力图	9,700	121,832.00	0.02
1,573	300173	福能东方	28,200	121,824.00	0.02
1,574	603778	乾景园林	17,600	121,792.00	0.02
1,575	605100	华丰股份	9,300	121,737.00	0.02
1,576	600860	京城股份	8,800	121,704.00	0.02
1,577	002639	雪人股份	14,300	121,550.00	0.02
1,578	300412	迦南科技	20,100	121,404.00	0.02
1,579	000883	湖北能源	28,900	121,380.00	0.02
1,580	603318	水发燃气	14,200	121,268.00	0.02
1,581	601179	中国西电	26,300	121,243.00	0.02
1,582	002127	南极电商	25,200	121,212.00	0.02
1,583	300421	力星股份	10,500	121,170.00	0.02
1,584	002819	东方中科	5,000	120,950.00	0.02
1,585	600520	文一科技	7,600	120,916.00	0.02
1,586	002248	华东数控	12,900	120,744.00	0.02
1,587	002559	亚威股份	16,700	120,741.00	0.02
1,588	603895	天永智能	5,000	120,700.00	0.02
1,589	300351	永贵电器	7,800	120,666.00	0.02
1,590	600172	黄河旋风	24,900	120,516.00	0.02
1,591	603568	伟明环保	6,500	120,445.00	0.02
1,592	000930	中粮科技	14,402	120,400.72	0.02
1,593	002374	中锐股份	20,500	120,335.00	0.02
1,594	002132	恒星科技	27,100	120,324.00	0.02
1,595	000837	秦川机床	12,500	120,125.00	0.02

1,596	603177	德创环保	7,300	120,085.00	0.02
1,597	300165	天瑞仪器	24,900	120,018.00	0.02
1,598	002487	大金重工	2,900	119,973.00	0.02
1,599	002903	宇环数控	6,000	119,940.00	0.02
1,600	002426	胜利精密	45,600	119,928.00	0.02
1,601	002529	海源复材	6,900	119,922.00	0.02
1,602	603611	诺力股份	7,400	119,806.00	0.02
1,603	603883	老百姓	2,960	119,791.20	0.02
1,604	000821	京山轻机	7,300	119,720.00	0.02
1,605	002713	东易日盛	19,000	119,700.00	0.02
1,606	600992	贵绳股份	5,100	119,697.00	0.02
1,607	002178	延华智能	27,900	119,691.00	0.02
1,608	688598	金博股份	545	119,616.60	0.02
1,609	000012	南玻 A	17,800	119,438.00	0.02
1,610	300809	华辰装备	6,400	119,232.00	0.02
1,611	002514	宝馨科技	11,300	119,215.00	0.02
1,612	002552	宝鼎科技	7,900	119,132.00	0.02
1,613	300488	恒锋工具	5,400	119,016.00	0.02
1,614	688268	华特气体	1,602	118,948.50	0.02
1,615	000595	宝塔实业	17,700	118,944.00	0.02
1,616	300161	华中数控	5,200	118,872.00	0.02
1,617	688665	四方光电	1,200	118,800.00	0.02
1,618	002789	建艺集团	8,200	118,572.00	0.02
1,619	002717	岭南股份	41,600	118,560.00	0.02
1,620	300812	易天股份	6,200	118,544.00	0.02
1,621	003025	思进智能	5,700	118,446.00	0.02
1,622	002520	日发精机	16,800	118,440.00	0.02
1,623	600498	烽火通信	9,000	118,260.00	0.02
1,624	300675	建科院	8,300	118,192.00	0.02
1,625	002031	巨轮智能	38,000	118,180.00	0.02
1,626	002883	中设股份	10,600	118,084.00	0.02
1,627	002542	中化岩土	37,900	117,869.00	0.02
1,628	000779	甘咨询	12,000	117,840.00	0.02
1,629	000686	东北证券	18,124	117,806.00	0.02
1,630	002943	宇晶股份	2,100	117,663.00	0.02
1,631	300182	捷成股份	26,300	117,561.00	0.02
1,632	002989	中天精装	6,800	117,504.00	0.02
1,633	603887	城地香江	17,100	117,477.00	0.02
1,634	002116	中国海诚	11,500	117,415.00	0.02
1,635	603690	至纯科技	3,100	117,304.00	0.02
1,636	000928	中钢国际	19,900	117,012.00	0.02
1,637	600500	中化国际	17,700	116,997.00	0.02
1,638	002060	粤水电	17,000	116,960.00	0.02

1,639	601068	中铝国际	24,800	116,808.00	0.02
1,640	601800	中国交建	14,500	116,725.00	0.02
1,641	601789	宁波建工	27,000	116,640.00	0.02
1,642	002062	宏润建设	22,300	116,629.00	0.02
1,643	301091	深城交	4,900	116,620.00	0.02
1,644	603176	汇通集团	16,800	116,424.00	0.02
1,645	603843	正平股份	27,200	116,416.00	0.02
1,646	601880	辽港股份	71,700	116,154.00	0.02
1,647	603860	中公高科	5,000	116,150.00	0.02
1,648	688150	莱特光电	6,000	116,100.00	0.02
1,649	002761	浙江建投	5,500	115,940.00	0.02
1,650	002701	奥瑞金	22,900	115,645.00	0.02
1,651	300567	精测电子	2,300	115,460.00	0.02
1,652	603929	亚翔集成	9,100	115,388.00	0.02
1,653	002019	亿帆医药	9,400	115,150.00	0.02
1,654	002980	华盛昌	3,200	115,136.00	0.02
1,655	600926	杭州银行	8,800	115,104.00	0.02
1,656	000987	越秀资本	19,200	115,008.00	0.02
1,657	603360	百傲化学	6,542	114,942.94	0.02
1,658	603363	傲农生物	8,900	114,721.00	0.02
1,659	002431	棕榈股份	39,200	114,464.00	0.02
1,660	300888	稳健医疗	1,600	114,400.00	0.02
1,661	605009	豪悦护理	2,200	114,114.00	0.02
1,662	600959	江苏有线	38,400	114,048.00	0.02
1,663	601028	玉龙股份	9,900	113,652.00	0.02
1,664	688303	大全能源	2,379	113,430.72	0.02
1,665	003011	海象新材	5,300	113,261.00	0.02
1,666	600769	祥龙电业	13,800	113,160.00	0.02
1,667	600155	华创阳安	17,400	113,100.00	0.02
1,668	002396	星网锐捷	5,900	113,044.00	0.02
1,669	300218	安利股份	11,300	113,000.00	0.02
1,670	002221	东华能源	14,800	112,924.00	0.02
1,671	002985	北摩高科	2,500	112,750.00	0.02
1,672	000401	冀东水泥	13,695	112,709.85	0.02
1,673	601139	深圳燃气	17,200	112,488.00	0.02
1,674	000778	新兴铸管	30,700	112,055.00	0.02
1,675	600663	陆家嘴	11,410	111,133.40	0.01
1,676	603387	基蛋生物	8,888	111,100.00	0.01
1,677	002670	国盛金控	14,800	109,668.00	0.01
1,678	688208	道通科技	3,463	109,257.65	0.01
1,679	300833	浩洋股份	1,300	108,992.00	0.01
1,680	600297	广汇汽车	51,800	108,780.00	0.01
1,681	300514	友讯达	10,600	108,650.00	0.01

1,682	002387	维信诺	17,100	108,414.00	0.01
1,683	603707	健友股份	6,000	108,240.00	0.01
1,684	600572	康恩贝	22,700	107,371.00	0.01
1,685	002266	浙富控股	27,400	107,134.00	0.01
1,686	688722	同益中	5,900	106,554.00	0.01
1,687	603056	德邦股份	5,100	106,233.00	0.01
1,688	300575	中旗股份	4,850	106,069.50	0.01
1,689	600517	国网英大	21,900	105,996.00	0.01
1,690	601598	中国外运	27,600	105,984.00	0.01
1,691	002690	美亚光电	4,420	105,638.00	0.01
1,692	002505	鹏都农牧	40,800	105,264.00	0.01
1,693	600648	外高桥	8,800	105,160.00	0.01
1,694	603866	桃李面包	6,800	104,720.00	0.01
1,695	600409	三友化工	15,800	104,438.00	0.01
1,696	603225	新凤鸣	9,500	103,360.00	0.01
1,697	600064	南京高科	15,636	103,353.96	0.01
1,698	600022	山东钢铁	69,800	103,304.00	0.01
1,699	002004	华邦健康	20,200	103,020.00	0.01
1,700	688335	复洁环保	4,948	102,967.88	0.01
1,701	000785	居然之家	25,100	102,659.00	0.01
1,702	601456	国联证券	9,100	102,375.00	0.01
1,703	601106	中国一重	34,900	102,257.00	0.01
1,704	000089	深圳机场	13,000	102,180.00	0.01
1,705	600871	石化油服	51,600	102,168.00	0.01
1,706	600567	山鹰国际	41,000	101,680.00	0.01
1,707	300938	信测标准	3,040	101,657.60	0.01
1,708	300376	易事特	14,853	101,445.99	0.01
1,709	002429	兆驰股份	29,000	101,210.00	0.01
1,710	300923	研奥股份	5,075	100,992.50	0.01
1,711	688668	鼎通科技	1,528	100,848.00	0.01
1,712	600216	浙江医药	8,600	100,534.00	0.01
1,713	600259	广晟有色	2,500	100,500.00	0.01
1,714	600782	新钢股份	24,500	100,205.00	0.01
1,715	688092	爱科科技	4,284	99,474.48	0.01
1,716	601333	广深铁路	43,600	98,972.00	0.01
1,717	601718	际华集团	33,600	97,776.00	0.01
1,718	603906	龙蟠科技	4,200	97,230.00	0.01
1,719	600667	太极实业	18,800	97,008.00	0.01
1,720	601860	紫金银行	37,400	96,866.00	0.01
1,721	600728	佳都科技	18,200	96,096.00	0.01
1,722	601118	海南橡胶	21,800	95,484.00	0.01
1,723	300463	迈克生物	5,500	95,150.00	0.01
1,724	600737	中粮糖业	13,700	95,078.00	0.01

1,725	600597	光明乳业	8,800	94,688.00	0.01
1,726	300166	东方国信	11,800	94,282.00	0.01
1,727	603882	金域医学	1,200	93,840.00	0.01
1,728	600373	中文传媒	9,800	93,786.00	0.01
1,729	002945	华林证券	7,100	93,578.00	0.01
1,730	600795	国电电力	21,800	93,086.00	0.01
1,731	002832	比音勒芬	3,628	92,913.08	0.01
1,732	002829	星网宇达	2,700	92,853.00	0.01
1,733	002745	木林森	11,400	92,454.00	0.01
1,734	002875	安奈儿	3,500	92,400.00	0.01
1,735	000417	合肥百货	16,900	92,105.00	0.01
1,736	300179	四方达	7,400	91,464.00	0.01
1,737	600131	国网信通	6,100	91,256.00	0.01
1,738	600660	福耀玻璃	2,600	91,182.00	0.01
1,739	688096	京源环保	7,514	90,693.98	0.01
1,740	300072	海新能科	20,800	90,688.00	0.01
1,741	600195	中牧股份	7,800	90,636.00	0.01
1,742	300918	南山智尚	8,800	90,464.00	0.01
1,743	600219	南山铝业	27,530	90,023.10	0.01
1,744	002545	东方铁塔	10,771	89,291.59	0.01
1,745	600507	方大特钢	14,816	89,192.32	0.01
1,746	002416	爱施德	9,400	89,112.00	0.01
1,747	605499	东鹏饮料	500	88,950.00	0.01
1,748	000156	华数传媒	11,800	88,382.00	0.01
1,749	002174	游族网络	9,500	87,970.00	0.01
1,750	603477	巨星农牧	3,600	87,804.00	0.01
1,751	002269	美邦服饰	43,300	87,466.00	0.01
1,752	688330	宏力达	1,371	87,305.28	0.01
1,753	002503	搜于特	67,500	86,400.00	0.01
1,754	688289	圣湘生物	3,936	86,395.20	0.01
1,755	601568	北元集团	15,200	86,184.00	0.01
1,756	600493	凤竹纺织	13,800	86,112.00	0.01
1,757	002612	朗姿股份	3,100	86,056.00	0.01
1,758	001965	招商公路	11,056	85,905.12	0.01
1,759	000538	云南白药	1,580	85,888.80	0.01
1,760	600446	金证股份	8,300	85,407.00	0.01
1,761	002087	新野纺织	27,100	85,365.00	0.01
1,762	600559	老白干酒	3,100	85,343.00	0.01
1,763	603219	富佳股份	5,300	85,065.00	0.01
1,764	003035	南网能源	15,000	85,050.00	0.01
1,765	002486	嘉麟杰	25,300	85,008.00	0.01
1,766	002327	富安娜	12,000	84,840.00	0.01
1,767	002404	嘉欣丝绸	13,300	84,721.00	0.01

1,768	300803	指南针	1,853	84,719.16	0.01
1,769	688001	华兴源创	3,137	84,385.30	0.01
1,770	300327	中颖电子	2,380	84,180.60	0.01
1,771	001209	洪兴股份	6,200	84,072.00	0.01
1,772	002098	浔兴股份	13,000	83,460.00	0.01
1,773	600785	新华百货	4,500	83,430.00	0.01
1,774	000529	广弘控股	9,509	83,393.93	0.01
1,775	002281	光迅科技	5,300	83,316.00	0.01
1,776	002081	金螳螂	17,150	83,177.50	0.01
1,777	301067	显盈科技	2,300	83,145.00	0.01
1,778	688178	万德斯	4,760	83,014.40	0.01
1,779	000559	万向钱潮	17,000	82,790.00	0.01
1,780	301193	家联科技	2,500	82,775.00	0.01
1,781	603816	顾家家居	1,936	82,686.56	0.01
1,782	600764	中国海防	3,601	82,678.96	0.01
1,783	300953	震裕科技	1,000	82,650.00	0.01
1,784	688321	微芯生物	3,752	82,468.96	0.01
1,785	300242	佳云科技	24,200	82,280.00	0.01
1,786	300630	普利制药	3,334	82,216.44	0.01
1,787	601838	成都银行	5,371	82,176.30	0.01
1,788	601933	永辉超市	22,500	82,125.00	0.01
1,789	000898	鞍钢股份	30,700	81,969.00	0.01
1,790	300593	新雷能	1,925	81,774.00	0.01
1,791	300709	精研科技	2,900	81,751.00	0.01
1,792	600596	新安股份	5,392	81,634.88	0.01
1,793	000540	中天金融	54,000	81,540.00	0.01
1,794	000893	亚钾国际	3,000	81,540.00	0.01
1,795	603938	三孚股份	2,360	81,420.00	0.01
1,796	603238	诺邦股份	6,700	81,405.00	0.01
1,797	603606	东方电缆	1,200	81,396.00	0.01
1,798	300101	振芯科技	3,317	81,266.50	0.01
1,799	000733	振华科技	711	81,217.53	0.01
1,800	601186	中国铁建	10,480	81,010.40	0.01
1,801	601985	中国核电	13,500	81,000.00	0.01
1,802	601618	中国中冶	25,400	80,772.00	0.01
1,803	300480	光力科技	5,300	80,666.00	0.01
1,804	600662	外服控股	13,508	80,642.76	0.01
1,805	300401	花园生物	5,600	80,584.00	0.01
1,806	600933	爱柯迪	4,425	80,579.25	0.01
1,807	002063	远光软件	10,612	80,545.08	0.01
1,808	600025	华能水电	12,200	80,520.00	0.01
1,809	002645	华宏科技	5,400	80,514.00	0.01
1,810	600085	同仁堂	1,800	80,424.00	0.01

1,811	688155	先惠技术	1,537	80,369.73	0.01
1,812	000158	常山北明	14,300	80,366.00	0.01
1,813	600968	海油发展	27,900	80,352.00	0.01
1,814	605358	立昂微	1,880	80,088.00	0.01
1,815	002539	云图控股	7,200	80,064.00	0.01
1,816	600811	东方集团	32,800	80,032.00	0.01
1,817	300684	中石科技	5,400	79,974.00	0.01
1,818	603008	喜临门	2,800	79,940.00	0.01
1,819	002664	信质集团	6,100	79,849.00	0.01
1,820	603596	伯特利	1,000	79,800.00	0.01
1,821	300233	金城医药	3,500	79,695.00	0.01
1,822	603737	三棵树	700	79,681.00	0.01
1,823	600063	皖维高新	13,600	79,560.00	0.01
1,824	000685	中山公用	11,300	79,439.00	0.01
1,825	002193	如意集团	8,200	79,130.00	0.01
1,826	600905	三峡能源	14,000	79,100.00	0.01
1,827	600456	宝钛股份	1,920	78,451.20	0.01
1,828	300346	南大光电	2,700	78,435.00	0.01
1,829	002436	兴森科技	8,100	78,408.00	0.01
1,830	300662	科锐国际	1,600	78,400.00	0.01
1,831	601187	厦门银行	13,600	77,928.00	0.01
1,832	600120	浙江东方	21,800	77,826.00	0.01
1,833	000488	晨鸣纸业	15,600	77,688.00	0.01
1,834	601608	中信重工	22,200	77,478.00	0.01
1,835	002010	传化智联	14,400	76,896.00	0.01
1,836	601200	上海环境	8,610	76,887.30	0.01
1,837	600556	天下秀	11,400	76,836.00	0.01
1,838	601611	中国核建	10,100	76,760.00	0.01
1,839	600717	天津港	18,660	76,506.00	0.01
1,840	300257	开山股份	5,100	76,500.00	0.01
1,841	000563	陕国投 A	25,200	76,356.00	0.01
1,842	600707	彩虹股份	18,400	76,176.00	0.01
1,843	601928	凤凰传媒	9,600	76,032.00	0.01
1,844	688655	迅捷兴	6,621	75,810.45	0.01
1,845	002100	天康生物	9,100	75,621.00	0.01
1,846	000959	首钢股份	20,000	75,400.00	0.01
1,847	600167	联美控股	11,853	74,910.96	0.01
1,848	603799	华友钴业	1,330	73,987.90	0.01
1,849	000528	柳工	12,538	73,723.44	0.01
1,850	601567	三星医疗	5,400	72,792.00	0.01
1,851	002390	信邦制药	15,400	72,380.00	0.01
1,852	300860	锋尚文化	1,383	71,957.49	0.01
1,853	688363	华熙生物	529	71,563.12	0.01

1,854	003040	楚天龙	4,100	71,504.00	0.01
1,855	600126	杭钢股份	17,300	71,449.00	0.01
1,856	002141	贤丰控股	17,600	70,752.00	0.01
1,857	605088	冠盛股份	4,100	70,438.00	0.01
1,858	000990	诚志股份	8,000	70,400.00	0.01
1,859	688006	杭可科技	1,607	70,338.39	0.01
1,860	002382	蓝帆医疗	9,000	70,110.00	0.01
1,861	000415	渤海租赁	31,600	69,836.00	0.01
1,862	000876	新希望	5,400	69,714.00	0.01
1,863	002524	光正眼科	9,700	69,258.00	0.01
1,864	688077	大地熊	1,391	69,063.15	0.01
1,865	002891	中宠股份	3,031	67,621.61	0.01
1,866	002434	万里扬	8,380	67,459.00	0.01
1,867	603556	海兴电力	3,800	66,880.00	0.01
1,868	300628	亿联网络	1,100	66,649.00	0.01
1,869	000977	浪潮信息	3,097	66,647.44	0.01
1,870	300712	永福股份	1,500	66,555.00	0.01
1,871	688696	极米科技	400	66,480.00	0.01
1,872	605123	派克新材	500	66,450.00	0.01
1,873	600197	伊力特	2,700	66,258.00	0.01
1,874	002344	海宁皮城	14,108	66,166.52	0.01
1,875	688383	新益昌	697	66,131.36	0.01
1,876	002925	盈趣科技	4,000	66,080.00	0.01
1,877	605080	浙江自然	1,400	66,080.00	0.01
1,878	603379	三美股份	2,320	66,027.20	0.01
1,879	000718	苏宁环球	20,000	66,000.00	0.01
1,880	300416	苏试试验	2,189	65,998.35	0.01
1,881	002410	广联达	1,100	65,945.00	0.01
1,882	600710	苏美达	11,200	65,856.00	0.01
1,883	600307	酒钢宏兴	39,800	65,670.00	0.01
1,884	605196	华通线缆	9,400	65,612.00	0.01
1,885	002343	慈文传媒	10,057	65,471.07	0.01
1,886	002053	云南能投	5,900	65,372.00	0.01
1,887	601633	长城汽车	2,200	65,164.00	0.01
1,888	603136	天目湖	2,400	65,160.00	0.01
1,889	300855	图南股份	1,392	65,131.68	0.01
1,890	600887	伊利股份	2,100	65,100.00	0.01
1,891	301018	申菱环境	1,900	65,075.00	0.01
1,892	603228	景旺电子	3,200	64,768.00	0.01
1,893	603155	新亚强	2,410	64,756.70	0.01
1,894	300332	天壕环境	5,400	64,746.00	0.01
1,895	601512	中新集团	8,100	64,719.00	0.01
1,896	300170	汉得信息	7,950	64,713.00	0.01

1,897	300651	金陵体育	2,900	64,699.00	0.01
1,898	600211	西藏药业	1,800	64,656.00	0.01
1,899	300691	联合光电	5,200	64,636.00	0.01
1,900	001289	龙源电力	3,532	64,529.64	0.01
1,901	300680	隆盛科技	2,600	64,376.00	0.01
1,902	600502	安徽建工	13,400	64,320.00	0.01
1,903	300620	光库科技	1,700	64,277.00	0.01
1,904	002242	九阳股份	3,900	64,272.00	0.01
1,905	603989	艾华集团	2,500	64,200.00	0.01
1,906	603638	艾迪精密	4,300	64,156.00	0.01
1,907	603022	新通联	7,200	64,152.00	0.01
1,908	603169	兰石重装	10,100	64,034.00	0.01
1,909	000989	九芝堂	7,257	63,934.17	0.01
1,910	002405	四维图新	5,800	63,916.00	0.01
1,911	601919	中远海控	6,211	63,911.19	0.01
1,912	601898	中煤能源	7,400	63,788.00	0.01
1,913	002967	广电计量	3,800	63,764.00	0.01
1,914	603313	梦百合	6,000	63,600.00	0.01
1,915	002560	通达股份	9,300	63,426.00	0.01
1,916	600888	新疆众和	7,726	63,275.94	0.01
1,917	688597	煜邦电力	4,200	63,168.00	0.01
1,918	002643	万润股份	4,300	63,038.00	0.01
1,919	301101	明月镜片	1,000	63,020.00	0.01
1,920	301050	雷电微力	816	62,970.72	0.01
1,921	002399	海普瑞	4,900	62,965.00	0.01
1,922	300615	欣天科技	5,600	62,944.00	0.01
1,923	300893	松原股份	2,337	62,865.30	0.01
1,924	688356	键凯科技	400	62,620.00	0.01
1,925	000028	国药一致	1,900	62,491.00	0.01
1,926	300820	英杰电气	850	62,458.00	0.01
1,927	688138	清溢光电	3,428	62,389.60	0.01
1,928	605168	三人行	700	62,279.00	0.01
1,929	000031	大悦城	16,547	62,216.72	0.01
1,930	605111	新洁能	800	62,064.00	0.01
1,931	600641	万业企业	3,500	62,055.00	0.01
1,932	688116	天奈科技	800	61,712.00	0.01
1,933	600623	华谊集团	9,700	61,304.00	0.01
1,934	600202	哈空调	12,100	60,863.00	0.01
1,935	603585	苏利股份	3,416	60,565.68	0.01
1,936	301128	强瑞技术	2,400	60,216.00	0.01
1,937	002653	海思科	2,700	60,075.00	0.01
1,938	301071	力量钻石	500	59,575.00	0.01
1,939	688088	虹软科技	2,645	59,538.95	0.01

1,940	600928	西安银行	16,870	59,382.40	0.01
1,941	300882	万胜智能	3,900	58,656.00	0.01
1,942	688181	八亿时空	1,596	58,413.60	0.01
1,943	603118	共进股份	7,300	58,035.00	0.01
1,944	300572	安车检测	5,000	57,250.00	0.01
1,945	300951	博硕科技	1,200	57,120.00	0.01
1,946	600787	中储股份	11,200	55,664.00	0.01
1,947	688200	华峰测控	200	55,294.00	0.01
1,948	002959	小熊电器	900	54,288.00	0.01
1,949	002952	亚世光电	3,600	53,928.00	0.01
1,950	300802	矩子科技	2,900	53,302.00	0.01
1,951	300645	正元智慧	2,100	52,878.00	0.01
1,952	601298	青岛港	9,400	52,734.00	0.01
1,953	300970	华绿生物	2,900	51,620.00	0.01
1,954	601177	杭齿前进	6,300	51,471.00	0.01
1,955	000869	张裕 A	1,700	51,408.00	0.01
1,956	603040	新坐标	3,000	51,240.00	0.01
1,957	600295	鄂尔多斯	3,360	51,038.40	0.01
1,958	300389	艾比森	5,800	50,634.00	0.01
1,959	688059	华锐精密	314	50,554.00	0.01
1,960	300162	雷曼光电	7,700	50,512.00	0.01
1,961	601156	东航物流	3,300	50,358.00	0.01
1,962	300810	中科海讯	2,900	50,228.00	0.01
1,963	603948	建业股份	2,300	50,071.00	0.01
1,964	300815	玉禾田	3,280	49,954.40	0.01
1,965	603819	神力股份	3,300	49,896.00	0.01
1,966	300214	日科化学	7,577	49,629.35	0.01
1,967	300419	浩丰科技	9,700	49,567.00	0.01
1,968	688169	石头科技	200	49,550.00	0.01
1,969	000935	四川双马	2,355	49,455.00	0.01
1,970	600780	通宝能源	7,700	49,434.00	0.01
1,971	603336	宏辉果蔬	7,100	49,416.00	0.01
1,972	603813	原尚股份	3,400	49,368.00	0.01
1,973	300386	飞天诚信	5,200	49,244.00	0.01
1,974	002848	高斯贝尔	5,300	49,184.00	0.01
1,975	300678	中科信息	2,982	49,143.36	0.01
1,976	603708	家家悦	3,900	49,101.00	0.01
1,977	603101	汇嘉时代	7,760	49,043.20	0.01
1,978	300106	西部牧业	5,100	49,011.00	0.01
1,979	000517	荣安地产	16,600	48,970.00	0.01
1,980	002267	陕天然气	6,791	48,963.11	0.01
1,981	002461	珠江啤酒	6,110	48,941.10	0.01
1,982	002198	嘉应制药	7,500	48,900.00	0.01

1,983	300411	金盾股份	7,700	48,895.00	0.01
1,984	603717	天域生态	7,100	48,848.00	0.01
1,985	300448	浩云科技	10,436	48,840.48	0.01
1,986	000062	深圳华强	4,000	48,840.00	0.01
1,987	600269	赣粤高速	14,400	48,816.00	0.01
1,988	603978	深圳新星	2,634	48,808.02	0.01
1,989	000985	大庆华科	2,800	48,776.00	0.01
1,990	002161	远望谷	10,400	48,776.00	0.01
1,991	600053	九鼎投资	3,300	48,774.00	0.01
1,992	300192	科德教育	6,800	48,688.00	0.01
1,993	300293	蓝英装备	5,700	48,678.00	0.01
1,994	600738	丽尚国潮	6,760	48,672.00	0.01
1,995	603496	恒为科技	3,200	48,672.00	0.01
1,996	603103	横店影视	3,300	48,642.00	0.01
1,997	600758	辽宁能源	12,700	48,641.00	0.01
1,998	300521	爱司凯	4,900	48,608.00	0.01
1,999	000978	桂林旅游	5,300	48,601.00	0.01
2,000	300561	汇金科技	5,400	48,600.00	0.01
2,001	300302	同有科技	7,105	48,598.20	0.01
2,002	300117	嘉寓股份	13,800	48,576.00	0.01
2,003	600643	爱建集团	8,800	48,576.00	0.01
2,004	600359	新农开发	5,600	48,552.00	0.01
2,005	600858	银座股份	7,500	48,525.00	0.01
2,006	000996	中国中期	7,800	48,516.00	0.01
2,007	300120	经纬辉开	8,029	48,495.16	0.01
2,008	603828	柯利达	15,000	48,450.00	0.01
2,009	603607	京华激光	3,756	48,414.84	0.01
2,010	002414	高德红外	4,400	48,400.00	0.01
2,011	300220	金运激光	4,623	48,356.58	0.01
2,012	300157	恒泰艾普	15,100	48,320.00	0.01
2,013	300591	万里马	10,100	48,278.00	0.01
2,014	000566	海南海药	11,300	48,251.00	0.01
2,015	002725	跃岭股份	6,000	48,240.00	0.01
2,016	600193	创兴资源	8,200	48,216.00	0.01
2,017	600617	国新能源	11,900	48,195.00	0.01
2,018	300234	开尔新材	9,600	48,192.00	0.01
2,019	300625	三雄极光	4,600	48,162.00	0.01
2,020	603919	金徽酒	1,800	48,150.00	0.01
2,021	002284	亚太股份	6,800	48,144.00	0.01
2,022	300270	中威电子	9,100	48,139.00	0.01
2,023	000565	渝三峡 A	8,200	48,134.00	0.01
2,024	601236	红塔证券	6,500	48,100.00	0.01
2,025	002133	广宇集团	13,700	48,087.00	0.01

2,026	300689	澄天伟业	2,950	48,055.50	0.01
2,027	600639	浦东金桥	4,328	48,040.80	0.01
2,028	300540	蜀道装备	2,900	48,024.00	0.01
2,029	300829	金丹科技	2,200	47,982.00	0.01
2,030	300492	华图山鼎	1,350	47,965.50	0.01
2,031	300850	新强联	900	47,952.00	0.01
2,032	600716	凤凰股份	12,258	47,928.78	0.01
2,033	002730	电光科技	6,200	47,926.00	0.01
2,034	300243	瑞丰高材	6,200	47,926.00	0.01
2,035	300551	古鳌科技	4,100	47,888.00	0.01
2,036	000712	锦龙股份	3,700	47,878.00	0.01
2,037	300289	利德曼	8,300	47,808.00	0.01
2,038	002902	铭普光磁	3,800	47,766.00	0.01
2,039	300935	盈建科	1,860	47,764.80	0.01
2,040	300340	科恒股份	4,600	47,748.00	0.01
2,041	603229	奥翔药业	2,000	47,600.00	0.01
2,042	300733	西菱动力	2,300	47,564.00	0.01
2,043	002850	科达利	400	47,524.00	0.01
2,044	002982	湘佳股份	1,100	47,322.00	0.01
2,045	002841	视源股份	800	47,232.00	0.01
2,046	688108	赛诺医疗	8,259	47,158.89	0.01
2,047	300533	冰川网络	1,900	47,101.00	0.01
2,048	603679	华体科技	3,920	46,765.60	0.01
2,049	688016	心脉医疗	244	46,125.76	0.01
2,050	300211	亿通科技	6,300	46,116.00	0.01
2,051	300919	中伟股份	700	45,927.00	0.01
2,052	301086	鸿富瀚	800	45,704.00	0.01
2,053	605077	华康股份	1,500	45,510.00	0.01
2,054	000651	格力电器	1,400	45,248.00	0.01
2,055	002815	崇达技术	4,553	45,120.23	0.01
2,056	300454	深信服	400	45,020.00	0.01
2,057	000717	中南股份	15,390	43,861.50	0.01
2,058	603519	立霸股份	3,966	43,824.30	0.01
2,059	688599	天合光能	687	43,803.12	0.01
2,060	001872	招商港口	3,000	43,080.00	0.01
2,061	300640	德艺文创	7,600	42,560.00	0.01
2,062	601228	广州港	13,500	42,525.00	0.01
2,063	300897	山科智能	1,600	42,192.00	0.01
2,064	600299	安迪苏	5,100	42,126.00	0.01
2,065	600057	厦门象屿	4,100	42,107.00	0.01
2,066	000153	丰原药业	3,100	42,036.00	0.01
2,067	301006	迈拓股份	2,673	41,725.53	0.01
2,068	301166	优宁维	900	41,157.00	0.01

2,069	688229	博睿数据	1,200	40,860.00	0.01
2,070	603102	百合股份	1,000	40,590.00	0.01
2,071	300743	天地数码	3,500	40,495.00	0.01
2,072	603719	良品铺子	1,090	40,188.30	0.01
2,073	301123	奕东电子	1,800	39,438.00	0.01
2,074	301022	海泰科	1,460	39,201.00	0.01
2,075	300741	华宝股份	1,600	37,648.00	0.01
2,076	601138	工业富联	4,100	37,638.00	0.01
2,077	688399	硕世生物	424	37,189.04	0.01
2,078	603901	永创智能	2,300	36,340.00	0.00
2,079	600927	永安期货	2,100	33,852.00	0.00
2,080	601828	美凯龙	7,000	32,830.00	0.00
2,081	688037	芯源微	200	31,300.00	0.00
2,082	688639	华恒生物	200	31,050.00	0.00
2,083	603909	建发合诚	2,899	31,019.30	0.00
2,084	688069	德林海	1,200	30,960.00	0.00
2,085	300943	春晖智控	2,500	30,175.00	0.00
2,086	001227	兰州银行	8,000	30,160.00	0.00
2,087	300972	万辰生物	2,500	30,100.00	0.00
2,088	002773	康弘药业	1,900	29,811.00	0.00
2,089	603408	建霖家居	2,700	29,322.00	0.00
2,090	601908	京运通	4,400	28,908.00	0.00
2,091	600436	片仔癀	100	28,846.00	0.00
2,092	300807	天迈科技	1,400	28,616.00	0.00
2,093	301007	德迈仕	2,600	28,288.00	0.00
2,094	601665	齐鲁银行	6,668	27,805.56	0.00
2,095	601375	中原证券	7,500	27,300.00	0.00
2,096	688222	成都先导	2,021	27,243.08	0.00
2,097	000596	古井贡酒	100	26,690.00	0.00
2,098	300907	康平科技	1,400	25,032.00	0.00
2,099	603083	剑桥科技	2,200	24,728.00	0.00
2,100	603983	丸美股份	700	23,618.00	0.00
2,101	603757	大元泵业	1,200	23,148.00	0.00
2,102	601881	中国银河	2,400	22,296.00	0.00
2,103	300703	创源股份	2,200	21,758.00	0.00
2,104	600600	青岛啤酒	200	21,500.00	0.00
2,105	000425	徐工机械	4,200	21,294.00	0.00
2,106	301119	正强股份	800	21,088.00	0.00
2,107	301070	开勒股份	900	20,952.00	0.00
2,108	605099	共创草坪	900	20,880.00	0.00
2,109	002446	盛路通信	2,150	20,554.00	0.00
2,110	002901	大博医疗	600	20,418.00	0.00
2,111	300546	雄帝科技	900	19,224.00	0.00

2,112	600073	上海梅林	2,400	19,080.00	0.00
2,113	605567	春雪食品	1,200	18,516.00	0.00
2,114	600761	安徽合力	1,400	18,410.00	0.00
2,115	688067	爱威科技	968	18,130.64	0.00
2,116	605060	联德股份	700	18,067.00	0.00
2,117	603283	赛腾股份	600	18,018.00	0.00
2,118	603960	克来机电	1,000	17,730.00	0.00
2,119	002106	莱宝高科	2,300	17,664.00	0.00
2,120	600917	重庆燃气	2,200	17,512.00	0.00
2,121	600919	江苏银行	2,400	17,496.00	0.00
2,122	601117	中国化学	2,200	17,468.00	0.00
2,123	601857	中国石油	3,500	17,395.00	0.00
2,124	600956	新天绿能	1,800	17,352.00	0.00
2,125	002179	中航光电	300	17,328.00	0.00
2,126	688396	华润微	321	16,900.65	0.00
2,127	300298	三诺生物	500	16,865.00	0.00
2,128	000708	中信特钢	977	16,765.32	0.00
2,129	600584	长电科技	726	16,734.30	0.00
2,130	300839	博汇股份	900	16,695.00	0.00
2,131	600426	华鲁恒升	500	16,575.00	0.00
2,132	601899	紫金矿业	1,650	16,500.00	0.00
2,133	000683	远兴能源	2,100	16,464.00	0.00
2,134	688981	中芯国际	400	16,456.00	0.00
2,135	600489	中金黄金	2,000	16,380.00	0.00
2,136	002555	三七互娱	900	16,290.00	0.00
2,137	601669	中国电建	2,300	16,284.00	0.00
2,138	002142	宁波银行	500	16,225.00	0.00
2,139	601616	广电电气	4,700	15,933.00	0.00
2,140	603993	洛阳钼业	3,500	15,925.00	0.00
2,141	603288	海天味业	200	15,920.00	0.00
2,142	002007	华兰生物	700	15,841.00	0.00
2,143	601238	广汽集团	1,414	15,596.42	0.00
2,144	000333	美的集团	300	15,540.00	0.00
2,145	688101	三达膜	1,196	15,464.28	0.00
2,146	603369	今世缘	300	15,270.00	0.00
2,147	688008	澜起科技	241	15,086.60	0.00
2,148	300054	鼎龙股份	700	14,903.00	0.00
2,149	300564	筑博设计	1,260	14,628.60	0.00
2,150	600196	复星医药	400	14,096.00	0.00
2,151	600250	南纺股份	2,400	13,992.00	0.00
2,152	600583	海油工程	2,300	13,938.00	0.00
2,153	688005	容百科技	200	13,750.00	0.00
2,154	688223	晶科能源	927	13,580.55	0.00

2,155	605166	聚合顺	1,100	13,431.00	0.00
2,156	603806	福斯特	200	13,288.00	0.00
2,157	601916	浙商银行	4,500	13,230.00	0.00
2,158	300916	朗特智能	300	12,900.00	0.00
2,159	301079	邵阳液压	700	12,817.00	0.00
2,160	688139	海尔生物	200	12,660.00	0.00
2,161	688228	开普云	400	12,640.00	0.00
2,162	688098	申联生物	1,547	12,283.18	0.00
2,163	002667	鞍重股份	500	11,790.00	0.00
2,164	603713	密尔克卫	100	11,666.00	0.00
2,165	002518	科士达	200	11,520.00	0.00
2,166	600894	广日股份	1,732	11,171.40	0.00
2,167	301085	亚康股份	400	11,144.00	0.00
2,168	002847	盐津铺子	100	10,829.00	0.00
2,169	000700	模塑科技	2,300	10,672.00	0.00
2,170	688013	天臣医疗	547	10,606.33	0.00
2,171	300685	艾德生物	400	10,580.00	0.00
2,172	002073	软控股份	1,700	10,455.00	0.00
2,173	600515	海南机场	1,900	9,538.00	0.00
2,174	603187	海容冷链	300	9,516.00	0.00
2,175	002746	仙坛股份	1,000	9,160.00	0.00
2,176	605588	冠石科技	300	8,640.00	0.00
2,177	002600	领益智造	1,900	8,626.00	0.00
2,178	600779	水井坊	100	8,442.00	0.00
2,179	688011	新光光电	386	8,322.16	0.00
2,180	603090	宏盛股份	300	8,322.00	0.00
2,181	300976	达瑞电子	200	8,304.00	0.00
2,182	003036	泰坦股份	700	8,267.00	0.00
2,183	688569	铁科轨道	469	8,249.71	0.00
2,184	300114	中航电测	800	8,208.00	0.00
2,185	600850	电科数字	400	8,032.00	0.00
2,186	600178	东安动力	1,300	7,852.00	0.00
2,187	688329	艾隆科技	200	7,622.00	0.00
2,188	688030	山石网科	378	7,355.88	0.00
2,189	600697	欧亚集团	515	7,199.70	0.00
2,190	688358	祥生医疗	200	6,880.00	0.00
2,191	603298	杭叉集团	400	6,724.00	0.00
2,192	300765	新诺威	420	6,627.60	0.00
2,193	603111	康尼机电	1,600	6,624.00	0.00
2,194	002615	哈尔斯	1,100	6,622.00	0.00
2,195	600963	岳阳林纸	1,200	6,540.00	0.00
2,196	605138	盛泰集团	600	6,456.00	0.00
2,197	688078	龙软科技	200	6,394.00	0.00

2,198	000030	富奥股份	1,400	6,160.00	0.00
2,199	605086	龙高股份	319	6,131.18	0.00
2,200	600720	祁连山	600	5,958.00	0.00
2,201	688779	长远锂科	400	5,836.00	0.00
2,202	603348	文灿股份	100	5,757.00	0.00
2,203	002583	海能达	1,100	5,621.00	0.00
2,204	688528	秦川物联	538	5,482.22	0.00
2,205	300939	秋田微	200	5,408.00	0.00
2,206	301092	争光股份	200	5,388.00	0.00
2,207	688466	金科环境	351	5,300.10	0.00
2,208	600853	龙建股份	1,400	5,250.00	0.00
2,209	002495	佳隆股份	1,700	5,151.00	0.00
2,210	603266	天龙股份	400	4,960.00	0.00
2,211	605368	蓝天燃气	400	4,940.00	0.00
2,212	603339	四方科技	400	4,884.00	0.00
2,213	603059	倍加洁	243	4,634.01	0.00
2,214	688517	金冠电气	400	4,596.00	0.00
2,215	603871	嘉友国际	200	4,520.00	0.00
2,216	600731	湖南海利	600	4,476.00	0.00
2,217	003033	征和工业	100	4,440.00	0.00
2,218	603633	徕木股份	300	4,371.00	0.00
2,219	603035	常熟汽饰	200	4,250.00	0.00
2,220	002548	金新农	700	4,207.00	0.00
2,221	603399	吉翔股份	300	4,140.00	0.00
2,222	000950	重药控股	800	4,064.00	0.00
2,223	301053	远信工业	200	4,058.00	0.00
2,224	002270	华明装备	500	3,850.00	0.00
2,225	605151	西上海	200	3,790.00	0.00
2,226	300880	迦南智能	248	3,588.56	0.00
2,227	301023	江南奕帆	100	3,585.00	0.00
2,228	300749	顶固集创	500	3,560.00	0.00
2,229	300275	梅安森	300	3,543.00	0.00
2,230	003000	劲仔食品	300	3,537.00	0.00
2,231	601339	百隆东方	600	3,420.00	0.00
2,232	002993	奥海科技	100	3,401.00	0.00
2,233	601808	中海油服	200	3,316.00	0.00
2,234	603230	内蒙新华	300	3,309.00	0.00
2,235	300887	谱尼测试	100	3,261.00	0.00
2,236	300387	富邦股份	500	3,240.00	0.00
2,237	688367	工大高科	200	3,164.00	0.00
2,238	600496	精工钢构	800	3,160.00	0.00
2,239	300963	中洲特材	200	3,036.00	0.00
2,240	600784	鲁银投资	500	3,030.00	0.00

2,241	002533	金杯电工	500	3,025.00	0.00
2,242	603279	景津装备	100	2,948.00	0.00
2,243	301019	宁波色母	150	2,878.50	0.00
2,244	603158	腾龙股份	400	2,836.00	0.00
2,245	300008	天海防务	700	2,751.00	0.00
2,246	301186	超达装备	100	2,714.00	0.00
2,247	600530	交大昂立	700	2,660.00	0.00
2,248	000063	中兴通讯	100	2,586.00	0.00
2,249	601158	重庆水务	500	2,565.00	0.00
2,250	300635	中达安	200	2,528.00	0.00
2,251	003008	开普检测	100	2,456.00	0.00
2,252	000682	东方电子	300	2,412.00	0.00
2,253	001696	宗申动力	400	2,376.00	0.00
2,254	688117	圣诺生物	105	2,333.10	0.00
2,255	301008	宏昌科技	100	2,323.00	0.00
2,256	002976	瑞玛精密	100	2,263.00	0.00
2,257	605287	德才股份	100	2,239.00	0.00
2,258	301083	百胜智能	200	2,208.00	0.00
2,259	300886	华业香料	100	2,179.00	0.00
2,260	300851	交大思诺	100	2,175.00	0.00
2,261	002448	中原内配	400	2,152.00	0.00
2,262	603681	永冠新材	100	2,138.00	0.00
2,263	300906	日月明	100	2,073.00	0.00
2,264	300652	雷迪克	100	2,070.00	0.00
2,265	300061	旗天科技	300	2,007.00	0.00
2,266	300836	佰奥智能	100	2,007.00	0.00
2,267	603096	新经典	100	1,988.00	0.00
2,268	300272	开能健康	368	1,917.28	0.00
2,269	300694	蠡湖股份	200	1,892.00	0.00
2,270	603353	和顺石油	100	1,858.00	0.00
2,271	300155	安居宝	400	1,840.00	0.00
2,272	000426	兴业矿业	300	1,827.00	0.00
2,273	688313	仕佳光子	200	1,810.00	0.00
2,274	002034	旺能环境	100	1,804.00	0.00
2,275	002736	国信证券	200	1,776.00	0.00
2,276	003032	传智教育	100	1,726.00	0.00
2,277	603315	福鞍股份	100	1,710.00	0.00
2,278	300958	建工修复	100	1,702.00	0.00
2,279	605028	世茂能源	100	1,677.00	0.00
2,280	601900	南方传媒	200	1,662.00	0.00
2,281	603322	超讯通信	100	1,630.00	0.00
2,282	600578	京能电力	500	1,625.00	0.00
2,283	603676	卫信康	100	1,592.00	0.00

2,284	000791	甘肃能源	300	1,584.00	0.00
2,285	603050	科林电气	100	1,573.00	0.00
2,286	603511	爱慕股份	100	1,561.00	0.00
2,287	603226	菲林格尔	315	1,552.95	0.00
2,288	300163	先锋新材	500	1,545.00	0.00
2,289	601766	中国中车	300	1,533.00	0.00
2,290	300607	拓斯达	100	1,455.00	0.00
2,291	600179	安通控股	436	1,434.44	0.00
2,292	002963	豪尔赛	100	1,375.00	0.00
2,293	601963	重庆银行	200	1,356.00	0.00
2,294	600123	兰花科创	100	1,334.00	0.00
2,295	002949	华阳国际	100	1,314.00	0.00
2,296	002871	伟隆股份	100	1,313.00	0.00
2,297	603367	辰欣药业	100	1,260.00	0.00
2,298	300582	英飞特	100	1,259.00	0.00
2,299	603776	永安行	100	1,258.00	0.00
2,300	300549	优德精密	100	1,224.00	0.00
2,301	603023	威帝股份	300	1,155.00	0.00
2,302	300507	苏奥传感	200	1,112.00	0.00
2,303	300509	新美星	200	1,100.00	0.00
2,304	300375	鹏翎股份	300	1,059.00	0.00
2,305	002691	冀凯股份	200	1,058.00	0.00
2,306	300484	蓝海华腾	100	1,050.00	0.00
2,307	000885	城发环境	100	947.00	0.00
2,308	603685	晨丰科技	100	940.00	0.00
2,309	603988	中电电机	100	929.00	0.00
2,310	600826	兰生股份	100	919.00	0.00
2,311	600837	海通证券	100	869.00	0.00
2,312	601222	林洋能源	100	859.00	0.00
2,313	002091	江苏国泰	100	850.00	0.00
2,314	000848	承德露露	100	848.00	0.00
2,315	002441	众业达	100	830.00	0.00
2,316	603680	今创集团	100	797.00	0.00
2,317	600807	济南高新	200	680.00	0.00
2,318	300441	鲍斯股份	100	545.00	0.00
2,319	600526	菲达环保	100	539.00	0.00
2,320	600469	风神股份	100	469.00	0.00
2,321	300080	易成新能	100	466.00	0.00
2,322	000966	长源电力	100	463.00	0.00
2,323	601918	新集能源	100	419.00	0.00
2,324	600595	中孚实业	100	300.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601615	明阳智能	26,136,893.78	3.36
2	600188	兖矿能源	24,274,452.65	3.12
3	600256	广汇能源	23,913,655.96	3.08
4	300769	德方纳米	22,677,988.24	2.92
5	300363	博腾股份	22,094,232.54	2.84
6	600348	华阳股份	21,209,384.00	2.73
7	300390	天华超净	20,426,146.00	2.63
8	300037	新宙邦	20,230,861.40	2.60
9	000960	锡业股份	19,519,090.60	2.51
10	000733	振华科技	19,246,435.00	2.48
11	000983	山西焦煤	18,738,281.40	2.41
12	000878	云南铜业	18,612,321.00	2.39
13	002815	崇达技术	18,463,211.33	2.38
14	000301	东方盛虹	17,775,922.00	2.29
15	002182	云海金属	17,709,602.90	2.28
16	688099	晶晨股份	17,704,369.63	2.28
17	603613	国联股份	17,619,387.50	2.27
18	603392	万泰生物	17,425,223.85	2.24
19	002756	永兴材料	17,216,225.00	2.21
20	002738	中矿资源	17,158,807.00	2.21
21	002180	纳思达	17,038,533.00	2.19
22	002497	雅化集团	16,737,617.46	2.15
23	600233	圆通速递	16,621,665.01	2.14
24	600273	嘉化能源	16,612,043.00	2.14
25	000970	中科三环	16,516,489.45	2.12
26	603799	华友钴业	16,446,178.04	2.12
27	000933	神火股份	16,330,371.00	2.10
28	002460	赣锋锂业	16,057,272.00	2.07
29	002258	利尔化学	15,891,392.02	2.04
30	600522	中天科技	15,834,048.00	2.04
31	600584	长电科技	15,751,220.00	2.03
32	600873	梅花生物	15,745,923.00	2.03
33	002407	多氟多	15,713,900.00	2.02
34	600160	巨化股份	15,651,854.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	601615	明阳智能	35,985,136.00	4.63
2	600256	广汇能源	30,192,121.00	3.88
3	000960	锡业股份	26,571,485.00	3.42
4	300037	新宙邦	25,304,181.80	3.26
5	000733	振华科技	24,772,503.48	3.19
6	600188	兖矿能源	24,399,794.00	3.14
7	600348	华阳股份	22,833,255.30	2.94
8	600141	兴发集团	21,933,059.74	2.82
9	300244	迪安诊断	21,639,659.67	2.78
10	300769	德方纳米	21,425,453.08	2.76
11	002738	中矿资源	20,509,152.20	2.64
12	300390	天华超净	19,964,631.67	2.57
13	002709	天赐材料	19,833,577.92	2.55
14	002182	云海金属	19,497,365.91	2.51
15	688099	晶晨股份	19,260,639.04	2.48
16	002815	崇达技术	19,173,861.20	2.47
17	300363	博腾股份	19,160,977.00	2.47
18	600884	杉杉股份	18,605,515.94	2.39
19	002497	雅化集团	18,027,486.72	2.32
20	600089	特变电工	17,804,951.75	2.29
21	600765	中航重机	17,571,070.00	2.26
22	600888	新疆众和	17,516,169.42	2.25
23	000983	山西焦煤	17,502,650.00	2.25
24	600438	通威股份	17,490,208.22	2.25
25	000878	云南铜业	17,410,757.00	2.24
26	000933	神火股份	17,316,407.00	2.23
27	600584	长电科技	17,151,876.58	2.21
28	601699	潞安环能	17,084,650.00	2.20
29	603613	国联股份	17,064,073.30	2.20
30	002129	TCL 中环	16,967,553.00	2.18
31	000970	中科三环	16,931,517.95	2.18
32	600273	嘉化能源	16,919,056.15	2.18
33	000598	兴蓉环境	16,638,155.26	2.14
34	600867	通化东宝	16,615,001.02	2.14
35	600233	圆通速递	16,577,810.00	2.13
36	002539	云图控股	16,535,308.81	2.13
37	002407	多氟多	16,515,225.40	2.12
38	600079	人福医药	16,456,989.00	2.12
39	000937	冀中能源	16,432,581.95	2.11
40	600522	中天科技	16,275,137.00	2.09
41	002756	永兴材料	16,273,511.03	2.09
42	603392	万泰生物	16,270,374.05	2.09
43	002180	纳思达	16,190,368.87	2.08

44	600546	山煤国际	15,896,567.00	2.05
45	601881	中国银河	15,751,533.78	2.03
46	002460	赣锋锂业	15,746,362.00	2.03
47	600873	梅花生物	15,685,648.00	2.02
48	600123	兰花科创	15,580,082.00	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	10,025,567,352.09
卖出股票收入（成交）总额	10,071,134,184.04

注：卖出股票收入（成交）总额中扣除了增值税的影响。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
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	-	-

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

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

	码				(%)
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内无国债期货投资。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

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

无。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,100,750.78
2	应收清算款	6,657,888.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	169,497.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	8,928,136.89

8.12.4 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（%）
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
国海量化优选一年持有股票 A	171	172,405.36	4,987,792.94	16.92	24,493,523.52	83.08
国海量化优选一年持有股票 C	11,288	36,509.46	19,506,685.67	4.73	392,612,122.96	95.27
合计	11,459	38,537.41	24,494,478.61	5.55	417,105,646.48	94.45

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持	国海量化优选一年持有股票 A	500,196.12	2.26
	国海量化优选一年持有股票 C	9,301,279.10	1.70

有本基金			
	合计	9,801,475.22	2.22

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	0
	国海量化优选一年持有股票 C	10~50
	合计	10~50
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	0~10
	国海量化优选一年持有股票 C	0~10
	合计	0~10

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	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。

§ 10 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日) 基金份额总额	61,870,332.78	
本报告期期初基金份额总额	51,286,923.65	393,637,735.03
本报告期基金总申购份额	0.00	111,775,143.79
减：本报告期基金总赎回份额	21,805,607.19	93,294,070.19
本报告期基金拆分变动份额	0.00	0.00
本报告期末基金份额总额	29,481,316.46	412,118,808.63

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人重大人事变动下：

1. 2022 年 1 月 5 日，公司召开第九届董事会第十一次会议，聘任蒋健先生、程明先生为公司副总裁，蒋健先生、程明先生自 2022 年 1 月 5 日起正式履行副总裁职责。

2. 2022 年 9 月 2 日，杨利平先生因个人原因辞去公司副总裁职务。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给上会会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
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，管理人及其高级管理人员未因资产管理业务受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	-

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	2	20,096,701,536.13	100.00	6,665,463.61	100.00	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国海证	-	-	1,480,000,00	100.00	-	-

券			0.00		
---	--	--	------	--	--

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海证券股份有限公司关于增加度小满基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 1 月 11 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 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2022 年 1 月 24 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 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2022 年 1 月 24 日
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	2022 年 2 月 21 日
5	国海证券股份有限公司关于增加中信银行为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 2 月 21 日
6	国海证券股份有限公司关于增加中植基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 3 月 24 日
7	国海证券股份有限公司关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划参加兴业银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 3 月 25 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 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2022 年 3 月 31 日
9	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2021 年年度报告	中国证监会规定网站	2022 年 3 月 31 日
10	关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2021 年年度报告的更正公告	中国证监会规定网站	2022 年 4 月 13 日
11	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 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2022 年 4 月 22 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 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2022 年 4 月 22 日

13	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	2022 年 5 月 11 日
14	国海证券股份有限公司关于终止与北京植信基金销售有限公司销售合作关系的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 5 月 13 日
15	国海证券股份有限公司关于增加新浪仓石基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 5 月 19 日
16	国海证券股份有限公司关于增加华夏银行为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 5 月 20 日
17	国海证券股份有限公司关于增加徽商期货为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 6 月 10 日
18	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 2022 年第 2 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2022 年 7 月 21 日
19	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2022 年第 2 季度报告	中国证监会规定网站	2022 年 7 月 21 日
20	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经理变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 7 月 21 日
21	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更新	中国证监会规定网站	2022 年 7 月 21 日
22	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022 年 7 月 21 日
23	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022 年 7 月 21 日
24	国海证券股份有限公司关于增加华润银行为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 8 月 10 日
25	国海证券股份有限公司关于增加腾安基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 8 月 12 日
26	国海证券量化优选一年持有期股票型	中国证监会规定报刊及	2022 年 8 月 15 日

	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	规定网站	
27	国海证券股份有限公司关于增加好买基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 8 月 17 日
28	国海证券股份有限公司关于增加东方财富为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 8 月 19 日
29	国海证券股份有限公司关于增加东方财富为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告(更正稿)	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 8 月 19 日
30	国海证券股份有限公司关于增加东证期货为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 8 月 24 日
31	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 2022 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2022 年 8 月 31 日
32	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2022 年中期报告	中国证监会规定网站	2022 年 8 月 31 日
33	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	2022 年 9 月 8 日
34	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经理变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 10 月 19 日
35	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(A类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022 年 10 月 19 日
36	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(C类份额)基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2022 年 10 月 19 日
37	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更新	中国证监会规定网站	2022 年 10 月 19 日
38	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 2022 年第 3 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2022 年 10 月 26 日
39	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2022 年第 3 季度报告	中国证监会规定网站	2022 年 10 月 26 日
40	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	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 11 月 15 日

	(赎回、转换、定期定额) 投资业务公告		
41	国海证券股份有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 12 月 16 日
42	国海证券股份有限公司关于增加万得基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2022 年 12 月 19 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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							
-							

注：本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会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。

13.2 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

13.3 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

2023 年 3 月 31 日