

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置 混合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：上海光大证券资产管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会及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责任。

集合计划托管人广发银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。投资需谨慎，敬请投资者注意投资风险。投资者欲了解本集合计划的详细情况，请于投资集合计划前认真阅读集合计划的产品合同、更新的招募说明书等法律文件以及相关业务公告。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)为本集合计划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 2022 年 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	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	10
3.3 其他指标	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况	14
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
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	18
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	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	19
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	19
§ 6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§ 7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	27

§ 8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
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	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	96
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	97
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	97
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	98
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	98
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	98
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	98
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	98
8.12 市场中性策略执行情况	98
8.13 投资组合报告附注	98
§ 9 基金份额持有人信息	100
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	100
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	101
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	101
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	101
§ 10 开放式基金份额变动	101
§ 11 重大事件揭示	102
11.1 基金份额持有人大会决议	102
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	102
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	102
11.4 基金投资策略的改变	102
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	102
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	102
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	102
11.8 其他重大事件	103
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	104
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	104
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	105
§ 13 备查文件目录	105
13.1 备查文件目录	105
13.2 存放地点	105
13.3 查阅方式	105

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划		
基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合		
基金主代码	860010		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2020 年 3 月 25 日		
基金管理人	上海光大证券资产管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	306,720,352.78 份		
基金合同存续期	3 年		
下属分级基金的基金简称	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	860010	860028	860029
报告期末下属分级基金的份额总额	2,615,678.28 份	37,128,843.54 份	266,975,830.96 份

注：本报告中所述的“基金”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	通过深入研究，捕捉宏观环境及政策趋势走向，灵活精选投资策略，在合理控制投资风险和保障集合计划资产流动性的基础上，追求集合计划资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本集合计划主要采用对冲套利的投资策略。通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，并使用股指期货进行对冲操作，有效规避市场涨跌的系统性风险，获取选股的超额收益。力争实现集合计划资产长期稳健的绝对收益。另通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，综合配置固定收益等各类资产，以实现整体资产的稳健增值。</p> <p>（一）股票投资策略</p> <p>本集合计划主要通过数量化投资模型，选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。数量化投资模型的投资逻辑基于学术研究、投资实践中被普遍接受的选股因子构建对于个股的收益进行预测，因子包括价值、质量、成长、事件驱动、市场等大类。通过现代组合管理的数量化模型进行组合构建，优化系统风险及个股特定风险的最优配比。</p> <p>对于因子的选取，我们的方法论是自上而下的投资逻辑，首先保证其在经济学、金融学、行为金融学上的意义，判断其符合当前的经济和市场环境，然后再重点关注因子的稳定性、解释性、统计显著性。力求甄选出基本面绩优、在行业内有竞争优势、当前具有估值机会、具备核心成长潜力等方面的优秀上市公司。</p>

	<p>(二) 金融衍生工具对冲策略</p> <p>本集合计划在通过以上股票投资策略的基础上, 使用股指期货对冲组合的系统性风险, 从而分离出组合的超额收益。根据风险管理的原则, 以套期保值为目的, 在风险可控的前提下, 本着谨慎原则, 参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素, 在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作, 以提升组合收益和套期保值的效果。随着其他金融衍生工具的发展, 本集合计划会考虑使用法律法规允许范围内的其他对冲工具, 例如融券卖空、期权等。通过优选对冲工具, 提高管理市场风险的能力。</p> <p>(三) 融券投资策略</p> <p>本集合计划在投资机会和融券成本合适的情况下, 采用融券的方式进行配对交易。通过多因子模型, 可以找到行业、风格相近的股票之间存在的理论价差, 通过买入低价股、融券卖空高价股获得绝对收益。</p> <p>(四) 其他绝对收益投资策略</p> <p>包括: (1) 普通债券投资策略; (2) 可转债投资策略; (3) 衍生品投资策略; (4) 一级市场申购策略; (5) 现金类资产投资策略。</p> <p>(五) 资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析, 并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型, 评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p>
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期 1 年期银行定期存款基准利率(税后)+1%。
风险收益特征	本集合计划为混合型集合计划, 其预期风险和预期收益高于债券型基金、债券型集合计划、货币市场基金和货币型集合资产管理计划, 低于股票型基金和股票型集合计划。

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		上海光大证券资产管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱轶	顾洪峰
	联系电话	021-32068300	010-65169885
	电子邮箱	zhuyi1@ebscn.com	guhongfeng@cgbchina.com.cn
客户服务电话	95525	4008308003	
传真	021-32068585	010-65169555	
注册地址	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	广东省广州市越秀区东风东路 713 号	
办公地址	中国(上海)自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层	北京市东城区东长安街甲 2 号广发银行大厦	
邮政编码	200127	100005	
法定代表人	熊国兵	王凯	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
----------------	---------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ebscn-am.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	上海光大证券资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 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 1.1 期间 数据 和 指标	2022 年			2021 年			2020 年 3 月 25 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日		
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	-34,051.32	-311,087.50	-3,657,553.92	66,535.21	439,706.37	16,292,014.09	1,383,727.22	17,419,595.83	-33,747,924.99
本期利润	-41,322.05	-410,143.67	-4,565,067.85	-29,115.70	-469,303.60	-5,246,947.28	1,298,107.23	14,470,937.08	-8,107,947.64
加权平均基金份额本	-0.0148	-0.0107	-0.0138	-0.0056	-0.0093	-0.0046	0.0517	0.0699	-0.0118

期利润										
本期加权平均净值利润率	-1.42%	-1.04%	-1.35%	-0.52%	-0.88%	-0.43%	4.91%	6.73%	-1.12%	
本期基金份额净值增长率	-1.56%	-1.06%	-1.46%	-2.58%	-2.09%	-2.49%	5.26%	5.69%	5.40%	
3.1 3.2 期末数据和指标	2022 年末			2021 年末			2020 年末			
期末可供分配利润	83,279.89	883,011.15	3,416,609.95	149,883.52	1,385,437.81	12,265,709.60	713,477.98	4,380,840.47	98,592,478.69	
期末可	0.0318	0.0238	0.0128	0.0481	0.0348	0.0278	0.0759	0.0569	0.0540	

供分配基金份额利润									
期末基金资产净值	2,698,958.17	38,011,854.69	270,392,440.91	3,262,849.94	41,228,688.70	453,590,235.00	10,109,057.82	81,427,123.27	1,924,795,313.78
期末基金份额净值	1.0318	1.0238	1.0128	1.0481	1.0348	1.0278	1.0759	1.0569	1.0540
3.1.3 累计期末指标	2022 年末			2021 年末			2020 年末		
基金份额累计净值增长率	0.95%	2.38%	1.28%	2.54%	3.48%	2.78%	5.26%	5.69%	5.40%

注：1、表中的“期末”均指报告期最后一日，即 12 月 31 日；“本期”指 2022 年 1 月 1 日-2022

年 12 月 31 日。

2、上述集合计划业绩指标不包括持有人认购或交易集合计划的各项费用（例如，集合计划的申购赎回费、集合计划转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、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）。

5、B 类、C 类份额设立日均为 2020 年 3 月 25 日。

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

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.65%	0.20%	0.63%	0.01%	-1.28%	0.19%
过去六个月	-1.82%	0.22%	1.27%	0.01%	-3.09%	0.21%
过去一年	-1.56%	0.22%	2.53%	0.01%	-4.09%	0.21%
自基金合同生效起至今	0.95%	0.26%	7.18%	0.01%	-6.23%	0.25%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

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	-0.52%	0.20%	0.63%	0.01%	-1.15%	0.19%
过去六个月	-1.56%	0.22%	1.27%	0.01%	-2.83%	0.21%
过去一年	-1.06%	0.22%	2.53%	0.01%	-3.59%	0.21%
自基金合同生效起至今	2.38%	0.26%	7.18%	0.01%	-4.80%	0.25%

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	-0.62%	0.20%	0.63%	0.01%	-1.25%	0.19%
过去六个月	-1.77%	0.22%	1.27%	0.01%	-3.04%	0.21%
过去一年	-1.46%	0.22%	2.53%	0.01%	-3.99%	0.21%
自基金合同生效 起至今	1.28%	0.26%	7.18%	0.01%	-5.90%	0.25%

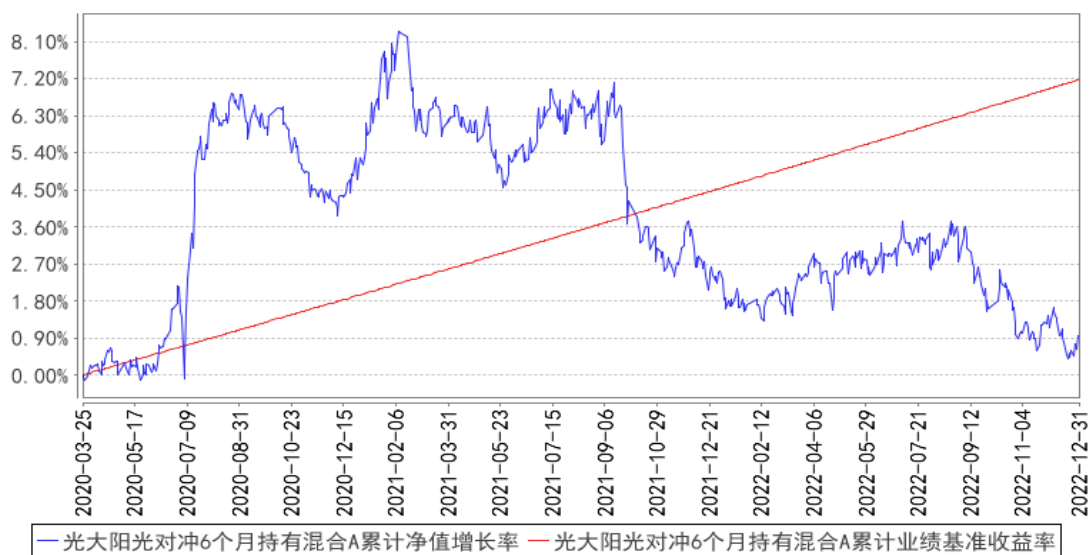
注：1、自基金合同生效日起至今指2020年3月25日至2022年12月31日；

2、业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期1年期银行定期存款基准利率（税后）+1%；

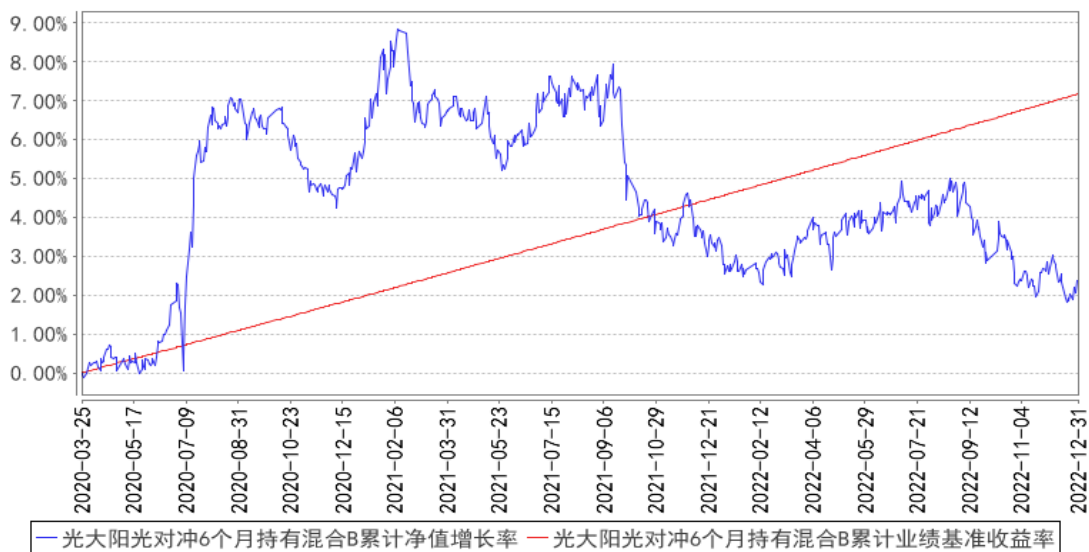
3、B类、C类份额设立日均为2020年3月25日。

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

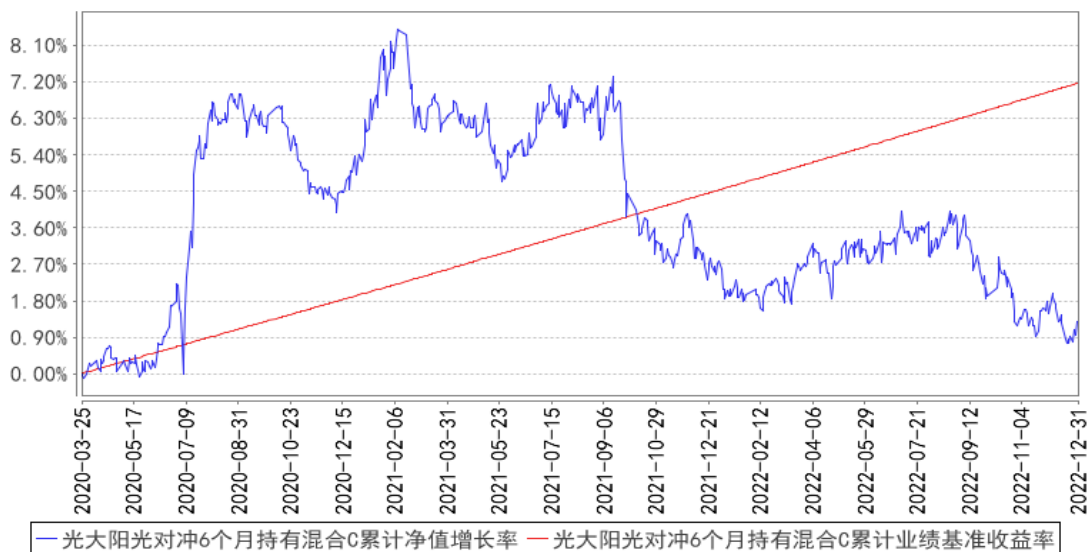
光大阳光对冲6个月持有混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



光大阳光对冲**6**个月持有混合**B**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

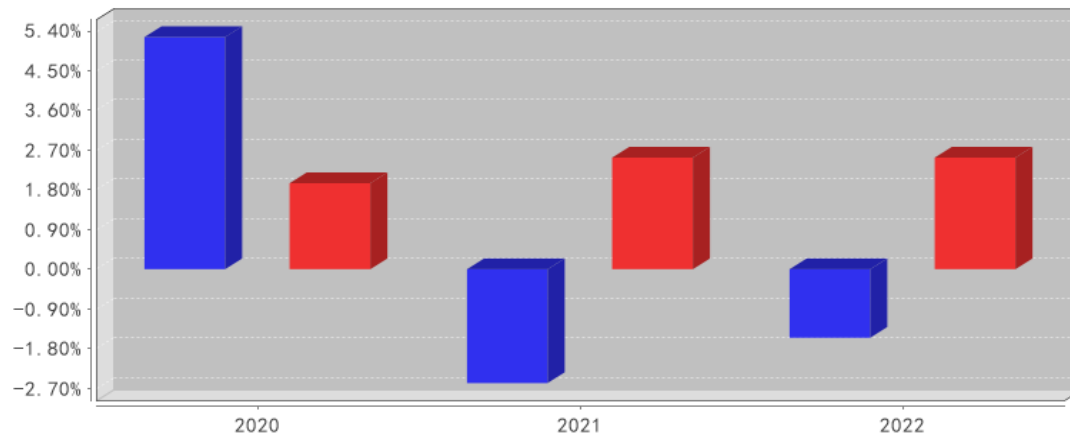


光大阳光对冲**6**个月持有混合**C**累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



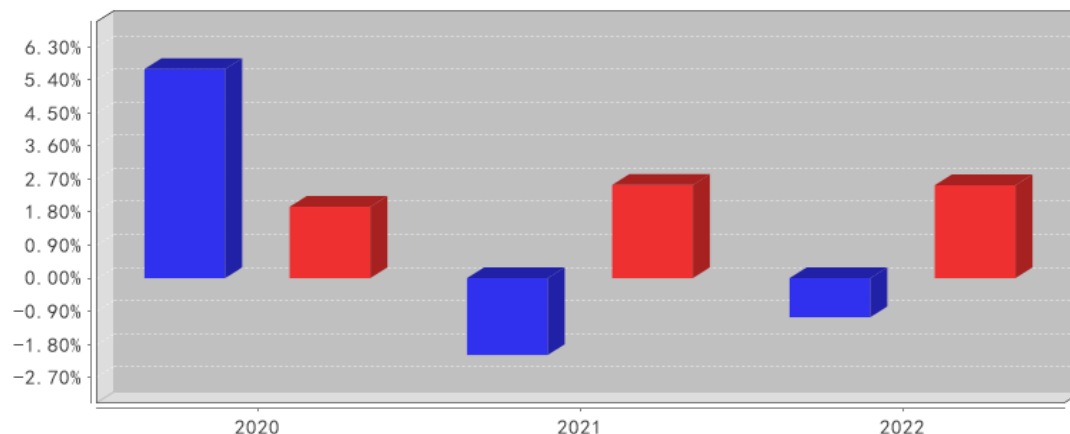
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大阳光对冲6个月持有混合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



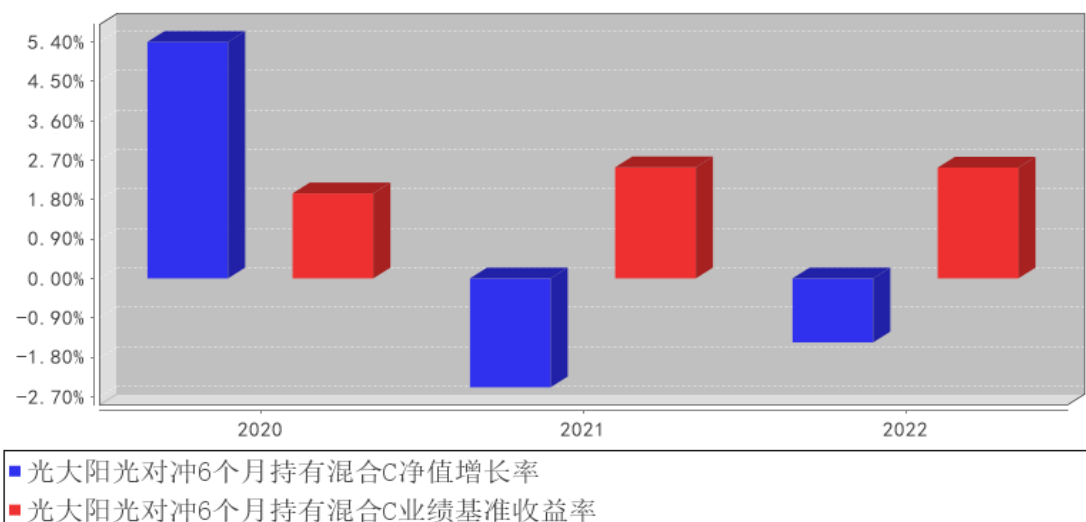
- 光大阳光对冲6个月持有混合A净值增长率
- 光大阳光对冲6个月持有混合A业绩基准收益率

光大阳光对冲6个月持有混合B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



- 光大阳光对冲6个月持有混合B净值增长率
- 光大阳光对冲6个月持有混合B业绩基准收益率

光大阳光对冲6个月持有混合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



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

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	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	-	-	-	-	-
2020 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本集合计划过去三年未进行利润分配。

§ 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

上海光大证券资产管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）成立于2012年5月9日，前身为原光大证券股份有限公司资产管理总部，承继了光大证券的客户资产管理业务与资格。2002年5月14日，中国证券监督管理委员会核发证监机构字[2002]127号《关于核准光大证券有限责任公司受托投资管理业务资格的批复》，同意光大证券从事客户资产管理业务。2011年11月23日，中国证券监督管理委员会核发证监许可[2011]1886号《关于核准光大证券股份有限公司设立证券资产管理子公司的批复》，同意光大证券设立资产管理子公司并核准公司章程。2012年2月21日，公司在上海市工商行政管理局登记注册，注册资本2亿元，光大证券持股100%。

截至2022年12月末，本公司共管理16只参照开放式证券投资基金管理的集合计划，公司在投资、风险控制等方面积累了丰富经验。

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		
李禄俊	量化公募投资部副总经理、本集合计划投资经理	2020年3月25日	-	7年	李禄俊先生，本硕均毕业于北京大学，曾在中金基金管理公司量化投资部任职，2018年加入光证资管，现任量化公募投资部副总经理。
陈延庆	量化公募投资部投资经理、本集合计划投资经理	2022年07月01日	-	7年	陈延庆先生，研究生毕业于纽约大学应用数学专业，历任中金基金量化研究员，量化专户投资经理，中信建投基金量化研究负责人，量化专户投资经理。2021年加入光证资管，现任量化公募投资部投资经理。

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定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

本集合计划投资经理本报告期末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

本集合计划投资经理本报告期末未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本集合计划管理人严格遵守《证券投资基金法》等法律法规、中国证监会的有关规定以及集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划运作合规，不存在违反集合计划合同和损害集合计划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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《上海光大证券资产管理有限公司公平交易与利益冲突防范管理办法》，将公司已经管理、未来可能管理的所有公募及私募资产管理产品的投资组合等不同资产组合参与的投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节均纳入公平交易管理，在业务流程和岗位职责中制定公平交易的控制规则和控制活动，建立对公平交易的执行、监督及审核流程，严禁在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人一贯公平的对待旗下管理的所有产品，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。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》与《上海光大证券资产管理有限公司公平交易与利益冲突防范管理办法》。

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

本集合计划投资经理本报告期末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

报告期内，本集合计划未发生违法违规且对集合计划财产造成损失的异常交易行为。本报告期内未发生管理人管理的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超过该证券当日成交量的5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本产品的投资逻辑是通过量化模型选择盈利优质的上市公司，并结合估值、成长和价量因子等选股模型甄选出胜率较高的个股组合，对冲股指期货以获得绝对收益，再通过配置股票多头、

转债等子策略以分散投资风险。

2022 年本产品运作主要分为三部分：转债策略、股债多头和对冲策略。报告期内转债市场的整体溢价率较高，因此全年维持转债较低的配置比例，直到四季度转债市场溢价率好转后，开始逐渐加仓超跌的转债个券。股票多头部分的持仓均为低估值标的，板块分布以金融、基建等稳增长板块为主，尤其偏重估值有吸引力的高股息蓝筹股。量化对冲策略和多头持股的风格暴露互为平衡，量化选股相对更偏重高成长属性的制造业和创业板企业。下半年量化对冲策略新加入机器学习的预测模型，该模型在中证 1000 成分股内选股，使用中证 1000 股指期货进行对冲，和传统模型的相关性较低，起到了分散投资风险的效果。对于产品层面，使用组合优化器等工具控制板块和大类风格的整体暴露水平，以保持在高波动市场环境下的稳定表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型 A 类份额净值为 1.0318 元，本报告期份额净值增长率为-1.56%；光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型 B 类份额净值为 1.0238 元，本报告期份额净值增长率为-1.06%；光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型 C 类份额净值为 1.0128 元，本报告期份额净值增长率为-1.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年全球经济衰退的风险在加剧，美联储会维持积极加息，其他主要市场波动仍然很大。中国是唯一一个在低通胀压力下保持宽松政策的国家，以通过增长的政策来促进经济发展。二十大后推出了三轮房地产政策支持，再加上新冠政策调整，市场情绪逐步改善。可以预见 2023 年伴随积极的财政政策和清晰的经济发展策略陆续出台，政策制定者将继续专注于振兴经济，投资于长期领域，如先进技术本地化、可再生能源和 5G 等基础设施；货币和财政政策将保持宽松，为一直处于压力下的经济发展提供支持。选股上继续优选有基本面支撑的优秀公司，一类是经营稳健、估值合理的龙头价值型企业，他们有能力真正获得整个行业发展的红利；另一类是能力突出、发展空间巨大的成长型公司，需要尽力挖掘并为这种成长性付出适当的溢价。

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，管理人继续完善内部控制、提升风险管理水平，着重开展了以下各项工作：

1、继续完善内部控制体系

公司根据法律法规、监管要求及业务发展需求，不断优化现有的标准化业务流程体系，强调业务流程服务于加强风险防范和提升运营效率，通过信息技术手段持续提升业务操作的系统化程度，并不断优化。

2、持续改进投资监控的方法与手段，保证集合计划投资业务的合法合规性

报告期内，在投资日常合规监控工作方面，公司根据法律法规和产品特点进一步完善了投资监控系统以提升投资监控效率；在实现交易价差分析、银行间交易分析、研究报告检查等专项检查工作定期化、日常化的基础上，公司加强了内幕交易风险的检查和防范，多次开展有关内幕交易的合规培训，进一步强化全体投研人员对内幕交易行为和结果的认识。

3、规范集合计划销售业务，保证集合计划销售业务的合法合规性

报告期内，在集合计划持续营销活动中，公司严格规范销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《公开募集证券投资基金宣传推介材料管理暂行规定》及相关法规规定审查宣传推介材料，逐步落实反洗钱法律法规各项要求，并督促销售部门做好投资者教育工作，本报告期内没有出现主动违规行为。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和集合计划合同的约定，对集合计划所持有的投资品种进行估值，本集合计划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。集合计划份额净值由集合计划管理人完成估值后，经集合计划托管人复核无误后由集合计划管理人对外公布。本集合计划管理人对投资品种进行估值时原则上应保持估值程序和技术的一致性，对旗下管理的不同产品持有的具有相同特征的同一投资品种的估值调整原则、程序及技术应当一致（中国证监会规定的特殊品种除外）。为了保障集合计划能真实、准确地反映投资品种的公允价值，本集合计划管理人授权估值委员会负责建立健全估值决策体系，估值委员会成员的任命和调整由总经理办公会审议决定。运营保障部是估值委员会的日常办事机构，负责关注相关投资品种的动态，确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种，并提交估值委员会审议。运营保障部的估值人员均具有专业会计学习经历，具有基金从业资格。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本集合计划报告期内未进行利润分配。

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，本集合计划未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满二百人或者集合计划资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划（以下称“本集合计划”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、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	安永华明（2023）审字第 61263195_B07 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	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划
审计意见	我们审计了光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 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

	<p>业道德守则，我们独立于光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划，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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</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>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划的财务报告过程。</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) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理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光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	赵英	魏欢欢
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12	
审计报告日期	2023 年 3 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合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	13,222,574.40	20,675,583.61
结算备付金		24,889,194.26	35,682,420.12
存出保证金		23,127,903.63	20,153,603.81
交易性金融资产	7.4.7.2	246,821,815.92	437,331,324.93
其中：股票投资		184,793,787.97	206,821,340.82
基金投资		-	-
债券投资		62,028,027.95	225,582,484.11
资产支持证券投资		-	4,927,500.00
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	7,998,513.70	20,000,000.00
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		128,779.80	5,816,187.82
应收股利		-	-
应收申购款		2,500.00	21,920.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	2,690,399.47
资产总计		316,191,281.71	542,371,439.76
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		3,357,407.22	-
应付赎回款		451,911.94	2,339,008.95
应付管理人报酬		268,610.02	442,982.11
应付托管费		53,492.73	88,318.73
应付销售服务费		93,149.85	161,396.67
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2,349.05	317.46
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	861,107.13	41,257,642.20
负债合计		5,088,027.94	44,289,666.12
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	306,720,352.78	484,280,742.71
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	4,382,900.99	13,801,030.93
净资产合计		311,103,253.77	498,081,773.64
负债和净资产总计		316,191,281.71	542,371,439.76

注：1、报告截止日 2022 年 12 月 31 日，本集合计划份额总额 306,720,352.78 份，其中光大阳光对冲 6 个月持有混合 A 集合计划份额总额 2,615,678.28 份，集合计划份额净值 1.0318 元；光大阳光对冲 6 个月持有混合 B 集合计划份额总额 37,128,843.54 份；集合计划份额净值 1.0238 元。光大阳光对冲 6 个月持有混合 C 集合计划份额总额 266,975,830.96 份，集合计划份额净值 1.0128 元。

2、比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年度末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目

的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年度末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：光大阳光对冲策略6个月持有期灵活配置混合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1月1日至2021 年12月31日
一、营业总收入		1,181,877.51	37,356,837.74
1. 利息收入		733,427.99	14,970,533.81
其中：存款利息收入	7.4.7.13	425,852.91	1,909,629.34
债券利息收入		-	5,484,818.99
资产支持证券利息收入		-	5,774,111.25
买入返售金融资产收入		307,575.08	1,801,974.23
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,462,228.24	44,929,926.18
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-34,503,592.30	98,956,548.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,773,573.05	5,899,655.80
资产支持证券投资	7.4.7.16	34,689.00	2,521,777.70
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	29,783,807.59	-74,116,177.56
股利收益	7.4.7.19	4,373,750.90	11,668,121.80
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	-1,013,840.83	-22,543,622.25
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	62.11	-
减：二、营业总支出		6,198,411.08	43,102,204.32

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,846,664.46	12,839,057.07
2. 托管费	7.4.10.2.2	766,406.28	2,562,195.60
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,362,852.89	4,886,987.19
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		183.57	-
其中：卖出回购金融资产支出		183.57	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		26,224.79	1,703,387.16
8. 其他费用	7.4.7.23	196,079.09	21,110,577.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-5,016,533.57	-5,745,366.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-5,016,533.57	-5,745,366.58
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,016,533.57	-5,745,366.58

注：比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合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、上期期末净资产(基金净值)	484,280,742.71	-	13,801,030.93	498,081,773.64
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期	484,280,742.71	-	13,801,030.93	498,081,773.64

期初净资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-177,560,389.93	-	-9,418,129.94	-186,978,519.87
(一)、综合收益总额	-	-	-5,016,533.57	-5,016,533.57
(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)	-177,560,389.93	-	-4,401,596.37	-181,961,986.30
其中:1.基金申购款	2,547,462.67	-	56,804.75	2,604,267.42
2.基金赎回款	-180,107,852.60	-	-4,458,401.12	-184,566,253.72
(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)	306,720,352.78	-	4,382,900.99	311,103,253.77
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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)	1,912,644,697.73	-	103,686,797.14	2,016,331,494.87
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)	1,912,644,697.73	-	103,686,797.14	2,016,331,494.87
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,428,363,955.02	-	-89,885,766.21	-1,518,249,721.23
(一)、综合收益总额	-	-	-5,745,366.58	-5,745,366.58
(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)	-1,428,363,955.02	-	-84,140,399.63	-1,512,504,354.65
其中:1.基金申购款	635,155,558.63	-	43,900,854.06	679,056,412.69

2 . 基金赎回款	-2,063,519,513.65	-	-128,041,253.69	-2,191,560,767.34
(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)	484,280,742.71	-	13,801,030.93	498,081,773.64

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：

常松

基金管理人负责人

詹朋

主管会计工作负责人

杨薇

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划是由光大阳光稳健添利集合资产管理计划转型而来。本集合计划管理人上海光大证券资产管理有限公司于 2020 年 3 月 17 日发布《光大阳光稳健添利集合资产管理计划合同变更公告》。根据公告，光大阳光稳健添利集合资产管理计划名称变更为“光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划”，光大阳光稳健添利集合资产管理计划份额转换为光大阳光对冲 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 A 类份额。合同变更后，本集合计划的托管人，登记机构不变。自 2020 年 3 月 25 日起

6个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》生效。本集合计划自资产管理合同变更生效之日起存续期不得超过3年。本集合计划管理人为上海光大证券资产管理有限公司，托管人为广发银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《光大阳光对冲6个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》，本集合计划的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或同意注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券（含超短期融资券）、公司债、中期票据、可交换债券、可转换债券（含可分离可转换债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合计划可以参与融券业务。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：股票资产占集合计划资产的比例为0%-95%；投资银行存款和同业存单合计占比不超过集合计划资产的20%；本集合计划权益类多头头寸价值减去权益类空头头寸价值，占集合计划资产净值比例范围0-10%。其中，权益类多头头寸价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合正风险敞口暴露价值及其他权益类工具多头价值的合计值。权益类空头头寸价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值、其他权益类衍生工具组合负风险敞口暴露价值及其他权益类工具空头价值的合计值；每个交易日日终，持有的买入股指期货合约价值和持有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于集合计划资产净值的5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本集合计划投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。本集合计划的业绩比较基准为：中国人民银行公布的同期1年期银行定期存款基准利率（税后）+1%。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

1、金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

2、金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本集合计划以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本集合计划运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本集合计划在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本集合计划按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本集合计划按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本集合计划在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本集合计划以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本集合计划计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本集合计划不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本集合计划直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了

对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

每个资产负债表日，本集合计划对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本集合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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

2、不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息

支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

3、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于申购确认日及赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括转换所引起的转入实收基金增加和转出实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

1、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；

3、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内含票面利率或合同利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；

4、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；

5、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；

6、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；

7、买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

8、公允价值变动收益系本集合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；

9、其他收入在本集合计划履行了集合计划合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本集合计划接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可进行收益分配；

2、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，由红利再投资而来的 B 类或 C 类份额不受锁定持有期的限制，再投资份额的持有期与原份额相同；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；

3、集合计划收益分配后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集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

5、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

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

- 1、该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- 2、本集合计划的集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- 3、本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- 1、对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

- 2、于2017年10月23日前，对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。自2017年10月23日起，对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

- 3、对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)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、资产支持证券和私募债券除外)，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债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法规的要求，本集合计划自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本集合计划考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本集合计划的影响不重大。

本集合计划将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本集合计划计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本集合计划将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,675,583.61 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 4,908.32 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,680,491.93 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 35,682,420.12 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,098.60 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人

人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 35,684,518.72 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,153,603.81 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 305.20 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 20,153,909.01 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,690,399.47 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 4,908.32 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 2,098.60 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 305.20 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 2,683,087.35 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至应收申购款的重分类金额为人民币 0.00 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 0.00 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 437,331,324.93 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,683,087.35 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 440,014,412.28 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 0 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 0 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 0 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本集合计划金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本集合计划本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

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

1、资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

3、对集合计划取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向集合计划支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对集合计划从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对集合计划持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁

日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4、集合计划卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

5、本集合计划的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

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
活期存款	13,222,574.40	20,675,583.61
等于：本金	13,220,310.59	20,675,583.61
加：应计利息	2,263.81	-
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	13,222,574.40	20,675,583.61

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	189,240,053.50	-	184,793,787.97	-4,446,265.53	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	31,490,966.40	72,927.77	31,254,444.39	-309,449.78
	银行间市场	30,187,728.22	635,583.56	30,773,583.56	-49,728.22
	合计	61,678,694.62	708,511.33	62,028,027.95	-359,178.00
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	250,918,748.12	708,511.33	246,821,815.92	-4,805,443.53	
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	207,624,474.70	-	206,821,340.82	-803,133.88	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	43,249,357.76	-	43,921,484.11	672,126.35
	银行间市场	180,380,890.00	-	181,661,000.00	1,280,110.00
	合计	223,630,247.76	-	225,582,484.11	1,952,236.35
资产支持证券	4,927,500.00	-	4,927,500.00	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	436,182,222.46	-	437,331,324.93	1,149,102.47	

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	-171,028,849.28	-	-	-
其中：股指期货投资	-171,028,849.28	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-171,028,849.28	-	-	-
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	-160,946,784.11	-	-
其中：股指期货投资	-160,946,784.11	-	-
其他衍生工具	-	-	-
合计	-160,946,784.11	-	-

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

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
IC2301	IC2301	-14.00	-16,448,880.00	655,040.00
IC2303	IC2303	-18.00	-21,147,840.00	813,200.00
IF2303	IF2303	-22.00	-25,767,720.00	-655,851.43
IF2306	IF2306	-27.00	-31,551,120.00	-817,579.29
IM2301	IM2301	-12.00	-15,078,720.00	880,360.00
IM2302	IM2302	-1.00	-1,253,120.00	-23,360.00
IM2303	IM2303	-45.00	-56,188,800.00	2,740,840.00
合计				3,592,649.28
减：可抵销期货暂收款				3,592,649.28
净额				-

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

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	7,998,513.70	-
银行间市场	-	-

合计	7,998,513.70	-
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	20,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	20,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末及上年度末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

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

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

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	-	2,690,399.47
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	2,690,399.47

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	721,107.13	1,130,802.20
其中：交易所市场	721,107.13	1,129,102.20
银行间市场	-	1,700.00
应付利息	-	-
预提费用	140,000.00	153,000.00
其他	-	39,973,840.00
合计	861,107.13	41,257,642.20

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	3,112,966.42	3,112,966.42
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-497,288.14	-497,288.14
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	2,615,678.28	2,615,678.28

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

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	39,843,250.89	39,843,250.89
本期申购	3,314.20	3,314.20
本期赎回（以“-”号填列）	-2,717,721.55	-2,717,721.55
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	37,128,843.54	37,128,843.54

光大阳光对冲 6 个月持有混合 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	441,324,525.40	441,324,525.40
本期申购	2,544,148.47	2,544,148.47
本期赎回（以“-”号填列）	-176,892,842.91	-176,892,842.91
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	266,975,830.96	266,975,830.96

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

光大阳光对冲 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	464,787.24	-314,903.72	149,883.52
本期利润	-34,051.32	-7,270.73	-41,322.05
本期基金份额交易产生的变动数	-25,886.37	604.79	-25,281.58
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-25,886.37	604.79	-25,281.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	404,849.55	-321,569.66	83,279.89

光大阳光对冲 6 个月持有混合 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	2,320,976.21	-935,538.40	1,385,437.81
本期利润	-311,087.50	-99,056.17	-410,143.67
本期基金份额交易产生的变动数	-99,453.48	7,170.49	-92,282.99
其中：基金申购款	107.05	-12.73	94.32
基金赎回款	-99,560.53	7,183.22	-92,377.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,910,435.23	-1,027,424.08	883,011.15

光大阳光对冲 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	22,336,881.11	-10,071,171.51	12,265,709.60
本期利润	-3,657,553.92	-907,513.93	-4,565,067.85
本期基金份额交易产生的变动数	-8,119,408.09	3,835,376.29	-4,284,031.80
其中：基金申购款	116,117.17	-59,406.74	56,710.43

基金赎回款	-8,235,525.26	3,894,783.03	-4,340,742.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,559,919.10	-7,143,309.15	3,416,609.95

7.4.7.13 存款利息收入

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1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	198,716.49	455,933.78
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	222,154.83	1,429,931.00
其他	4,981.59	23,764.56
合计	425,852.91	1,909,629.34

注：其他为交易所结算保证金、直销申购款利息收入。

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1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-34,503,592.30	98,956,548.44
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	-34,503,592.30	98,956,548.44

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1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	2,373,245,004.96	8,115,431,916.35
减：卖出股票成本总额	2,402,918,838.58	8,016,475,367.91

减：交易费用	4,829,758.68	-
买卖股票差价收入	-34,503,592.30	98,956,548.44

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无股票证券出借差价收入。

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1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	2,912,580.61	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,139,007.56	5,899,655.80
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,773,573.05	5,899,655.80

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1月1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	419,477,898.62	637,616,744.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	415,131,646.67	624,409,135.46
减：应计利息总额	5,471,111.25	7,307,953.10
减：交易费用	14,148.26	-
买卖债券差价收入	-1,139,007.56	5,899,655.80

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无债券申购差价收入。

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1月1日至2021年12月31 日
资产支持证券投资收益——利息收入	34,689.00	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	2,521,777.70
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	34,689.00	2,521,777.70

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 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出资产支持证券成交总额	4,962,770.23	219,092,666.48
减：卖出资产支持证券成本总额	4,927,500.00	208,572,500.00
减：应计利息总额	35,270.23	7,998,388.78
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	2,521,777.70

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无资产支持证券赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无资产支持证券申购差价收入。

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未进行贵金属投资。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无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

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期及上年度可比期间无贵金属申购差价收入。

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间无买卖权证差价收入。

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	29,783,807.59	-74,116,177.56

7.4.7.19 股利收益

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1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,373,750.90	11,668,121.80
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	4,373,750.90	11,668,121.80

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-5,954,546.00	-60,065,379.81
股票投资	-3,643,131.65	-61,178,922.35
债券投资	-2,311,414.35	1,113,542.54
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	4,940,705.17	37,521,757.56
权证投资	-	-

期货投资	4,940,705.17	37,521,757.56
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	-1,013,840.83	-22,543,622.25

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1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	62.11	-
合计	62.11	-

7.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

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1月1日至2021年12月31日
审计费用	20,000.00	18,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	200.00	1,960.00
账户维护费	37,200.00	69,075.34
其他	18,679.09	74,698.51
交易费用	-	20,826,843.45
合计	196,079.09	21,110,577.30

7.4.7.24 分部报告

无。

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，本集合未发生需要披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本集合无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
上海光大证券资产管理有限公司（“光证”	集合计划管理人、集合计划销售机构

资管”)	
广发银行股份有限公司	集合计划托管人、集合计划代销机构
光大证券股份有限公司(“光大证券”)	集合计划销售机构、集合计划管理人的股东
光大期货有限公司(“光大期货”)	集合计划管理人的股东控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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1月1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(%)
光大证券	4,743,686,157.01	100.00	15,092,109,845.62	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1月1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(%)
光大证券	395,021,870.99	100.00	739,342,200.64	100.00

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1月1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(%)
光大证券	3,631,500,000.00	100.00	19,395,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.5 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 (%)
光大证券	2,028,229.42	100.00	721,107.13	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1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 (%)
光大证券	11,047,938.77	100.00	1,129,102.20	100.00

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和手续费的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,846,664.46
其中：支付销售机构的客户维护费	1,859,374.23	6,339,236.95

注：1、本集合计划 A 类份额的管理费按前一日集合计划 A 类份额资产净值的 1.5% 的年费率计提。A 类份额管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的集合计划 A 类份额管理费 E 为前一日的集合计划 A 类份额的资产净值，A 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、本集合计划 B 类份额的管理费按前一日集合计划 B 类份额资产净值的 1% 的年费率计提。B 类份额管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的集合计划 B 类份额管理费 E 为前一日的集合计划 B 类份额的资产净值，B 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、本集合计划 C 类份额的管理费按前一日集合计划 C 类份额资产净值的 1% 的年费率计提。C 类份额管理费的计算方法如下： $H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的集合计划 C 类份额管理费 E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值，C 类份额管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

4、实际支付销售机构的客户维护费以本集合计划管理人和各销售机构对账确认的金额为准。

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	766,406.28	2,562,195.60

注：本集合计划的托管费按前一日集合资产净值的 0.2% 的年费率计提。

托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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			
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	合计
光大证券	-	-	3,073.41	3,073.41
光证资管	-	-	3.65	3.65
合计	-	-	3,077.06	3,077.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	合计
光大证券	-	-	40,598.84	40,598.84
光证资管	-	-	203.57	203.57
合计	-	-	40,802.41	40,802.41

注：1、销售服务费仅对 C 类份额收取。

2、销售服务费按前一日 C 类份额资产净值 0.4% 的年费率计提。

销售服务费的计算方法如下： $H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的集合计划销售服务费

E 为前一日的集合计划 C 类份额的资产净值。

销售服务费逐日累计至每月月末，按月支付给各销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付

日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间管理人未运用固有资金投资集合计划。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本集合计划。

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1月1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
广发银行股份有限公司	13,222,574.40	198,716.49	20,675,583.61	455,933.78

注：本集合计划的银行存款由基金托管人广发银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划支付给光大期货的股指期货交易手续费参考市场价格经本集合的管理人与对方协商确定，以包括中国金融期货交易所收取的上交手续费的全额列示。于2021年12月31日，本集

合无应付交易手续费余额。于2022年1月1日-2022年12月31日期间，本集合期间交易手续费支出76,943.84元。本集合计划用于期货交易结算的资金分别存放于光大期货的结算账户和保证金账户中，结算备付金按银行同业利率计息，由光大期货进行结息处理，存出保证金不计息。于2022年12月31日，本集合的结算备付金余额为19,079,555.61元，存出保证金余额为23,019,897.60元。

7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期未进行利润分配。

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
301152	天力锂电	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	57.00	46.64	114	6,498.00	5,316.96	-
301176	逸豪新材	2022年9月21日	6个月	新股流通受限	23.88	16.89	269	6,423.72	4,543.41	-
301223	中荣股份	2022年10月13日	6个月	新股流通受限	26.28	18.13	371	9,749.88	6,726.23	-
301230	泓博医药	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	40.00	48.32	152	6,080.00	7,344.64	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股流通受限	33.65	69.68	276	9,287.40	19,231.68	-
301265	华新环保	2022年12月8日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	495	6,573.60	5,643.00	-
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	238	12,109.44	15,755.60	-
301269	华大九天	2022年7月21日	6个月	新股流通受限	32.69	87.94	406	13,272.14	35,703.64	-
301270	汉仪股份	2022年8月19日	6个月	新股流通受限	25.68	28.37	90	2,311.20	2,553.30	-

		日									
301273	瑞晨环保	2022年10月11日	6个月	新股流通受限	37.89	37.79	139	5,266.71	5,252.81		-
301276	嘉曼服饰	2022年9月1日	6个月	新股流通受限	40.66	22.61	143	5,814.38	3,233.23		-
301277	新天地	2022年11月9日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	236	6,372.00	6,084.08		-
301282	金禄电子	2022年8月18日	6个月	新股流通受限	30.38	25.25	218	6,622.84	5,504.50		-
301296	新巨丰	2022年8月26日	6个月	新股流通受限	18.19	14.90	460	8,367.40	6,854.00		-
301309	万得凯	2022年9月8日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	130	5,070.00	3,179.80		-
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	393	5,454.84	6,232.98		-
301313	凡拓数创	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	25.25	29.14	117	2,954.25	3,409.38		-
301316	慧博云通	2022年9月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	169	1,284.40	2,420.08		-
301319	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	70	3,342.50	3,728.90		-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股流通受限	20.84	19.90	133	2,771.72	2,646.70		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	224	6,867.84	8,478.40		-
301366	一博科技	2022年9月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	120	7,842.00	5,410.80		-
301368	丰立智能	2022年12月7日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	166	3,706.78	3,074.32		-
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	532	12,172.16	9,379.16		-

301379	天山电子	2022 年 10 月 19 日	6 个月	新股流通受限	31.51	24.63	187	5,892.37	4,605.81	-
301388	欣灵电气	2022 年 10 月 26 日	6 个月	新股流通受限	25.88	21.60	148	3,830.24	3,196.80	-
301398	星源卓镁	2022 年 12 月 8 日	6 个月	新股流通受限	34.40	28.94	128	4,403.20	3,704.32	-
600459	贵研铂业	2022 年 12 月 22 日	1 个月内(含)	配股流通受限	10.91	15.74	2,370	25,856.70	37,303.80	-

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	46.41	-	-	2,800	131,287.00	129,948.00	-
002387	维信诺	2022 年 12 月 19 日	重大事项	6.34	-	-	11,900	75,357.00	75,446.00	-

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

本集合计划本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本集合计划本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划在日常经营活动中面临的与金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。管理人制定内部风险管理制度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。

公司建立四个层级的风险管理体系，即董事会、经理层及各专业委员会、各风险管理职能部门、各业务部门。公司董事会是风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任。公司经理层就公司风险管理工作的有效性向董事会负责，对全面风险管理承担主要责任。公司经理层在董事会的领导下，全面负责公司风险管理的日常工作。公司经理层下设专业委员会就不同类别风险管理对经理层负责，委员会根据公司各委员会议事规则确定的职责范围，行使公司风险管理职能。各风险管理职能部门按照公司授权对公司不同风险进行识别、监测、评估和报告，并制定公司不同类型风险管理办法，明确具体工作流程，并为业务决策提供对口风险管理建议，协助、指导和检查各部门的对口风险管理工作。公司各业务部门按照公司授权管理体系在被授予的权限范围内开展业务，严禁越权从事经营活动，并通过制度、流程、系统等方式，进行有效管理和控制。

本集合计划的管理人主要通过定性分析和定量分析的方法评估各种金融工具风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本集合计划的投资目标，结合集合计划资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的银行存款存放在本集合计划的托管行广发银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。

本集合计划在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本集合计划债券投资的信用评级均由经中国证监会核准从事证券市场资信评级业务的评级机构做出。

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	-	30,030,000.00
合计	-	30,030,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

3、本集合计划本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

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	25,011,330.25	19,980,892.50
AAA 以下	26,886,374.41	23,940,591.61
未评级	10,130,323.29	151,631,000.00
合计	62,028,027.95	195,552,484.11

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级中包含国债、政策性金融债、央票以及未有第三方机构评级的其他债券。

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	-	4,927,500.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	4,927,500.00

注：本集合计划本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本集合计划本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于计划份额持有人可随时要求赎回其持有的计划份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划资产的流动性风险进行管理，集合计划管理人建立了健全的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，对组合持仓集中度、流动性受限资产比例、现金类资产比例等流动性指标进行持续的监测和分析，通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，对交易对手进行必要的尽职调查和准入，加强逆回购的流动性风险和交易对手风险的管理，并健全了逆回购交易质押品管理制度。

本集合计划所持有的证券大部分具有良好的流动性，部分证券流通暂时受限的情况参见附注 7.4.12 “期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券”，本报告期内本集合计划未出现因投资品种变现困难或投资集中而无法以合理价格及时变现集合计划资产以支付赎回款的情况。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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。

本集合计划的管理人定期对本集合计划面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	13,222,574.40	-	-	-	13,222,574.40
结算备付金	24,889,194.26	-	-	-	24,889,194.26
存出保证金	23,127,903.63	-	-	-	23,127,903.63
交易性金融资产	30,773,583.56	29,497,421.72	1,757,022.67	184,793,787.97	246,821,815.92
买入返售金融资产	7,998,513.70	-	-	-	7,998,513.70

应收申购款	-	-	-	2,500.00	2,500.00
应收清算款	-	-	-	128,779.80	128,779.80
资产总计	100,011,769.55	29,497,421.72	1,757,022.67	184,925,067.77	316,191,281.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	451,911.94	451,911.94
应付管理人报酬	-	-	-	268,610.02	268,610.02
应付托管费	-	-	-	53,492.73	53,492.73
应付清算款	-	-	-	3,357,407.22	3,357,407.22
应付销售服务费	-	-	-	93,149.85	93,149.85
应交税费	-	-	-	2,349.05	2,349.05
其他负债	-	-	-	861,107.13	861,107.13
负债总计	-	-	-	5,088,027.94	5,088,027.94
利率敏感度缺口	100,011,769.55	29,497,421.72	1,757,022.67	179,837,039.83	311,103,253.77
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	20,675,583.61	-	-	-	20,675,583.61
结算备付金	35,682,420.12	-	-	-	35,682,420.12
存出保证金	20,153,603.81	-	-	-	20,153,603.81
交易性金融资产	34,957,500.00	124,626,114.18	70,926,369.93	206,821,340.82	437,331,324.93
买入返售金融资产	20,000,000.00	-	-	-	20,000,000.00
应收申购款	-	-	-	21,920.00	21,920.00
应收证券清算款	-	-	-	5,816,187.82	5,816,187.82
其他资产	-	-	-	2,690,399.47	2,690,399.47
资产总计	131,469,107.54	124,626,114.18	70,926,369.93	215,349,848.11	542,371,439.76
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,339,008.95	2,339,008.95
应付管理人报酬	-	-	-	442,982.11	442,982.11
应付托管费	-	-	-	88,318.73	88,318.73
应付销售服务费	-	-	-	161,396.67	161,396.67
应交税费	-	-	-	317.46	317.46
其他负债	-	-	-	41,257,642.20	41,257,642.20
负债总计	-	-	-	44,289,666.12	44,289,666.12
利率敏感度缺口	131,469,107.54	124,626,114.18	70,926,369.93	171,060,181.99	498,081,773.64

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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	市场利率上升25个	-22,732.23	-1,490,755.71

	基点		
	市场利率下降 25 个基点	22,732.23	1,490,755.71

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，因此无外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除市场汇率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	港币相对人民币升值 5%	-	-
	港币相对人民币贬值 5%	-	-

注：无。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是集计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素发生变动时产生的价格波动风险。本集合计划主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本集合计划严格按照合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。并且，管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对集计划进行风险度量，动态、及时地跟踪和控制其他价格风险。

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	184,793,787.97	59.40	206,821,340.82	41.52
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	184,793,787.97	59.40	206,821,340.82	41.52

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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	沪深 300 指数上升 5%	8,414,467.00	9,800,999.17
	沪深 300 指数下降 5%	-8,414,467.00	-9,800,999.17

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本集合计划本报告期及上年度无采用风险价值法管理的风险。

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	215,616,320.03	248,828,181.83
第二层次	31,016,281.36	188,503,143.10
第三层次	189,214.53	-
合计	246,821,815.92	437,331,324.93

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

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	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	992,831.02	992,831.02
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	765,248.56	765,248.56
转出第三层次	-	1,501,091.71	1,501,091.71
当期利得或损失总额	-	-67,773.34	-67,773.34
其中：计入损益的利得或损失	-	-67,773.34	-67,773.34
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	189,214.53	189,214.53
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	-	18,873.52	18,873.52
项目	上年度可比同期		

	2021年1月1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
限售股票	189,214.53	平均价格亚式期权模型	流动性折扣	0.0017-0.2700	折扣率越高，公允价值越低
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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	184,793,787.97	58.44
	其中：股票	184,793,787.97	58.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	62,028,027.95	19.62
	其中：债券	62,028,027.95	19.62
	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	7,998,513.70	2.53
	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	38,111,768.66	12.05
8	其他各项资产	23,259,183.43	7.36
9	合计	316,191,281.71	100.00

注：本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	1,984,440.00	0.64
B	采矿业	7,699,320.78	2.47
C	制造业	106,481,907.52	34.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,050,354.70	1.94
E	建筑业	5,961,683.00	1.92
F	批发和零售业	4,311,394.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	7,423,758.60	2.39
H	住宿和餐饮业	84,320.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,602,928.48	3.09
J	金融业	24,785,430.97	7.97
K	房地产业	2,979,390.00	0.96
L	租赁和商务服务业	2,107,643.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	1,655,450.64	0.53
N	水利、环境和公共设施管理业	1,136,978.00	0.37

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	117,368.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,028,425.28	0.33
R	文化、体育和娱乐业	1,089,640.00	0.35
S	综合	293,355.00	0.09
	合计	184,793,787.97	59.40

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	600519	贵州茅台	1,919	3,314,113.00	1.07
2	601166	兴业银行	112,457	1,978,118.63	0.64
3	601328	交通银行	338,100	1,602,594.00	0.52
4	300750	宁德时代	3,916	1,540,632.72	0.50
5	601398	工商银行	344,500	1,495,130.00	0.48
6	601998	中信银行	299,100	1,489,518.00	0.48
7	601288	农业银行	479,200	1,394,472.00	0.45
8	601318	中国平安	29,226	1,373,622.00	0.44
9	601088	中国神华	44,600	1,231,852.00	0.40
10	600036	招商银行	32,909	1,226,189.34	0.39
11	601658	邮储银行	252,500	1,166,550.00	0.37
12	000858	五粮液	6,400	1,156,416.00	0.37
13	000651	格力电器	31,700	1,024,544.00	0.33
14	601390	中国中铁	146,600	815,096.00	0.26
15	601866	中远海发	326,900	791,098.00	0.25
16	000333	美的集团	14,300	740,740.00	0.24
17	600030	中信证券	37,200	740,652.00	0.24
18	601899	紫金矿业	72,929	729,290.00	0.23
19	601186	中国铁建	88,900	687,197.00	0.22
20	300124	汇川技术	8,600	597,700.00	0.19
21	600900	长江电力	27,800	583,800.00	0.19
22	601888	中国中免	2,700	583,281.00	0.19
23	600809	山西汾酒	2,000	569,980.00	0.18
24	600887	伊利股份	17,900	554,900.00	0.18
25	002475	立讯精密	16,800	533,400.00	0.17
26	688599	天合光能	8,313	530,036.88	0.17
27	002027	分众传媒	79,200	529,056.00	0.17
28	601800	中国交建	65,200	524,860.00	0.17
29	600919	江苏银行	69,900	509,571.00	0.16
30	603659	璞泰来	9,400	487,766.00	0.16

31	000001	平安银行	37,000	486,920.00	0.16
32	300498	温氏股份	24,700	484,861.00	0.16
33	601012	隆基绿能	11,409	482,144.34	0.15
34	002304	洋河股份	2,900	465,450.00	0.15
35	002594	比亚迪	1,800	462,546.00	0.15
36	002129	TCL中环	12,200	459,452.00	0.15
37	601138	工业富联	49,600	455,328.00	0.15
38	300896	爱美客	800	453,080.00	0.15
39	600989	宝丰能源	36,500	440,555.00	0.14
40	601225	陕西煤业	23,700	440,346.00	0.14
41	600276	恒瑞医药	11,400	439,242.00	0.14
42	600104	上汽集团	30,300	436,623.00	0.14
43	300274	阳光电源	3,900	436,020.00	0.14
44	603369	今世缘	8,500	432,650.00	0.14
45	600600	青岛啤酒	4,000	430,000.00	0.14
46	002352	顺丰控股	7,400	427,424.00	0.14
47	300450	先导智能	10,400	418,600.00	0.13
48	601816	京沪高铁	84,600	416,232.00	0.13
49	600000	浦发银行	57,100	415,688.00	0.13
50	600481	双良节能	31,500	407,610.00	0.13
51	002142	宁波银行	12,500	405,625.00	0.13
52	600309	万华化学	4,300	398,395.00	0.13
53	600150	中国船舶	17,700	394,356.00	0.13
54	688556	高测股份	5,186	389,053.72	0.13
55	601668	中国建筑	71,000	385,530.00	0.12
56	603259	药明康德	4,700	380,700.00	0.12
57	000002	万科A	20,800	378,560.00	0.12
58	300316	晶盛机电	5,900	375,004.00	0.12
59	000596	古井贡酒	1,400	373,660.00	0.12
60	600993	马应龙	16,500	372,900.00	0.12
61	000963	华东医药	7,900	369,720.00	0.12
62	002415	海康威视	10,600	367,608.00	0.12
63	601006	大秦铁路	54,900	366,732.00	0.12
64	601689	拓普集团	6,200	363,196.00	0.12
65	000063	中兴通讯	14,000	362,040.00	0.12
66	300059	东方财富	18,600	360,840.00	0.12
67	300502	新易盛	15,100	358,625.00	0.12
68	002714	牧原股份	7,300	355,875.00	0.11
69	300101	振芯科技	14,500	355,250.00	0.11
70	600057	厦门象屿	34,200	351,234.00	0.11
71	603129	春风动力	3,100	348,812.00	0.11
72	300760	迈瑞医疗	1,100	347,567.00	0.11
73	300298	三诺生物	10,300	347,419.00	0.11

74	000338	潍柴动力	34,000	346,120.00	0.11
75	601988	中国银行	109,200	345,072.00	0.11
76	603876	鼎胜新材	8,400	344,736.00	0.11
77	000425	徐工机械	67,400	341,718.00	0.11
78	601111	中国国航	32,200	341,320.00	0.11
79	601117	中国化学	42,500	337,450.00	0.11
80	600674	川投能源	27,500	336,325.00	0.11
81	603179	新泉股份	8,700	334,863.00	0.11
82	600285	羚锐制药	25,600	333,824.00	0.11
83	600837	海通证券	38,400	333,696.00	0.11
84	601601	中国太保	13,600	333,472.00	0.11
85	601319	中国人保	63,800	333,036.00	0.11
86	600061	国投资本	52,100	332,919.00	0.11
87	603612	索通发展	12,700	330,454.00	0.11
88	601211	国泰君安	24,300	330,237.00	0.11
89	002493	荣盛石化	26,600	327,180.00	0.11
90	600660	福耀玻璃	9,300	326,151.00	0.10
91	601229	上海银行	54,600	322,686.00	0.10
92	002517	恺英网络	48,500	318,160.00	0.10
93	600690	海尔智家	13,000	317,980.00	0.10
94	601808	中海油服	19,100	316,678.00	0.10
95	003040	楚天龙	18,100	315,664.00	0.10
96	600438	通威股份	8,106	312,729.48	0.10
97	002324	普利特	19,500	312,000.00	0.10
98	601100	恒立液压	4,900	309,435.00	0.10
99	600999	招商证券	23,200	308,560.00	0.10
100	000860	顺鑫农业	10,300	307,146.00	0.10
101	002180	纳思达	5,900	306,151.00	0.10
102	600039	四川路桥	27,100	301,352.00	0.10
103	601857	中国石油	60,600	301,182.00	0.10
104	002085	万丰奥威	50,600	301,070.00	0.10
105	002258	利尔化学	16,760	301,009.60	0.10
106	600926	杭州银行	22,900	299,532.00	0.10
107	601279	英利汽车	59,600	299,192.00	0.10
108	600478	科力远	31,400	294,532.00	0.09
109	605589	圣泉集团	13,700	293,043.00	0.09
110	600160	巨化股份	18,700	290,037.00	0.09
111	300377	赢时胜	35,200	288,992.00	0.09
112	601838	成都银行	18,800	287,640.00	0.09
113	002675	东诚药业	17,300	286,488.00	0.09
114	600018	上港集团	53,100	283,554.00	0.09
115	600028	中国石化	65,000	283,400.00	0.09
116	300438	鹏辉能源	3,600	280,764.00	0.09

117	601908	京运通	42,700	280,539.00	0.09
118	600025	华能水电	42,500	280,500.00	0.09
119	600115	中国东航	50,700	280,371.00	0.09
120	300567	精测电子	5,500	276,100.00	0.09
121	600888	新疆众和	33,700	276,003.00	0.09
122	603118	共进股份	34,600	275,070.00	0.09
123	603920	世运电路	19,100	274,658.00	0.09
124	002130	沃尔核材	42,500	274,125.00	0.09
125	603305	旭升集团	8,500	274,040.00	0.09
126	600048	保利发展	18,100	273,853.00	0.09
127	600029	南方航空	35,900	272,840.00	0.09
128	000758	中色股份	57,400	272,650.00	0.09
129	600330	天通股份	25,800	271,932.00	0.09
130	600583	海油工程	44,800	271,488.00	0.09
131	600233	圆通速递	13,500	271,215.00	0.09
132	601567	三星医疗	20,000	269,600.00	0.09
133	000913	钱江摩托	14,500	267,960.00	0.09
134	600403	大有能源	58,100	267,841.00	0.09
135	601728	中国电信	63,800	267,322.00	0.09
136	002756	永兴材料	2,900	267,293.00	0.09
137	603060	国检集团	20,700	267,030.00	0.09
138	600015	华夏银行	51,200	265,728.00	0.09
139	000950	重药控股	52,300	265,684.00	0.09
140	601375	中原证券	72,600	264,264.00	0.08
141	300595	欧普康视	7,400	264,180.00	0.08
142	000915	华特达因	5,800	263,900.00	0.08
143	300761	立华股份	7,700	263,725.00	0.08
144	601222	林洋能源	30,700	263,713.00	0.08
145	600019	宝钢股份	47,100	263,289.00	0.08
146	600886	国投电力	24,300	263,169.00	0.08
147	601985	中国核电	43,700	262,200.00	0.08
148	603529	爱玛科技	5,700	261,459.00	0.08
149	002938	鹏鼎控股	9,500	260,680.00	0.08
150	600821	金开新能	36,000	260,640.00	0.08
151	600963	岳阳林纸	47,700	259,965.00	0.08
152	002311	海大集团	4,200	259,266.00	0.08
153	000034	神州数码	11,800	258,892.00	0.08
154	300607	拓斯达	17,700	257,535.00	0.08
155	600929	雪天盐业	32,000	256,320.00	0.08
156	300639	凯普生物	15,200	256,120.00	0.08
157	000690	宝新能源	39,400	256,100.00	0.08
158	603565	中谷物流	17,600	255,904.00	0.08
159	603599	广信股份	8,620	253,428.00	0.08

160	601898	中煤能源	29,400	253,428.00	0.08
161	300999	金龙鱼	5,800	252,648.00	0.08
162	601618	中国中冶	79,000	251,220.00	0.08
163	601939	建设银行	44,400	249,972.00	0.08
164	601069	西部黄金	21,000	249,690.00	0.08
165	002044	美年健康	40,700	249,491.00	0.08
166	002312	川发龙蟒	23,700	249,324.00	0.08
167	000090	天健集团	45,500	248,430.00	0.08
168	002055	得润电子	28,800	248,256.00	0.08
169	600305	恒顺醋业	20,100	247,431.00	0.08
170	000568	泸州老窖	1,102	247,156.56	0.08
171	300910	瑞丰新材	2,000	246,620.00	0.08
172	601169	北京银行	57,200	246,532.00	0.08
173	300014	亿纬锂能	2,800	246,120.00	0.08
174	601881	中国银河	26,400	245,256.00	0.08
175	300765	新诺威	15,500	244,590.00	0.08
176	002558	巨人网络	30,700	244,372.00	0.08
177	600422	昆药集团	17,300	244,276.00	0.08
178	601336	新华保险	8,100	243,648.00	0.08
179	600248	陕西建工	58,000	243,600.00	0.08
180	000028	国药一致	7,400	243,386.00	0.08
181	603368	柳药集团	13,000	242,710.00	0.08
182	600491	龙元建设	38,500	242,165.00	0.08
183	300687	赛意信息	8,200	241,900.00	0.08
184	002036	联创电子	19,500	241,215.00	0.08
185	601126	四方股份	16,500	240,900.00	0.08
186	300352	北信源	59,000	240,720.00	0.08
187	600108	亚盛集团	76,500	240,210.00	0.08
188	002038	双鹭药业	29,200	240,024.00	0.08
189	601137	博威合金	16,200	239,922.00	0.08
190	000848	承德露露	28,200	239,136.00	0.08
191	600406	国电南瑞	9,800	239,120.00	0.08
192	600710	苏美达	40,600	238,728.00	0.08
193	601766	中国中车	46,600	238,126.00	0.08
194	000612	焦作万方	45,600	238,032.00	0.08
195	002446	盛路通信	24,800	237,088.00	0.08
196	600284	浦东建设	34,900	235,226.00	0.08
197	688037	芯源微	1,500	234,750.00	0.08
198	601918	新集能源	56,000	234,640.00	0.08
199	600114	东睦股份	27,600	234,600.00	0.08
200	002737	葵花药业	10,100	234,118.00	0.08
201	300763	锦浪科技	1,300	234,065.00	0.08
202	000426	兴业矿业	38,200	232,638.00	0.07

203	600050	中国联通	51,900	232,512.00	0.07
204	600426	华鲁恒升	7,000	232,050.00	0.07
205	600436	片仔癀	800	230,768.00	0.07
206	603290	斯达半导	700	230,510.00	0.07
207	600941	中国移动	3,400	230,078.00	0.07
208	300134	大富科技	29,600	229,696.00	0.07
209	002064	华峰化学	33,700	229,160.00	0.07
210	600016	民生银行	66,100	228,045.00	0.07
211	300590	移为通信	23,200	227,592.00	0.07
212	002649	博彦科技	22,100	227,409.00	0.07
213	600531	豫光金铅	43,500	226,635.00	0.07
214	600184	光电股份	20,200	226,240.00	0.07
215	300244	迪安诊断	9,000	226,170.00	0.07
216	000718	苏宁环球	68,400	225,720.00	0.07
217	600590	泰豪科技	38,800	225,428.00	0.07
218	002815	崇达技术	22,600	223,966.00	0.07
219	603288	海天味业	2,800	222,880.00	0.07
220	002481	双塔食品	35,600	222,856.00	0.07
221	600720	祁连山	22,400	222,432.00	0.07
222	605507	国邦医药	8,400	222,348.00	0.07
223	603185	上机数控	2,100	222,285.00	0.07
224	600176	中国巨石	16,200	222,102.00	0.07
225	600770	综艺股份	31,900	222,024.00	0.07
226	600908	无锡银行	42,100	221,867.00	0.07
227	300497	富祥药业	16,800	221,760.00	0.07
228	603113	金能科技	24,300	220,401.00	0.07
229	603027	千禾味业	10,600	220,268.00	0.07
230	600458	时代新材	24,400	220,088.00	0.07
231	600011	华能国际	28,900	219,929.00	0.07
232	002600	领益智造	48,300	219,282.00	0.07
233	600312	平高电气	27,700	219,107.00	0.07
234	600188	兖矿能源	6,500	218,270.00	0.07
235	000557	西部创业	44,500	218,050.00	0.07
236	600761	安徽合力	16,500	216,975.00	0.07
237	600420	国药现代	23,800	216,580.00	0.07
238	300769	德方纳米	940	215,814.60	0.07
239	603609	禾丰股份	18,200	215,488.00	0.07
240	600570	恒生电子	5,300	214,438.00	0.07
241	300015	爱尔眼科	6,900	214,383.00	0.07
242	000811	冰轮环境	19,300	214,230.00	0.07
243	000016	深康佳A	47,500	214,225.00	0.07
244	600151	航天机电	26,200	213,530.00	0.07
245	600009	上海机场	3,700	213,527.00	0.07

246	601369	陕鼓动力	18,600	213,156.00	0.07
247	002807	江阴银行	53,600	212,792.00	0.07
248	688385	复旦微电	3,046	212,641.26	0.07
249	600496	精工钢构	53,800	212,510.00	0.07
250	002003	伟星股份	20,900	211,508.00	0.07
251	600477	杭萧钢构	52,100	211,005.00	0.07
252	600803	新奥股份	13,100	210,910.00	0.07
253	601686	友发集团	35,500	210,870.00	0.07
254	600105	永鼎股份	61,800	210,738.00	0.07
255	300123	亚光科技	35,600	210,396.00	0.07
256	603392	万泰生物	1,660	210,322.00	0.07
257	002171	楚江新材	28,600	210,210.00	0.07
258	002812	恩捷股份	1,600	210,064.00	0.07
259	002605	姚记科技	14,900	209,345.00	0.07
260	600125	铁龙物流	38,100	208,026.00	0.07
261	300596	利安隆	3,800	207,366.00	0.07
262	600547	山东黄金	10,800	206,928.00	0.07
263	600995	南网储能	14,300	206,206.00	0.07
264	002839	张家港行	44,700	206,067.00	0.07
265	300751	迈为股份	500	205,920.00	0.07
266	603299	苏盐井神	20,600	205,382.00	0.07
267	300303	聚飞光电	52,300	205,016.00	0.07
268	600346	恒力石化	13,200	204,996.00	0.07
269	600210	紫江企业	40,900	204,500.00	0.07
270	688518	联赢激光	7,000	204,470.00	0.07
271	600810	神马股份	26,300	204,351.00	0.07
272	600789	鲁抗医药	28,100	204,006.00	0.07
273	000543	皖能电力	45,300	202,944.00	0.07
274	601231	环旭电子	12,500	202,875.00	0.07
275	600362	江西铜业	11,600	202,188.00	0.06
276	300130	新国都	16,700	201,569.00	0.06
277	600026	中远海能	16,700	201,235.00	0.06
278	603108	润达医疗	19,800	200,178.00	0.06
279	300369	绿盟科技	19,600	200,116.00	0.06
280	000661	长春高新	1,200	199,740.00	0.06
281	000823	超声电子	21,500	199,735.00	0.06
282	603730	岱美股份	12,400	199,392.00	0.06
283	600741	华域汽车	11,500	199,295.00	0.06
284	300900	广联航空	6,900	198,237.00	0.06
285	601609	金田股份	29,300	198,068.00	0.06
286	000737	北方铜业	38,500	197,890.00	0.06
287	603766	隆鑫通用	40,700	197,802.00	0.06
288	000069	华侨城A	37,000	197,210.00	0.06

289	300919	中伟股份	3,000	196,830.00	0.06
290	002215	诺普信	37,300	196,571.00	0.06
291	002302	西部建设	27,100	196,475.00	0.06
292	688007	光峰科技	7,879	195,871.94	0.06
293	601619	嘉泽新能	51,900	195,663.00	0.06
294	600968	海油发展	67,700	194,976.00	0.06
295	002020	京新药业	16,000	194,880.00	0.06
296	000408	藏格矿业	7,500	194,775.00	0.06
297	603345	安井食品	1,200	194,256.00	0.06
298	000710	贝瑞基因	17,000	193,970.00	0.06
299	601688	华泰证券	15,200	193,648.00	0.06
300	000725	京东方A	57,200	193,336.00	0.06
301	603128	华贸物流	18,000	193,320.00	0.06
302	003012	东鹏控股	24,500	192,570.00	0.06
303	601360	三六零	29,300	191,622.00	0.06
304	000885	城发环境	20,100	190,347.00	0.06
305	600662	外服控股	31,800	189,846.00	0.06
306	300109	新开源	7,800	188,760.00	0.06
307	002602	世纪华通	49,500	188,595.00	0.06
308	603718	海利生物	19,200	188,544.00	0.06
309	600582	天地科技	36,200	188,240.00	0.06
310	300232	洲明科技	34,200	187,758.00	0.06
311	300358	楚天科技	12,600	185,850.00	0.06
312	603323	苏农银行	39,600	185,724.00	0.06
313	601000	唐山港	67,600	185,224.00	0.06
314	600746	江苏索普	22,800	185,136.00	0.06
315	002832	比音勒芬	7,200	184,392.00	0.06
316	000921	海信家电	14,000	184,380.00	0.06
317	300183	东软载波	15,300	184,365.00	0.06
318	300759	康龙化成	2,700	183,600.00	0.06
319	300328	宜安科技	30,700	183,586.00	0.06
320	603806	福斯特	2,760	183,374.40	0.06
321	002664	信质集团	14,000	183,260.00	0.06
322	002004	华邦健康	35,900	183,090.00	0.06
323	300856	科思股份	3,500	182,525.00	0.06
324	300394	天孚通信	7,200	182,520.00	0.06
325	001696	宗申动力	30,700	182,358.00	0.06
326	600073	上海梅林	22,900	182,055.00	0.06
327	002106	莱宝高科	23,700	182,016.00	0.06
328	600546	山煤国际	12,500	181,125.00	0.06
329	600874	创业环保	29,700	180,873.00	0.06
330	603799	华友钴业	3,250	180,797.50	0.06
331	300115	长盈精密	17,500	180,775.00	0.06

332	300127	银河磁体	11,900	180,761.00	0.06
333	600548	深高速	20,100	180,498.00	0.06
334	601699	潞安环能	10,700	180,295.00	0.06
335	600782	新钢股份	43,800	179,142.00	0.06
336	300118	东方日升	7,200	178,704.00	0.06
337	002979	雷赛智能	7,900	178,619.00	0.06
338	002746	仙坛股份	19,400	177,704.00	0.06
339	002768	国恩股份	6,100	177,022.00	0.06
340	301015	百洋医药	7,400	176,416.00	0.06
341	002461	珠江啤酒	22,000	176,220.00	0.06
342	000828	东莞控股	19,600	175,812.00	0.06
343	688126	沪硅产业	9,968	175,536.48	0.06
344	600103	青山纸业	77,800	175,050.00	0.06
345	300451	创业慧康	22,100	174,811.00	0.06
346	000976	华铁股份	47,500	174,325.00	0.06
347	002428	云南锗业	18,700	174,284.00	0.06
348	601212	白银有色	66,900	173,940.00	0.06
349	600383	金地集团	17,000	173,910.00	0.06
350	003021	兆威机电	3,600	173,052.00	0.06
351	300616	尚品宅配	8,800	172,832.00	0.06
352	600850	电科数字	8,600	172,688.00	0.06
353	600742	一汽富维	20,600	172,216.00	0.06
354	600797	浙大网新	29,400	171,990.00	0.06
355	601377	兴业证券	29,900	171,626.00	0.06
356	002049	紫光国微	1,300	171,366.00	0.06
357	603959	百利科技	16,200	171,234.00	0.06
358	601777	力帆科技	44,200	170,612.00	0.05
359	600508	上海能源	11,900	170,527.00	0.05
360	603013	亚普股份	11,900	170,527.00	0.05
361	000776	广发证券	11,000	170,390.00	0.05
362	603093	南华期货	18,700	170,357.00	0.05
363	600308	华泰股份	33,600	170,352.00	0.05
364	002422	科伦药业	6,400	170,304.00	0.05
365	605008	长鸿高科	10,400	169,624.00	0.05
366	300185	通裕重工	70,600	169,440.00	0.05
367	600588	用友网络	7,000	169,190.00	0.05
368	600581	八一钢铁	42,600	168,696.00	0.05
369	600578	京能电力	51,900	168,675.00	0.05
370	600835	上海机电	15,000	168,300.00	0.05
371	603105	芯能科技	11,400	167,922.00	0.05
372	002078	太阳纸业	14,500	167,040.00	0.05
373	000030	富奥股份	37,900	166,760.00	0.05
374	002865	钧达股份	900	166,590.00	0.05

375	000517	荣安地产	56,300	166,085.00	0.05
376	603927	中科软	5,600	165,816.00	0.05
377	003006	百亚股份	12,000	165,720.00	0.05
378	000601	韶能股份	35,200	165,440.00	0.05
379	000567	海德股份	11,800	164,256.00	0.05
380	600017	日照港	58,100	163,842.00	0.05
381	601827	三峰环境	25,400	163,322.00	0.05
382	601528	瑞丰银行	25,800	162,798.00	0.05
383	000938	紫光股份	8,300	161,933.00	0.05
384	603993	洛阳钼业	35,538	161,697.90	0.05
385	600459	贵研铂业	10,270	161,649.80	0.05
386	603566	普莱柯	5,900	161,424.00	0.05
387	603010	万盛股份	13,600	160,888.00	0.05
388	605365	立达信	10,000	160,800.00	0.05
389	603018	华设集团	21,100	159,938.00	0.05
390	600575	淮河能源	66,300	159,783.00	0.05
391	601886	江河集团	20,600	159,444.00	0.05
392	002230	科大讯飞	4,800	157,584.00	0.05
393	000876	新希望	12,200	157,502.00	0.05
394	300657	弘信电子	14,300	157,157.00	0.05
395	688008	澜起科技	2,500	156,500.00	0.05
396	300035	中科电气	7,600	156,408.00	0.05
397	600320	振华重工	48,700	156,327.00	0.05
398	300413	芒果超媒	5,200	156,104.00	0.05
399	600795	国电电力	36,510	155,897.70	0.05
400	002100	天康生物	18,700	155,397.00	0.05
401	300661	圣邦股份	900	155,340.00	0.05
402	300395	菲利华	2,800	154,000.00	0.05
403	688777	中控技术	1,694	153,866.02	0.05
404	002390	信邦制药	32,700	153,690.00	0.05
405	600585	海螺水泥	5,600	153,328.00	0.05
406	601128	常熟银行	20,300	153,265.00	0.05
407	300219	鸿利智汇	22,900	152,972.00	0.05
408	600933	爱柯迪	8,400	152,964.00	0.05
409	600845	宝信软件	3,400	152,320.00	0.05
410	002389	航天彩虹	7,400	152,218.00	0.05
411	600893	航发动力	3,600	152,208.00	0.05
412	600997	开滦股份	22,400	151,872.00	0.05
413	300034	钢研高纳	3,300	151,272.00	0.05
414	603505	金石资源	3,800	150,556.00	0.05
415	002662	京威股份	45,600	150,024.00	0.05
416	600685	中船防务	7,200	149,472.00	0.05
417	300133	华策影视	28,000	149,240.00	0.05

418	601615	明阳智能	5,900	149,034.00	0.05
419	600783	鲁信创投	12,000	148,920.00	0.05
420	600010	包钢股份	77,200	148,224.00	0.05
421	600380	健康元	13,100	147,899.00	0.05
422	600732	爱旭股份	3,900	147,498.00	0.05
423	601966	玲珑轮胎	7,200	147,456.00	0.05
424	002273	水晶光电	12,500	147,375.00	0.05
425	600864	哈投股份	31,300	147,110.00	0.05
426	000036	华联控股	36,300	147,015.00	0.05
427	002532	天山铝业	19,000	146,680.00	0.05
428	002697	红旗连锁	26,000	146,380.00	0.05
429	600331	宏达股份	51,000	146,370.00	0.05
430	300748	金力永磁	5,000	146,300.00	0.05
431	600748	上实发展	42,300	145,512.00	0.05
432	002459	晶澳科技	2,420	145,417.80	0.05
433	000528	柳工	24,600	144,648.00	0.05
434	000627	天茂集团	45,700	144,412.00	0.05
435	600649	城投控股	36,100	143,678.00	0.05
436	002145	中核钛白	23,300	143,528.00	0.05
437	300091	金通灵	40,400	143,420.00	0.05
438	000539	粤电力A	25,800	143,190.00	0.05
439	600111	北方稀土	5,700	142,785.00	0.05
440	600266	城建发展	30,600	142,290.00	0.05
441	600409	三友化工	21,500	142,115.00	0.05
442	600566	济川药业	5,200	141,544.00	0.05
443	300009	安科生物	15,100	141,336.00	0.05
444	600031	三一重工	8,900	140,620.00	0.05
445	600398	海澜之家	26,400	139,920.00	0.04
446	603019	中科曙光	6,300	139,482.00	0.04
447	000065	北方国际	16,900	139,425.00	0.04
448	301035	润丰股份	1,600	139,360.00	0.04
449	688711	宏微科技	1,500	139,200.00	0.04
450	601678	滨化股份	27,000	138,780.00	0.04
451	603613	国联股份	1,560	137,966.40	0.04
452	600100	同方股份	32,000	137,920.00	0.04
453	603588	高能环境	14,000	137,760.00	0.04
454	002460	赣锋锂业	1,980	137,629.80	0.04
455	600618	氯碱化工	14,000	137,620.00	0.04
456	603355	莱克电气	4,900	137,396.00	0.04
457	688012	中微公司	1,400	137,214.00	0.04
458	300782	卓胜微	1,200	137,160.00	0.04
459	002920	德赛西威	1,300	136,942.00	0.04
460	601108	财通证券	19,200	136,704.00	0.04

461	300347	泰格医药	1,300	136,240.00	0.04
462	002399	海普瑞	10,600	136,210.00	0.04
463	601929	吉视传媒	70,200	136,188.00	0.04
464	603596	伯特利	1,700	135,660.00	0.04
465	002371	北方华创	600	135,180.00	0.04
466	300525	博思软件	6,800	134,640.00	0.04
467	002017	东信和平	10,200	134,130.00	0.04
468	600252	中恒集团	51,000	134,130.00	0.04
469	000400	许继电气	6,700	133,799.00	0.04
470	688586	江航装备	8,200	133,660.00	0.04
471	688268	华特气体	1,800	133,650.00	0.04
472	002597	金禾实业	4,100	133,250.00	0.04
473	603986	兆易创新	1,300	133,211.00	0.04
474	002318	久立特材	8,000	133,120.00	0.04
475	000931	中关村	21,600	132,840.00	0.04
476	002585	双星新材	10,400	132,600.00	0.04
477	600859	王府井	4,700	132,258.00	0.04
478	600219	南山铝业	40,200	131,454.00	0.04
479	600569	安阳钢铁	63,400	131,238.00	0.04
480	600977	中国电影	9,600	130,560.00	0.04
481	600985	淮北矿业	10,200	130,560.00	0.04
482	000708	中信特钢	7,600	130,416.00	0.04
483	000877	天山股份	15,300	130,356.00	0.04
484	002126	银轮股份	10,500	130,305.00	0.04
485	688148	芳源股份	8,918	130,113.62	0.04
486	600038	中直股份	2,800	129,948.00	0.04
487	000035	中国天楹	25,500	129,285.00	0.04
488	603668	天马科技	7,200	129,024.00	0.04
489	688700	东威科技	900	128,835.00	0.04
490	600165	宁科生物	19,000	128,440.00	0.04
491	300382	斯莱克	6,800	128,384.00	0.04
492	603063	禾望电气	4,600	128,248.00	0.04
493	601919	中远海控	12,440	128,007.60	0.04
494	603605	珀莱雅	760	127,284.80	0.04
495	002206	海利得	21,300	127,161.00	0.04
496	600905	三峡能源	22,500	127,125.00	0.04
497	002959	小熊电器	2,100	126,672.00	0.04
498	000584	哈工智能	18,400	126,592.00	0.04
499	300634	彩讯股份	8,300	126,575.00	0.04
500	002466	天齐锂业	1,600	126,384.00	0.04
501	002643	万润股份	8,600	126,076.00	0.04
502	300144	宋城演艺	8,600	125,560.00	0.04
503	002648	卫星化学	8,100	125,550.00	0.04

504	688363	华熙生物	928	125,539.84	0.04
505	601399	国机重装	41,200	124,424.00	0.04
506	002252	上海莱士	19,600	124,264.00	0.04
507	000935	四川双马	5,900	123,900.00	0.04
508	301039	中集车辆	15,500	123,535.00	0.04
509	688981	中芯国际	3,000	123,420.00	0.04
510	600277	亿利洁能	29,500	123,310.00	0.04
511	600273	嘉化能源	14,700	123,039.00	0.04
512	300072	海新能科	28,100	122,516.00	0.04
513	600580	卧龙电驱	9,800	122,108.00	0.04
514	002654	万润科技	24,200	121,968.00	0.04
515	688559	海目星	2,100	121,464.00	0.04
516	300747	锐科激光	5,100	120,615.00	0.04
517	600089	特变电工	6,000	120,480.00	0.04
518	600027	华电国际	20,400	119,952.00	0.04
519	002705	新宝股份	7,200	119,880.00	0.04
520	603601	再升科技	22,600	119,328.00	0.04
521	002123	梦网科技	10,600	119,038.00	0.04
522	000735	罗牛山	16,800	118,776.00	0.04
523	600562	国睿科技	7,000	118,650.00	0.04
524	600918	中泰证券	18,500	118,585.00	0.04
525	002484	江海股份	5,300	118,561.00	0.04
526	002611	东方精工	29,200	118,552.00	0.04
527	002821	凯莱英	800	118,400.00	0.04
528	002320	海峡股份	21,500	118,250.00	0.04
529	603688	石英股份	900	118,188.00	0.04
530	600183	生益科技	8,200	118,162.00	0.04
531	002430	杭氧股份	3,000	118,080.00	0.04
532	601555	东吴证券	18,000	117,540.00	0.04
533	688276	百克生物	1,700	117,487.00	0.04
534	003032	传智教育	6,800	117,368.00	0.04
535	002261	拓维信息	17,700	117,351.00	0.04
536	000157	中联重科	21,500	116,960.00	0.04
537	002378	章源钨业	16,600	116,864.00	0.04
538	600428	中远海特	19,600	116,816.00	0.04
539	600483	福能股份	11,000	116,380.00	0.04
540	600196	复星医药	3,300	116,292.00	0.04
541	002384	东山精密	4,700	116,231.00	0.04
542	002833	弘亚数控	9,400	115,902.00	0.04
543	601021	春秋航空	1,800	115,650.00	0.04
544	300455	康拓红外	15,600	115,596.00	0.04
545	603228	景旺电子	5,700	115,368.00	0.04
546	002518	科士达	2,000	115,200.00	0.04

547	000878	云南铜业	9,800	115,150.00	0.04
548	000791	甘肃电投	21,800	115,104.00	0.04
549	600682	南京新百	12,600	115,038.00	0.04
550	002158	汉钟精机	4,800	114,960.00	0.04
551	600170	上海建工	44,200	114,920.00	0.04
552	300762	上海瀚讯	8,700	114,666.00	0.04
553	600132	重庆啤酒	900	114,642.00	0.04
554	000682	东方电子	14,200	114,168.00	0.04
555	002271	东方雨虹	3,400	114,138.00	0.04
556	601989	中国重工	32,500	113,425.00	0.04
557	300443	金雷股份	2,800	112,784.00	0.04
558	000676	智度股份	21,300	112,677.00	0.04
559	002050	三花智控	5,300	112,466.00	0.04
560	002831	裕同科技	3,400	112,438.00	0.04
561	000059	华锦股份	16,500	112,200.00	0.04
562	600740	山西焦化	20,700	111,987.00	0.04
563	300203	聚光科技	3,300	111,870.00	0.04
564	300827	上能电气	1,900	111,796.00	0.04
565	601311	骆驼股份	13,700	111,792.00	0.04
566	002063	远光软件	14,700	111,573.00	0.04
567	600195	中牧股份	9,600	111,552.00	0.04
568	000810	创维数字	8,000	111,520.00	0.04
569	601869	长飞光纤	3,400	110,942.00	0.04
570	300085	银之杰	11,900	110,670.00	0.04
571	002214	大立科技	8,400	110,208.00	0.04
572	002736	国信证券	12,400	110,112.00	0.04
573	300841	康华生物	1,300	110,006.00	0.04
574	688321	微芯生物	5,000	109,900.00	0.04
575	002179	中航光电	1,900	109,744.00	0.04
576	002276	万马股份	13,300	109,725.00	0.04
577	002097	山河智能	18,600	109,554.00	0.04
578	688660	电气风电	18,200	109,382.00	0.04
579	603171	税友股份	3,000	109,200.00	0.04
580	000923	河钢资源	8,300	109,145.00	0.04
581	300846	首都在线	11,200	108,976.00	0.04
582	600602	云赛智联	12,500	108,875.00	0.03
583	600446	金证股份	10,500	108,045.00	0.03
584	688116	天奈科技	1,400	107,996.00	0.03
585	002698	博实股份	7,700	107,877.00	0.03
586	300408	三环集团	3,500	107,485.00	0.03
587	601890	亚星锚链	12,100	106,843.00	0.03
588	600699	均胜电子	7,600	106,780.00	0.03
589	002073	软控股份	17,300	106,395.00	0.03

590	600755	厦门国贸	14,900	106,386.00	0.03
591	300119	瑞普生物	5,700	106,077.00	0.03
592	002222	福晶科技	6,700	105,994.00	0.03
593	300136	信维通信	6,400	105,664.00	0.03
594	300770	新媒股份	2,800	105,448.00	0.03
595	300122	智飞生物	1,200	105,396.00	0.03
596	600775	南京熊猫	10,100	105,141.00	0.03
597	603936	博敏电子	8,600	105,092.00	0.03
598	600966	博汇纸业	11,800	104,902.00	0.03
599	002139	拓邦股份	10,100	104,737.00	0.03
600	300428	立中集团	4,200	103,950.00	0.03
601	300131	英唐智控	21,500	103,845.00	0.03
602	600391	航发科技	5,800	103,066.00	0.03
603	300628	亿联网络	1,700	103,003.00	0.03
604	600612	老凤祥	2,400	102,720.00	0.03
605	600567	山鹰国际	41,400	102,672.00	0.03
606	300724	捷佳伟创	900	102,618.00	0.03
607	603906	龙蟠科技	4,400	101,860.00	0.03
608	002463	沪电股份	8,540	101,626.00	0.03
609	300406	九强生物	6,200	101,494.00	0.03
610	003037	三和管桩	9,000	101,340.00	0.03
611	688676	金盘科技	2,800	101,304.00	0.03
612	600820	隧道股份	19,200	101,184.00	0.03
613	002545	东方铁塔	12,200	101,138.00	0.03
614	002741	光华科技	5,600	101,080.00	0.03
615	600958	东方证券	11,300	101,022.00	0.03
616	002372	伟星新材	4,700	100,298.00	0.03
617	300499	高澜股份	10,100	100,293.00	0.03
618	601600	中国铝业	22,400	100,128.00	0.03
619	000560	我爱我家	40,000	100,000.00	0.03
620	002738	中矿资源	1,500	99,990.00	0.03
621	600745	闻泰科技	1,900	99,902.00	0.03
622	600549	厦门钨业	5,100	99,705.00	0.03
623	605117	德业股份	300	99,360.00	0.03
624	603127	昭衍新药	1,700	99,297.00	0.03
625	600885	宏发股份	2,960	98,893.60	0.03
626	000761	本钢板材	33,500	98,825.00	0.03
627	000901	航天科技	12,100	98,736.00	0.03
628	002293	罗莱生活	8,800	98,736.00	0.03
629	300143	盈康生命	9,700	98,649.00	0.03
630	600435	北方导航	8,500	98,600.00	0.03
631	300447	全信股份	6,400	98,560.00	0.03
632	002984	森麒麟	3,200	98,528.00	0.03

633	688122	西部超导	1,040	98,477.60	0.03
634	002425	凯撒文化	20,700	98,325.00	0.03
635	002216	三全食品	5,300	98,103.00	0.03
636	688389	普门科技	5,500	98,065.00	0.03
637	002237	恒邦股份	9,300	98,022.00	0.03
638	002192	融捷股份	1,000	97,900.00	0.03
639	002285	世联行	29,700	97,713.00	0.03
640	002217	合力泰	38,300	97,665.00	0.03
641	002250	联化科技	6,300	97,650.00	0.03
642	300017	网宿科技	17,400	97,092.00	0.03
643	601698	中国卫通	8,500	97,070.00	0.03
644	600645	中源协和	5,700	96,957.00	0.03
645	300666	江丰电子	1,400	96,880.00	0.03
646	000550	江铃汽车	7,200	96,696.00	0.03
647	300020	银江技术	15,300	96,543.00	0.03
648	002601	龙佰集团	5,100	96,492.00	0.03
649	300142	沃森生物	2,400	96,456.00	0.03
650	000600	建投能源	18,300	96,075.00	0.03
651	600500	中化国际	14,500	95,845.00	0.03
652	002344	海宁皮城	20,400	95,676.00	0.03
653	000729	燕京啤酒	9,000	95,580.00	0.03
654	601665	齐鲁银行	22,900	95,493.00	0.03
655	002294	信立泰	2,900	95,265.00	0.03
656	600167	联美控股	15,000	94,800.00	0.03
657	688063	派能科技	300	94,695.00	0.03
658	603868	飞科电器	1,400	94,262.00	0.03
659	300735	光弘科技	10,600	94,128.00	0.03
660	300058	蓝色光标	18,600	93,930.00	0.03
661	000999	华润三九	2,000	93,620.00	0.03
662	002625	光启技术	5,500	93,610.00	0.03
663	600598	北大荒	6,800	93,568.00	0.03
664	600163	中闽能源	17,400	93,438.00	0.03
665	300777	中简科技	1,900	93,385.00	0.03
666	600688	上海石化	29,900	92,989.00	0.03
667	300181	佐力药业	8,700	92,829.00	0.03
668	601168	西部矿业	9,100	92,820.00	0.03
669	000625	长安汽车	7,540	92,817.40	0.03
670	601515	东风股份	21,500	92,450.00	0.03
671	600552	凯盛科技	10,000	92,400.00	0.03
672	002614	奥佳华	9,900	92,367.00	0.03
673	603786	科博达	1,400	92,162.00	0.03
674	002918	蒙娜丽莎	5,100	91,698.00	0.03
675	301236	软通动力	2,600	91,468.00	0.03

676	603801	志邦家居	3,400	91,392.00	0.03
677	000733	振华科技	800	91,384.00	0.03
678	603260	合盛硅业	1,100	91,234.00	0.03
679	300355	蒙草生态	29,800	91,188.00	0.03
680	601588	北辰实业	44,700	91,188.00	0.03
681	300065	海兰信	6,900	91,149.00	0.03
682	601333	广深铁路	40,100	91,027.00	0.03
683	688520	神州细胞	1,500	90,900.00	0.03
684	002042	华孚时尚	29,700	90,585.00	0.03
685	301090	华润材料	9,000	90,540.00	0.03
686	601717	郑煤机	8,100	90,396.00	0.03
687	300055	万邦达	11,200	90,272.00	0.03
688	300496	中科创达	900	90,270.00	0.03
689	601598	中国外运	23,500	90,240.00	0.03
690	600704	物产中大	18,700	89,947.00	0.03
691	600751	海航科技	38,600	89,938.00	0.03
692	600586	金晶科技	10,300	89,713.00	0.03
693	601099	太平洋	34,900	89,693.00	0.03
694	600126	杭钢股份	21,700	89,621.00	0.03
695	300768	迪普科技	6,800	89,488.00	0.03
696	300861	美畅股份	1,820	89,471.20	0.03
697	600060	海信视像	6,600	89,364.00	0.03
698	601949	中国出版	17,900	89,321.00	0.03
699	002967	广电计量	5,300	88,934.00	0.03
700	300033	同花顺	900	88,749.00	0.03
701	002034	旺能环境	4,900	88,396.00	0.03
702	600008	首创环保	31,200	88,296.00	0.03
703	603877	太平鸟	4,800	88,272.00	0.03
704	000100	TCL科技	23,700	88,164.00	0.03
705	000895	双汇发展	3,400	88,162.00	0.03
706	600871	石化油服	44,500	88,110.00	0.03
707	603899	晨光股份	1,600	87,968.00	0.03
708	603317	天味食品	3,200	87,936.00	0.03
709	002966	苏州银行	11,300	87,914.00	0.03
710	300318	博晖创新	15,000	87,750.00	0.03
711	300633	开立医疗	1,600	87,728.00	0.03
712	603298	杭叉集团	5,200	87,412.00	0.03
713	688526	科前生物	3,900	87,360.00	0.03
714	301078	孩子王	6,700	86,765.00	0.03
715	600917	重庆燃气	10,900	86,764.00	0.03
716	600323	瀚蓝环境	4,700	86,762.00	0.03
717	600370	三房巷	28,400	86,052.00	0.03
718	603882	金域医学	1,100	86,020.00	0.03

719	000937	冀中能源	13,483	85,751.88	0.03
720	002724	海洋王	10,600	85,648.00	0.03
721	600841	动力新科	14,100	85,587.00	0.03
722	601868	中国能建	37,300	85,417.00	0.03
723	002444	巨星科技	4,500	85,410.00	0.03
724	000786	北新建材	3,300	85,404.00	0.03
725	605138	盛泰集团	7,900	85,004.00	0.03
726	300593	新雷能	2,000	84,960.00	0.03
727	605007	五洲特纸	4,500	84,825.00	0.03
728	603719	良品铺子	2,300	84,801.00	0.03
729	603501	韦尔股份	1,100	84,799.00	0.03
730	300604	长川科技	1,900	84,702.00	0.03
731	001979	招商蛇口	6,700	84,621.00	0.03
732	688578	艾力斯	4,296	84,545.28	0.03
733	002163	海南发展	7,400	84,434.00	0.03
734	002421	达实智能	24,400	84,424.00	0.03
735	600258	首旅酒店	3,400	84,320.00	0.03
736	000966	长源电力	18,200	84,266.00	0.03
737	002677	浙江美大	7,600	84,208.00	0.03
738	603885	吉祥航空	5,200	84,136.00	0.03
739	002410	广联达	1,400	83,930.00	0.03
740	600971	恒源煤电	11,700	83,772.00	0.03
741	600098	广州发展	15,000	83,250.00	0.03
742	600449	宁夏建材	7,000	83,090.00	0.03
743	002299	圣农发展	3,500	82,915.00	0.03
744	601669	中国电建	11,700	82,836.00	0.03
745	000019	深粮控股	11,000	82,610.00	0.03
746	605296	神农集团	3,300	82,599.00	0.03
747	600827	百联股份	6,800	82,416.00	0.03
748	000807	云铝股份	7,400	82,288.00	0.03
749	601011	宝泰隆	23,700	82,239.00	0.03
750	600072	中船科技	6,900	82,110.00	0.03
751	600691	阳煤化工	26,100	81,954.00	0.03
752	600718	东软集团	8,200	81,590.00	0.03
753	603960	克来机电	4,600	81,558.00	0.03
754	600808	马钢股份	29,000	81,490.00	0.03
755	002555	三七互娱	4,500	81,450.00	0.03
756	002236	大华股份	7,200	81,432.00	0.03
757	000027	深圳能源	12,800	81,408.00	0.03
758	603606	东方电缆	1,200	81,396.00	0.03
759	603103	横店影视	5,500	81,070.00	0.03
760	002194	武汉凡谷	8,800	81,048.00	0.03
761	600839	四川长虹	30,600	80,784.00	0.03

762	600155	华创阳安	12,400	80,600.00	0.03
763	688516	奥特维	400	80,400.00	0.03
764	601666	平煤股份	7,400	79,994.00	0.03
765	600935	华塑股份	17,700	79,650.00	0.03
766	603279	景津装备	2,700	79,596.00	0.03
767	688111	金山办公	300	79,347.00	0.03
768	603233	大参林	2,000	79,200.00	0.03
769	002120	韵达股份	5,500	79,090.00	0.03
770	300070	碧水源	16,700	78,991.00	0.03
771	002709	天赐材料	1,800	78,948.00	0.03
772	000061	农产品	13,800	78,660.00	0.03
773	600329	达仁堂	2,700	78,570.00	0.03
774	002891	中宠股份	3,500	78,085.00	0.03
775	000703	恒逸石化	11,100	78,033.00	0.03
776	000932	华菱钢铁	16,600	78,020.00	0.03
777	600621	华鑫股份	7,500	77,475.00	0.02
778	600120	浙江东方	21,600	77,112.00	0.02
779	600909	华安证券	16,800	77,112.00	0.02
780	300257	开山股份	5,100	76,500.00	0.02
781	603456	九洲药业	1,800	76,374.00	0.02
782	600667	太极实业	14,700	75,852.00	0.02
783	002416	爱施德	8,000	75,840.00	0.02
784	002221	东华能源	9,900	75,537.00	0.02
785	002387	维信诺	11,900	75,446.00	0.02
786	601568	北元集团	13,300	75,411.00	0.02
787	000683	远兴能源	9,600	75,264.00	0.02
788	600507	方大特钢	12,500	75,250.00	0.02
789	300855	图南股份	1,600	74,864.00	0.02
790	601877	正泰电器	2,700	74,790.00	0.02
791	601921	浙版传媒	10,100	74,740.00	0.02
792	600787	中储股份	15,000	74,550.00	0.02
793	002267	陕天然气	10,300	74,263.00	0.02
794	603901	永创智能	4,700	74,260.00	0.02
795	002373	千方科技	8,300	74,036.00	0.02
796	601118	海南橡胶	16,900	74,022.00	0.02
797	600075	新疆天业	13,500	73,845.00	0.02
798	002202	金风科技	6,700	73,700.00	0.02
799	605388	均瑶健康	4,900	73,696.00	0.02
800	603678	火炬电子	1,800	73,692.00	0.02
801	000987	越秀资本	12,300	73,677.00	0.02
802	601718	际华集团	25,300	73,623.00	0.02
803	603712	七一二	2,100	73,332.00	0.02
804	002303	美盈森	20,600	72,924.00	0.02

805	000657	中钨高新	4,600	72,864.00	0.02
806	603883	老百姓	1,800	72,846.00	0.02
807	002524	光正眼科	10,200	72,828.00	0.02
808	601860	紫金银行	28,100	72,779.00	0.02
809	601015	陕西黑猫	16,000	72,640.00	0.02
810	002301	齐心集团	10,800	72,468.00	0.02
811	600642	申能股份	13,200	72,468.00	0.02
812	603301	振德医疗	1,900	72,295.00	0.02
813	600717	天津港	17,600	72,160.00	0.02
814	600460	士兰微	2,200	72,138.00	0.02
815	603328	依顿电子	11,100	72,039.00	0.02
816	300758	七彩化学	6,000	71,400.00	0.02
817	600501	航天晨光	6,500	71,370.00	0.02
818	000009	中国宝安	5,900	71,331.00	0.02
819	601066	中信建投	3,000	71,250.00	0.02
820	002131	利欧股份	40,200	71,154.00	0.02
821	002412	汉森制药	11,600	71,108.00	0.02
822	000898	鞍钢股份	26,600	71,022.00	0.02
823	600535	天士力	6,600	71,016.00	0.02
824	688772	珠海冠宇	3,800	70,832.00	0.02
825	600760	中航沈飞	1,200	70,356.00	0.02
826	000997	新大陆	5,400	70,254.00	0.02
827	002226	江南化工	14,300	70,070.00	0.02
828	600307	酒钢宏兴	42,400	69,960.00	0.02
829	688778	厦钨新能	900	69,912.00	0.02
830	002088	鲁阳节能	3,000	69,360.00	0.02
831	600282	南钢股份	22,000	69,300.00	0.02
832	002468	申通快递	6,700	69,211.00	0.02
833	603348	文灿股份	1,200	69,084.00	0.02
834	600373	中文传媒	7,200	68,904.00	0.02
835	600811	东方集团	28,100	68,564.00	0.02
836	600637	东方明珠	10,300	68,495.00	0.02
837	300373	扬杰科技	1,300	68,380.00	0.02
838	601158	重庆水务	13,300	68,229.00	0.02
839	601198	东兴证券	8,800	67,936.00	0.02
840	603309	维力医疗	3,400	67,932.00	0.02
841	600032	浙江新能	5,900	67,791.00	0.02
842	000402	金融街	12,900	67,725.00	0.02
843	605009	豪悦护理	1,300	67,431.00	0.02
844	600648	外高桥	5,600	66,920.00	0.02
845	600967	内蒙一机	8,100	66,906.00	0.02
846	600153	建发股份	4,900	66,885.00	0.02
847	000555	神州信息	6,200	66,774.00	0.02

848	603337	杰克股份	3,500	66,640.00	0.02
849	601828	美凯龙	14,200	66,598.00	0.02
850	002176	江特电机	3,800	66,310.00	0.02
851	300527	中船应急	10,000	66,300.00	0.02
852	601058	赛轮轮胎	6,600	66,132.00	0.02
853	600389	江山股份	1,500	66,120.00	0.02
854	002409	雅克科技	1,300	65,481.00	0.02
855	600452	涪陵电力	4,300	64,930.00	0.02
856	601778	晶科科技	11,800	64,900.00	0.02
857	300075	数字政通	3,700	64,861.00	0.02
858	600522	中天科技	4,000	64,600.00	0.02
859	600325	华发股份	7,100	64,326.00	0.02
860	600707	彩虹股份	15,500	64,170.00	0.02
861	600563	法拉电子	400	63,952.00	0.02
862	000563	陕国投 A	21,100	63,933.00	0.02
863	600998	九州通	4,900	63,896.00	0.02
864	601098	中南传媒	6,400	63,872.00	0.02
865	002234	民和股份	3,300	63,822.00	0.02
866	688036	传音控股	800	63,616.00	0.02
867	600643	爱建集团	11,400	62,928.00	0.02
868	601952	苏垦农发	5,300	62,752.00	0.02
869	002195	二三四五	31,200	62,712.00	0.02
870	600376	首开股份	11,000	62,590.00	0.02
871	300315	掌趣科技	19,400	62,274.00	0.02
872	002241	歌尔股份	3,700	62,271.00	0.02
873	300296	利亚德	11,000	62,260.00	0.02
874	002367	康力电梯	8,300	62,250.00	0.02
875	000540	中天金融	41,200	62,212.00	0.02
876	002051	中工国际	7,900	62,173.00	0.02
877	601236	红塔证券	8,400	62,160.00	0.02
878	002146	荣盛发展	28,600	62,062.00	0.02
879	601330	绿色动力	9,100	61,607.00	0.02
880	300292	吴通控股	21,000	61,530.00	0.02
881	601992	金隅集团	24,200	61,468.00	0.02
882	600901	江苏金租	11,200	61,376.00	0.02
883	601702	华峰铝业	4,100	61,295.00	0.02
884	601901	方正证券	9,600	61,248.00	0.02
885	603258	电魂网络	2,800	61,236.00	0.02
886	002993	奥海科技	1,800	61,218.00	0.02
887	002283	天润工业	12,800	61,184.00	0.02
888	603833	欧派家居	500	60,765.00	0.02
889	002414	高德红外	5,500	60,500.00	0.02
890	300832	新产业	1,200	60,168.00	0.02

891	300079	数码视讯	12,500	59,875.00	0.02
892	000538	云南白药	1,100	59,796.00	0.02
893	000709	河钢股份	26,400	59,664.00	0.02
894	301071	力量钻石	500	59,575.00	0.02
895	000723	美锦能源	6,600	59,532.00	0.02
896	000830	鲁西化工	4,800	59,472.00	0.02
897	600916	中国黄金	4,700	59,408.00	0.02
898	002061	浙江交科	11,200	59,360.00	0.02
899	002032	苏泊尔	1,200	59,352.00	0.02
900	601997	贵阳银行	10,800	59,292.00	0.02
901	688505	复旦张江	7,090	59,201.50	0.02
902	002266	浙富控股	15,000	58,650.00	0.02
903	601238	广汽集团	5,300	58,459.00	0.02
904	600348	华阳股份	4,100	58,425.00	0.02
905	002281	光迅科技	3,700	58,164.00	0.02
906	003020	立方制药	1,800	58,140.00	0.02
907	600299	安迪苏	7,000	57,820.00	0.02
908	000603	盛达资源	4,600	57,776.00	0.02
909	688029	南微医学	700	57,491.00	0.02
910	000975	银泰黄金	5,200	57,408.00	0.02
911	600705	中航产融	17,400	57,072.00	0.02
912	002110	三钢闽光	12,100	56,870.00	0.02
913	688348	昱能科技	100	56,850.00	0.02
914	300031	宝通科技	4,100	56,703.00	0.02
915	000415	渤海租赁	25,600	56,576.00	0.02
916	603997	继峰股份	3,700	56,536.00	0.02
917	300397	天和防务	6,100	56,486.00	0.02
918	002008	大族激光	2,200	56,430.00	0.02
919	002240	盛新锂能	1,500	56,235.00	0.02
920	600392	盛和资源	4,000	56,000.00	0.02
921	000401	冀东水泥	6,800	55,964.00	0.02
922	000060	中金岭南	13,600	55,760.00	0.02
923	002048	宁波华翔	4,000	55,600.00	0.02
924	600256	广汇能源	6,100	55,022.00	0.02
925	002557	洽洽食品	1,100	55,000.00	0.02
926	002961	瑞达期货	4,100	54,653.00	0.02
927	600875	东方电气	2,600	54,652.00	0.02
928	003816	中国广核	20,300	54,607.00	0.02
929	002500	山西证券	10,300	54,590.00	0.02
930	000893	亚钾国际	2,000	54,360.00	0.02
931	600372	中航电子	3,400	54,298.00	0.02
932	603979	金诚信	2,100	53,781.00	0.02
933	000768	中航西飞	2,100	53,445.00	0.02

934	000546	金圆股份	4,400	53,328.00	0.02
935	601633	长城汽车	1,800	53,316.00	0.02
936	002841	视源股份	900	53,136.00	0.02
937	300673	佩蒂股份	3,000	52,950.00	0.02
938	605199	葫芦娃	3,300	52,866.00	0.02
939	600480	凌云股份	6,200	52,762.00	0.02
940	300682	朗新科技	2,400	52,752.00	0.02
941	301029	怡合达	800	52,592.00	0.02
942	000778	新兴铸管	14,400	52,560.00	0.02
943	002001	新和成	2,800	52,500.00	0.02
944	002563	森马服饰	10,000	52,400.00	0.02
945	000933	神火股份	3,500	52,360.00	0.02
946	600131	国网信通	3,500	52,360.00	0.02
947	601216	君正集团	13,100	52,269.00	0.02
948	603056	德邦股份	2,500	52,075.00	0.02
949	601233	桐昆股份	3,600	52,020.00	0.02
950	601005	重庆钢铁	32,900	51,982.00	0.02
951	002429	兆驰股份	14,800	51,652.00	0.02
952	688295	中复神鹰	1,187	51,242.79	0.02
953	688561	奇安信	778	51,169.06	0.02
954	000507	珠海港	9,100	51,051.00	0.02
955	600377	宁沪高速	6,200	50,964.00	0.02
956	002572	索菲亚	2,800	50,848.00	0.02
957	600584	长电科技	2,200	50,710.00	0.02
958	603267	鸿远电子	500	50,580.00	0.02
959	300699	光威复材	700	50,575.00	0.02
960	000050	深天马A	5,800	50,228.00	0.02
961	300888	稳健医疗	700	50,050.00	0.02
962	601865	福莱特	1,500	49,965.00	0.02
963	000998	隆平高科	3,100	49,817.00	0.02
964	002400	省广集团	11,600	49,648.00	0.02
965	601995	中金公司	1,300	49,569.00	0.02
966	300529	健帆生物	1,600	49,552.00	0.02
967	600169	太原重工	20,800	49,504.00	0.02
968	600970	中材国际	5,800	49,416.00	0.02
969	600959	江苏有线	16,600	49,302.00	0.02
970	601963	重庆银行	7,200	48,816.00	0.02
971	000738	航发控制	1,900	48,716.00	0.02
972	600096	云天化	2,300	48,392.00	0.02
973	601187	厦门银行	8,400	48,132.00	0.02
974	000581	威孚高科	2,700	47,871.00	0.02
975	688819	天能股份	1,300	47,762.00	0.02
976	002405	四维图新	4,300	47,386.00	0.02

977	002385	大北农	5,300	47,170.00	0.02
978	002955	鸿合科技	2,000	47,100.00	0.02
979	601139	深圳燃气	7,200	47,088.00	0.02
980	601077	渝农商行	13,200	46,596.00	0.01
981	600395	盘江股份	6,900	46,368.00	0.01
982	688658	悦康药业	2,400	46,368.00	0.01
983	300532	今天国际	3,200	46,336.00	0.01
984	603858	步长制药	2,200	46,222.00	0.01
985	002074	国轩高科	1,600	46,128.00	0.01
986	600280	中央商场	14,100	46,107.00	0.01
987	000930	中粮科技	5,500	45,980.00	0.01
988	600201	生物股份	5,100	45,951.00	0.01
989	600763	通策医疗	300	45,897.00	0.01
990	002458	益生股份	3,300	45,870.00	0.01
991	600237	铜峰电子	7,200	45,792.00	0.01
992	002081	金螳螂	9,400	45,590.00	0.01
993	600363	联创光电	1,900	45,239.00	0.01
994	688722	同益中	2,500	45,150.00	0.01
995	300454	深信服	400	45,020.00	0.01
996	002368	太极股份	1,600	45,008.00	0.01
997	000623	吉林敖东	3,000	44,970.00	0.01
998	300957	贝泰妮	300	44,772.00	0.01
999	002233	塔牌集团	6,300	44,730.00	0.01
1,000	600085	同仁堂	1,000	44,680.00	0.01
1,001	002353	杰瑞股份	1,600	44,656.00	0.01
1,002	002635	安洁科技	3,600	44,460.00	0.01
1,003	600022	山东钢铁	30,000	44,400.00	0.01
1,004	600236	桂冠电力	7,700	44,352.00	0.01
1,005	002936	郑州银行	18,800	44,180.00	0.01
1,006	600400	红豆股份	10,700	44,084.00	0.01
1,007	002595	豪迈科技	1,900	43,985.00	0.01
1,008	001203	大中矿业	3,400	43,962.00	0.01
1,009	605060	联德股份	1,700	43,877.00	0.01
1,010	002397	梦洁股份	9,700	43,844.00	0.01
1,011	603486	科沃斯	600	43,764.00	0.01
1,012	000958	电投产融	9,800	43,708.00	0.01
1,013	600984	建设机械	8,000	43,680.00	0.01
1,014	300308	中际旭创	1,600	43,248.00	0.01
1,015	002317	众生药业	1,600	43,184.00	0.01
1,016	300320	海达股份	4,200	43,092.00	0.01
1,017	600064	南京高科	6,500	42,965.00	0.01
1,018	000825	太钢不锈	9,900	42,768.00	0.01
1,019	603379	三美股份	1,500	42,690.00	0.01

1,020	301025	读客文化	4,200	42,546.00	0.01
1,021	600369	西南证券	11,300	42,375.00	0.01
1,022	300207	欣旺达	2,000	42,300.00	0.01
1,023	688396	华润微	800	42,120.00	0.01
1,024	600350	山东高速	7,400	42,106.00	0.01
1,025	600066	宇通客车	5,600	42,056.00	0.01
1,026	600927	永安期货	2,600	41,912.00	0.01
1,027	000559	万向钱潮	8,600	41,882.00	0.01
1,028	603638	艾迪精密	2,800	41,776.00	0.01
1,029	600623	华谊集团	6,600	41,712.00	0.01
1,030	688598	金博股份	190	41,701.20	0.01
1,031	600208	新湖中宝	16,400	41,656.00	0.01
1,032	600166	福田汽车	14,800	41,588.00	0.01
1,033	300866	安克创新	700	41,489.00	0.01
1,034	300284	苏交科	7,400	41,440.00	0.01
1,035	600764	中国海防	1,800	41,328.00	0.01
1,036	300184	力源信息	9,600	41,280.00	0.01
1,037	002829	星网宇达	1,200	41,268.00	0.01
1,038	601611	中国核建	5,400	41,040.00	0.01
1,039	000739	普洛药业	1,900	40,926.00	0.01
1,040	600597	光明乳业	3,800	40,888.00	0.01
1,041	603136	天目湖	1,500	40,725.00	0.01
1,042	300251	光线传媒	4,700	40,702.00	0.01
1,043	002465	海格通信	5,000	40,600.00	0.01
1,044	603086	先达股份	3,100	40,579.00	0.01
1,045	002683	广东宏大	1,500	40,440.00	0.01
1,046	000883	湖北能源	9,600	40,320.00	0.01
1,047	600006	东风汽车	7,200	40,176.00	0.01
1,048	600037	歌华有线	4,900	39,886.00	0.01
1,049	600895	张江高科	3,500	39,690.00	0.01
1,050	600502	安徽建工	8,200	39,360.00	0.01
1,051	600489	中金黄金	4,800	39,312.00	0.01
1,052	300353	东土科技	4,400	39,248.00	0.01
1,053	002505	鹏都农牧	15,200	39,216.00	0.01
1,054	300662	科锐国际	800	39,200.00	0.01
1,055	600397	安源煤业	12,800	38,784.00	0.01
1,056	600332	白云山	1,300	38,727.00	0.01
1,057	601200	上海环境	4,300	38,399.00	0.01
1,058	300311	任子行	6,300	38,304.00	0.01
1,059	300271	华宇软件	5,600	38,248.00	0.01
1,060	000727	冠捷科技	19,400	38,218.00	0.01
1,061	300365	恒华科技	5,000	38,050.00	0.01
1,062	002249	大洋电机	7,400	37,888.00	0.01

1,063	601577	长沙银行	5,600	37,856.00	0.01
1,064	000089	深圳机场	4,800	37,728.00	0.01
1,065	300686	智动力	3,100	37,200.00	0.01
1,066	300575	中旗股份	1,700	37,179.00	0.01
1,067	300848	美瑞新材	1,400	37,016.00	0.01
1,068	603429	集友股份	3,400	36,992.00	0.01
1,069	300978	东箭科技	3,300	36,828.00	0.01
1,070	000301	东方盛虹	2,800	36,512.00	0.01
1,071	002867	周大生	2,600	36,478.00	0.01
1,072	603633	徕木股份	2,500	36,425.00	0.01
1,073	002007	华兰生物	1,600	36,208.00	0.01
1,074	300403	汉宇集团	6,100	35,990.00	0.01
1,075	002107	沃华医药	5,800	35,960.00	0.01
1,076	603225	新凤鸣	3,300	35,904.00	0.01
1,077	300179	四方达	2,900	35,844.00	0.01
1,078	600655	豫园股份	4,700	35,767.00	0.01
1,079	301269	华大九天	406	35,703.64	0.01
1,080	600361	创新新材	5,800	35,148.00	0.01
1,081	002440	闰土股份	4,800	34,800.00	0.01
1,082	001213	中铁特货	8,000	34,560.00	0.01
1,083	600378	昊华科技	800	34,328.00	0.01
1,084	002565	顺灏股份	8,400	34,272.00	0.01
1,085	600084	中葡股份	4,700	34,216.00	0.01
1,086	600177	雅戈尔	5,400	34,182.00	0.01
1,087	300073	当升科技	600	33,840.00	0.01
1,088	000598	兴蓉环境	6,900	33,741.00	0.01
1,089	601106	中国一重	11,500	33,695.00	0.01
1,090	600271	航天信息	3,200	33,312.00	0.01
1,091	300547	川环科技	2,300	33,212.00	0.01
1,092	600872	中炬高新	900	33,183.00	0.01
1,093	002578	闽发铝业	7,600	32,908.00	0.01
1,094	600884	杉杉股份	1,800	32,760.00	0.01
1,095	002788	鹭燕医药	3,900	32,487.00	0.01
1,096	688567	孚能科技	1,200	32,436.00	0.01
1,097	002155	湖南黄金	2,500	32,375.00	0.01
1,098	600836	上海易连	5,100	32,334.00	0.01
1,099	300691	联合光电	2,600	32,318.00	0.01
1,100	688390	固德威	100	32,309.00	0.01
1,101	603867	新化股份	1,000	32,300.00	0.01
1,102	000977	浪潮信息	1,500	32,280.00	0.01
1,103	600255	鑫科材料	12,500	32,250.00	0.01
1,104	000959	首钢股份	8,500	32,045.00	0.01
1,105	300194	福安药业	8,900	32,040.00	0.01

1,106	600390	五矿资本	6,300	32,004.00	0.01
1,107	601991	大唐发电	11,400	31,806.00	0.01
1,108	300248	新开普	3,600	31,680.00	0.01
1,109	300433	蓝思科技	3,000	31,590.00	0.01
1,110	300601	康泰生物	1,000	31,530.00	0.01
1,111	603227	雪峰科技	3,800	31,502.00	0.01
1,112	300168	万达信息	3,700	31,191.00	0.01
1,113	600780	通宝能源	4,800	30,816.00	0.01
1,114	002306	中科云网	5,800	30,798.00	0.01
1,115	600511	国药股份	1,100	30,690.00	0.01
1,116	300541	先进数通	2,700	30,645.00	0.01
1,117	002573	清新环境	5,500	30,580.00	0.01
1,118	600528	中铁工业	4,000	30,520.00	0.01
1,119	603663	三祥新材	2,400	30,504.00	0.01
1,120	002560	通达股份	4,400	30,008.00	0.01
1,121	601878	浙商证券	3,000	29,790.00	0.01
1,122	002587	奥拓电子	5,900	29,736.00	0.01
1,123	600077	宋都股份	11,200	29,680.00	0.01
1,124	300326	凯利泰	4,100	29,520.00	0.01
1,125	002478	常宝股份	5,200	29,276.00	0.01
1,126	001267	汇绿生态	3,800	29,146.00	0.01
1,127	300360	炬华科技	2,000	29,100.00	0.01
1,128	600143	金发科技	3,000	29,070.00	0.01
1,129	600866	星湖科技	4,900	29,057.00	0.01
1,130	600023	浙能电力	8,300	28,967.00	0.01
1,131	300903	科翔股份	2,500	28,900.00	0.01
1,132	002396	星网锐捷	1,500	28,740.00	0.01
1,133	601155	新城控股	1,400	28,700.00	0.01
1,134	603195	公牛集团	200	28,652.00	0.01
1,135	002238	天威视讯	4,300	28,423.00	0.01
1,136	300511	雪榕生物	4,400	28,380.00	0.01
1,137	002169	智光电气	3,700	28,305.00	0.01
1,138	300341	麦克奥迪	3,200	28,192.00	0.01
1,139	002886	沃特股份	1,700	28,186.00	0.01
1,140	300223	北京君正	400	28,176.00	0.01
1,141	600475	华光环能	3,200	28,128.00	0.01
1,142	000719	中原传媒	3,500	28,105.00	0.01
1,143	002925	盈趣科技	1,700	28,084.00	0.01
1,144	605196	华通线缆	4,000	27,920.00	0.01
1,145	002681	奋达科技	7,400	27,898.00	0.01
1,146	000922	佳电股份	3,100	27,807.00	0.01
1,147	000521	长虹美菱	6,600	27,786.00	0.01
1,148	002958	青农商行	9,600	27,744.00	0.01

1,149	002133	广宇集团	7,900	27,729.00	0.01
1,150	002035	华帝股份	5,000	27,700.00	0.01
1,151	002947	恒铭达	1,400	27,650.00	0.01
1,152	605018	长华集团	2,700	27,648.00	0.01
1,153	600498	烽火通信	2,100	27,594.00	0.01
1,154	603626	科森科技	4,200	27,552.00	0.01
1,155	688005	容百科技	400	27,500.00	0.01
1,156	605020	永和股份	700	27,496.00	0.01
1,157	603496	恒为科技	1,800	27,378.00	0.01
1,158	300066	三川智慧	5,500	27,280.00	0.01
1,159	002010	传化智联	5,100	27,234.00	0.01
1,160	002957	科瑞技术	1,800	27,234.00	0.01
1,161	300113	顺网科技	2,600	27,066.00	0.01
1,162	600129	太极集团	900	27,054.00	0.01
1,163	001205	盛航股份	1,100	26,972.00	0.01
1,164	300552	万集科技	1,500	26,895.00	0.01
1,165	688313	仕佳光子	2,962	26,806.10	0.01
1,166	300531	优博讯	2,100	26,775.00	0.01
1,167	603256	宏和科技	4,100	26,732.00	0.01
1,168	600973	宝胜股份	5,600	26,712.00	0.01
1,169	300774	倍杰特	2,300	26,703.00	0.01
1,170	002401	中远海科	2,400	26,400.00	0.01
1,171	688609	九联科技	4,000	26,360.00	0.01
1,172	601228	广州港	8,300	26,145.00	0.01
1,173	002996	顺博合金	2,000	26,060.00	0.01
1,174	002152	广电运通	2,600	25,844.00	0.01
1,175	001965	招商公路	3,300	25,641.00	0.01
1,176	603939	益丰药房	400	25,536.00	0.01
1,177	601799	星宇股份	200	25,474.00	0.01
1,178	002783	凯龙股份	3,000	25,470.00	0.01
1,179	002562	兄弟科技	5,400	25,380.00	0.01
1,180	600987	航民股份	3,500	25,375.00	0.01
1,181	603787	新日股份	1,400	25,340.00	0.01
1,182	300003	乐普医疗	1,100	25,267.00	0.01
1,183	603421	鼎信通讯	3,000	25,110.00	0.01
1,184	603189	网达软件	1,800	25,056.00	0.01
1,185	002937	兴瑞科技	1,100	24,915.00	0.01
1,186	605598	上海港湾	1,000	24,900.00	0.01
1,187	600765	中航重机	800	24,872.00	0.01
1,188	002203	海亮股份	2,200	24,860.00	0.01
1,189	002196	方正电机	3,400	24,684.00	0.01
1,190	300570	太辰光	1,700	24,582.00	0.01
1,191	688065	凯赛生物	400	24,516.00	0.01

1,192	300871	回盛生物	1,200	24,480.00	0.01
1,193	600609	金杯汽车	5,800	24,244.00	0.01
1,194	300490	华自科技	2,100	24,213.00	0.01
1,195	603815	交建股份	3,200	24,160.00	0.01
1,196	002437	誉衡药业	9,500	24,130.00	0.01
1,197	601388	怡球资源	7,200	24,048.00	0.01
1,198	600683	京投发展	5,200	23,972.00	0.01
1,199	603708	家家悦	1,900	23,921.00	0.01
1,200	688303	大全能源	500	23,840.00	0.01
1,201	600509	天富能源	4,600	23,828.00	0.01
1,202	688596	正帆科技	700	23,765.00	0.01
1,203	300684	中石科技	1,600	23,696.00	0.01
1,204	000726	鲁泰A	3,200	23,616.00	0.01
1,205	000078	海王生物	7,100	23,572.00	0.01
1,206	600565	迪马股份	10,900	23,544.00	0.01
1,207	002860	星帅尔	1,800	23,400.00	0.01
1,208	301017	漱玉平民	1,300	23,387.00	0.01
1,209	603818	曲美家居	3,700	23,310.00	0.01
1,210	000967	盈峰环境	5,100	23,154.00	0.01
1,211	603589	口子窖	400	23,068.00	0.01
1,212	300979	华利集团	400	22,844.00	0.01
1,213	300121	阳谷华泰	2,200	22,792.00	0.01
1,214	600487	亨通光电	1,500	22,590.00	0.01
1,215	600425	青松建化	6,100	22,509.00	0.01
1,216	603218	日月股份	1,100	22,330.00	0.01
1,217	000631	顺发恒业	6,500	22,230.00	0.01
1,218	002508	老板电器	800	22,208.00	0.01
1,219	002570	贝因美	4,100	22,181.00	0.01
1,220	601928	凤凰传媒	2,800	22,176.00	0.01
1,221	000822	山东海化	2,800	22,092.00	0.01
1,222	600339	中油工程	7,400	22,052.00	0.01
1,223	688187	时代电气	400	21,828.00	0.01
1,224	603383	顶点软件	500	21,820.00	0.01
1,225	601825	沪农商行	3,700	21,756.00	0.01
1,226	000553	安道麦A	2,400	21,720.00	0.01
1,227	300002	神州泰岳	5,000	21,700.00	0.01
1,228	002916	深南电路	300	21,645.00	0.01
1,229	605599	菜百股份	2,100	21,378.00	0.01
1,230	000869	张裕A	700	21,168.00	0.01
1,231	000619	海螺新材	3,300	20,922.00	0.01
1,232	300494	盛天网络	1,400	20,902.00	0.01
1,233	000917	电广传媒	4,000	20,720.00	0.01
1,234	300942	易瑞生物	1,200	20,568.00	0.01

1,235	002432	九安医疗	400	20,444.00	0.01
1,236	002632	道明光学	3,200	20,416.00	0.01
1,237	600728	佳都科技	3,800	20,064.00	0.01
1,238	300258	精锻科技	1,700	19,771.00	0.01
1,239	000530	冰山冷热	4,400	19,712.00	0.01
1,240	600686	金龙汽车	3,300	19,635.00	0.01
1,241	002869	金溢科技	900	19,368.00	0.01
1,242	601179	中国西电	4,200	19,362.00	0.01
1,243	301239	普瑞眼科	276	19,231.68	0.01
1,244	605050	福然德	1,500	19,200.00	0.01
1,245	002423	中粮资本	2,600	18,616.00	0.01
1,246	603517	绝味食品	300	18,327.00	0.01
1,247	002540	亚太科技	3,600	18,252.00	0.01
1,248	605077	华康股份	600	18,204.00	0.01
1,249	688383	新益昌	191	18,122.08	0.01
1,250	000783	长江证券	3,400	18,122.00	0.01
1,251	002745	木林森	2,200	17,842.00	0.01
1,252	605499	东鹏饮料	100	17,790.00	0.01
1,253	600794	保税科技	4,500	17,595.00	0.01
1,254	002480	新筑股份	3,400	17,340.00	0.01
1,255	603727	博迈科	1,500	17,190.00	0.01
1,256	600297	广汇汽车	8,100	17,010.00	0.01
1,257	000607	华媒控股	3,100	16,740.00	0.01
1,258	600559	老白干酒	600	16,518.00	0.01
1,259	002661	克明食品	1,400	16,492.00	0.01
1,260	000750	国海证券	4,900	16,317.00	0.01
1,261	000423	东阿阿胶	400	16,280.00	0.01
1,262	001227	兰州银行	4,300	16,211.00	0.01
1,263	002434	万里扬	2,000	16,100.00	0.01
1,264	301267	华夏眼科	238	15,755.60	0.01
1,265	688356	键凯科技	100	15,655.00	0.01
1,266	601016	节能风电	4,100	15,621.00	0.01
1,267	688639	华恒生物	100	15,525.00	0.00
1,268	603890	春秋电子	1,600	14,624.00	0.00
1,269	688185	康希诺	100	14,602.00	0.00
1,270	603300	华铁应急	2,300	14,582.00	0.00
1,271	600986	浙文互联	2,900	14,471.00	0.00
1,272	600106	重庆路桥	2,900	14,384.00	0.00
1,273	002673	西部证券	2,300	14,007.00	0.00
1,274	600343	航天动力	1,600	14,000.00	0.00
1,275	001301	尚太科技	236	13,933.44	0.00
1,276	600928	西安银行	3,900	13,728.00	0.00
1,277	688368	晶丰明源	122	13,627.40	0.00

1,278	688696	极米科技	80	13,296.00	0.00
1,279	002752	昇兴股份	2,500	13,000.00	0.00
1,280	600684	珠江股份	3,400	12,954.00	0.00
1,281	000728	国元证券	2,000	12,660.00	0.00
1,282	603658	安图生物	200	12,370.00	0.00
1,283	600109	国金证券	1,300	11,310.00	0.00
1,284	000800	一汽解放	1,400	10,822.00	0.00
1,285	688071	华依科技	191	10,793.41	0.00
1,286	688330	宏力达	169	10,761.92	0.00
1,287	301377	鼎泰高科	532	9,379.16	0.00
1,288	688112	鼎阳科技	100	9,325.00	0.00
1,289	688077	大地熊	180	8,937.00	0.00
1,290	688095	福昕软件	140	8,705.20	0.00
1,291	301363	美好医疗	224	8,478.40	0.00
1,292	688601	力芯微	140	7,894.60	0.00
1,293	688080	映翰通	182	7,476.56	0.00
1,294	301230	泓博医药	152	7,344.64	0.00
1,295	001289	龙源电力	400	7,308.00	0.00
1,296	301296	新巨丰	460	6,854.00	0.00
1,297	301223	中荣股份	371	6,726.23	0.00
1,298	688398	赛特新材	184	6,377.44	0.00
1,299	301311	昆船智能	393	6,232.98	0.00
1,300	301277	新天地	236	6,084.08	0.00
1,301	301265	华新环保	495	5,643.00	0.00
1,302	301282	金禄电子	218	5,504.50	0.00
1,303	301366	一博科技	120	5,410.80	0.00
1,304	301152	天力锂能	114	5,316.96	0.00
1,305	301273	瑞晨环保	139	5,252.81	0.00
1,306	000982	中银绒业	2,700	4,806.00	0.00
1,307	301379	天山电子	187	4,605.81	0.00
1,308	301176	逸豪新材	269	4,543.41	0.00
1,309	002526	山东矿机	1,700	3,791.00	0.00
1,310	301319	唯特偶	70	3,728.90	0.00
1,311	301398	星源卓镁	128	3,704.32	0.00
1,312	301313	凡拓数创	117	3,409.38	0.00
1,313	301276	嘉曼服饰	143	3,233.23	0.00
1,314	688698	伟创电气	155	3,210.05	0.00
1,315	301388	欣灵电气	148	3,196.80	0.00
1,316	301309	万得凯	130	3,179.80	0.00
1,317	002641	公元股份	700	3,080.00	0.00
1,318	301368	丰立智能	166	3,074.32	0.00
1,319	300237	美晨生态	1,300	2,860.00	0.00
1,320	301359	东南电子	133	2,646.70	0.00

1,321	301270	汉仪股份	90	2,553.30	0.00
1,322	301316	慧博云通	169	2,420.08	0.00

注：对于同时在A+H股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	14,560,269.00	2.92
2	601288	农业银行	14,550,708.00	2.92
3	601328	交通银行	13,243,652.00	2.66
4	601998	中信银行	13,118,253.00	2.63
5	000733	振华科技	10,757,976.35	2.16
6	600519	贵州茅台	10,357,444.00	2.08
7	601988	中国银行	10,346,374.00	2.08
8	601919	中远海控	9,999,843.90	2.01
9	002129	TCL中环	9,916,081.00	1.99
10	000568	泸州老窖	9,897,509.60	1.99
11	601939	建设银行	9,778,474.00	1.96
12	601166	兴业银行	9,457,532.00	1.90
13	000651	格力电器	9,442,296.00	1.90
14	603799	华友钴业	9,064,680.00	1.82
15	601899	紫金矿业	8,951,627.00	1.80
16	002594	比亚迪	8,459,664.00	1.70
17	601318	中国平安	8,423,798.00	1.69
18	601390	中国中铁	8,413,207.00	1.69
19	601319	中国人保	8,365,373.65	1.68
20	603259	药明康德	8,353,114.00	1.68

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	20,916,592.30	4.20
2	300750	宁德时代	16,461,448.00	3.30
3	601288	农业银行	14,519,672.00	2.92
4	600036	招商银行	12,872,303.00	2.58
5	601328	交通银行	12,521,195.56	2.51
6	601398	工商银行	12,232,738.02	2.46
7	601318	中国平安	11,922,100.00	2.39

8	601998	中信银行	11,842,151.00	2.38
9	601988	中国银行	11,321,276.00	2.27
10	000733	振华科技	10,981,406.20	2.20
11	601899	紫金矿业	10,968,542.00	2.20
12	002129	TCL中环	10,726,817.00	2.15
13	601166	兴业银行	10,695,831.00	2.15
14	000568	泸州老窖	10,627,771.00	2.13
15	600438	通威股份	10,488,746.00	2.11
16	603259	药明康德	10,213,724.28	2.05
17	601919	中远海控	10,165,762.00	2.04
18	601939	建设银行	9,843,092.23	1.98
19	300059	东方财富	9,403,583.78	1.89
20	601012	隆基绿能	9,116,563.44	1.83

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,384,534,417.38
卖出股票收入（成交）总额	2,373,245,004.96

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	10,130,323.29	3.26
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	20,643,260.27	6.64
7	可转债（可交换债）	31,254,444.39	10.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	62,028,027.95	19.94

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	102000297	20 苍南国投 MTN001	200,000	20,643,260.27	6.64
2	200009	20 附息国债 09	100,000	10,130,323.29	3.26

3	110059	浦发转债	38,360	4,025,083.27	1.29
4	113042	上银转债	38,110	4,001,470.65	1.29
5	113044	大秦转债	28,130	3,088,939.89	0.99

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划使用股指期货对冲组合的系统性风险，从而分离出组合的超额收益。根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货对冲。综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、套利机会、流动性等因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。

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

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本集合计划合同，本集合计划投资范围不包括国债期货。

8.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 184,793,787.97 元，占基金资产净值的比例为 59.40%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-167,436,200.00 元，占基金资产净值的比例为-53.82%，空头合约市值占股票资产的比例为-90.61%。本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 4,387,701.56 元，公允价值变动损益为 1,297,573.52 元。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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

本报告编制日前一年内：

1)本集合计划持有的“浦发转债”，发债主体浦发银行于 2022 年 3 月 25 日因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会罚款 420 万元；因违规经营，于 2022 年 9 月 2 日被国家外汇管理局上海市分局罚款 933 万元；

2) 本集合计划持有的“上银转债”，发债主体上海银行于2022年2月23日因未依法履行其他职责，被中国银行保险监督管理委员会责令改正、公开处罚240万元；

3) 本集合计划持有的“兴业转债”发行主体兴业银行因未依法履行职责于2022年3月25日被中国银行保险监督管理委员会罚款350万元；因未依法履行职责于2022年10月28日被中国银行保险监督管理委员会罚款450万元；因未依法履行职责于2022年11月4日被中国银行保险监督管理委员会罚款150万元；

4) 本集合计划持有的“财通转债”发行主体财通证券，因涉嫌违反法律法规，于2022年11月30日被国家外汇管理局浙江省分局罚款14万元；

该类情形对上市公司的经营和财务没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及产品合同的要求。

8.13.2 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

本集合计划投资的前十名股票未有超出集合计划合同规定的备选股票库。

8.13.3 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	23,127,903.63
2	应收清算款	128,779.80
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,259,183.43

8.13.4 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(%)
1	110059	浦发转债	4,025,083.27	1.29
2	113042	上银转债	4,001,470.65	1.29
3	113044	大秦转债	3,088,939.89	0.99
4	110073	国投转债	2,747,891.55	0.88
5	113052	兴业转债	2,499,543.12	0.80
6	127005	长证转债	2,223,169.19	0.71
7	113043	财通转债	2,170,827.34	0.70
8	113616	韦尔转债	1,465,760.83	0.47
9	127032	苏行转债	1,248,979.75	0.40
10	110075	南航转债	1,199,762.97	0.39

11	128136	立讯转债	1,176,625.38	0.38
12	128141	旺能转债	685,435.42	0.22
13	127043	川恒转债	633,422.02	0.20
14	110084	贵燃转债	585,990.23	0.19
15	113055	成银转债	540,059.67	0.17
16	110077	洪城转债	478,917.26	0.15

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	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(%)
光大阳光对冲6个月持有混合A	18	145,315.46	-	-	2,615,678.28	100.00
光大阳光对冲6个月持有混合B	208	178,504.06	28,146,931.88	75.81	8,981,911.66	24.19
光大阳光对冲6个月持有混合C	34,008	7,850.38	-	-	266,975,830.96	100.00
合计	34,234	8,959.52	28,146,931.88	9.18	278,573,420.90	90.82

注：分级集合机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	46,501.00	1.7778
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	96,792.43	0.2607
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	30,612.04	0.0115
	合计	173,905.47	0.0567

注：从业人员持有集合占集合总份额比例的计算中，对下属分级集合，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级集合份额的合计数（即期末集合份额总额）。

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	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	0~10
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	0
	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C	0
	合计	0

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情况

本集合计划投资经理本报告期末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	光大阳光对冲 6 个月持有混合 A	光大阳光对冲 6 个月持有混合 B	光大阳光对冲 6 个月持有混合 C
基金合同生效日（2020 年 3 月 25 日）基金份额总额	38,874,579.27	-	-
本报告期期初基金份额总额	3,112,966.42	39,843,250.89	441,324,525.40
本报告期基金	-	3,314.20	2,544,148.47

总申购份额			
减：本报告期基金总赎回份额	497,288.14	2,717,721.55	176,892,842.91
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	2,615,678.28	37,128,843.54	266,975,830.96

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

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

本报告期内本集合计划管理人无重大人事变动、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

本报告期内无涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本集合计划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

本报告期内集合计划管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所（特殊合伙）的报酬为20,000.00元人民币，该会计师事务所自本集合计划合同生效日起为本集合计划提供审计服务至今。

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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
光大证券	2	4,743,686,157.01	100.00	2,028,229.42	100.00	-

注：1、此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票而合计支付该券商的佣金合计。

2、交易单元的选择标准和程序

(1) 选择标准

券商财务状况良好、经营行为规范，最近一年无重大违规行为；具有较强的研究服务能力；交易佣金收费合理。

(2) 选择程序

集合计划管理人根据以上标准对不同券商进行综合评价，然后根据评价选择券商，与其签订协议租用交易单元。

3、本报告期内无新增券商交易单元。

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 (%)
光大证券	395,021,870.99	100.00	3,631,500,000.00	100.00	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下参公集合资产管理计划增加上海万得基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务得公告	证监会规定的媒介	2022 年 01 月 04 日
2	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2021 年第 4 季度报告	证监会规定的媒介	2022 年 01 月 21 日
3	关于旗下参公集合资产管理计划增加上海好买基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	证监会规定的媒介	2022 年 02 月 08 日
4	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活	证监会规定的媒介	2022 年 03 月 31 日

	配置混合型集合资产管理计划 2021 年年度报告		
5	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2022 年第 1 季度报告	证监会规定的媒介	2022 年 04 月 22 日
6	关于旗下参公集合资产管理计划在上海陆金所基金销售有限公司渠道开通定期定额投资业务的公告	证监会规定的媒介	2022 年 05 月 19 日
7	关于旗下参公集合资产管理计划增加北京汇成基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	证监会规定的媒介	2022 年 06 月 13 日
8	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划基金经理变更公告	证监会规定的媒介	2022 年 07 月 01 日
9	关于旗下参公集合资产管理计划增加珠海盈米基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	证监会规定的媒介	2022 年 07 月 01 日
10	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2022 年第 2 季度报告	证监会规定的媒介	2022 年 07 月 21 日
11	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2022 年中期报告	证监会规定的媒介	2022 年 08 月 31 日
12	关于旗下参公集合资产管理计划增加北京度小满基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	证监会规定的媒介	2022 年 09 月 01 日
13	关于旗下参公集合资产管理计划增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代理销售机构并开通定期定额投资业务的公告	证监会规定的媒介	2022 年 09 月 21 日
14	光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划 2022 年第 3 季度报告	证监会规定的媒介	2022 年 10 月 26 日
15	关于开通旗下部分集合资产管理计划转换业务的公告	证监会规定的媒介	2022 年 12 月 09 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

本集合计划本报告期内无单一投资者持有集合计划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、中国证监会关于同意光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划合同变更的函；

2、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》；

4、《光大阳光对冲策略 6 个月持有期灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》；

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；

6、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于集合计划管理人的办公场所：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 3 号楼 26 层。

13.3 查阅方式

投资者可到集合计划管理人的办公场所免费查阅备查文件，亦可通过公司网站查阅，公司网址为：www.ebscn-am.com

上海光大证券资产管理有限公司

2023 年 3 月 31 日