

国海证券量化优选一年持有期股票型集合
资产管理计划
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	98
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	99

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	99
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	100
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	100
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	100
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	100
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	100
7.12 投资组合报告附注	100
§8 基金份额持有人信息.....	101
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	101
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	102
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	102
§9 开放式基金份额变动.....	102
§10 重大事件揭示.....	102
10.1 基金份额持有人大会决议	102
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	103
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	103
10.4 基金投资策略的改变	103
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	103
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	103
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	104
10.8 其他重大事件	104
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	105
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	105
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	105
§12 备查文件目录.....	105
12.1 备查文件目录	105
12.2 存放地点	105
12.3 查阅方式	105

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划	
基金简称	国海量化优选一年持有股票	
场内简称	-	
基金主代码	970041	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 23 日	
基金管理人	国海证券股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	377,276,966.01 份	
基金合同存续期	三年	
下属分级基金的基金简称	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	970041	970042
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	24,061,886.71 份	353,215,079.30 份

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

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国海证券股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈嘉斌	余宏伟
	联系电话	010-88576333	021-68089632
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn	yuhongwei@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		95563	95588
传真		021-60338151	010-66105798
注册地址		广西桂林市辅星路 13 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		何春梅	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
本期已实现收益	2,456,251.77	38,022,354.23
本期利润	3,224,572.46	47,583,635.40
加权平均基金份额本期利润	0.1225	0.1258
本期加权平均净值利润率	6.87%	7.06%
本期基金份额净	6.83%	6.84%

值增长率		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	17,256,394.57	252,468,316.82
期末可供分配基金份额利润	0.7172	0.7148
期末基金资产净值	43,187,469.42	633,175,491.96
期末基金份额净值	1.7948	1.7926
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	5.81%	5.68%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海量化优选一年持有股票 A

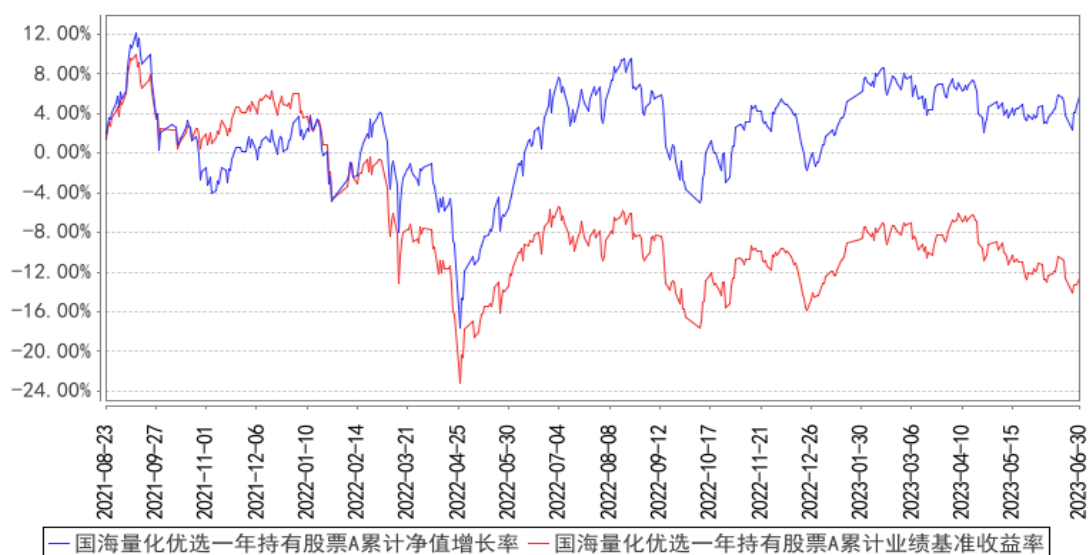
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.21%	0.84%	-0.77%	0.89%	2.98%	-0.05%
过去三个月	-0.75%	0.75%	-5.10%	0.78%	4.35%	-0.03%
过去六个月	6.83%	0.75%	2.20%	0.75%	4.63%	0.00%
过去一年	0.32%	0.92%	-6.65%	0.91%	6.97%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.81%	1.16%	-12.54%	1.11%	18.35%	0.05%

国海量化优选一年持有股票 C

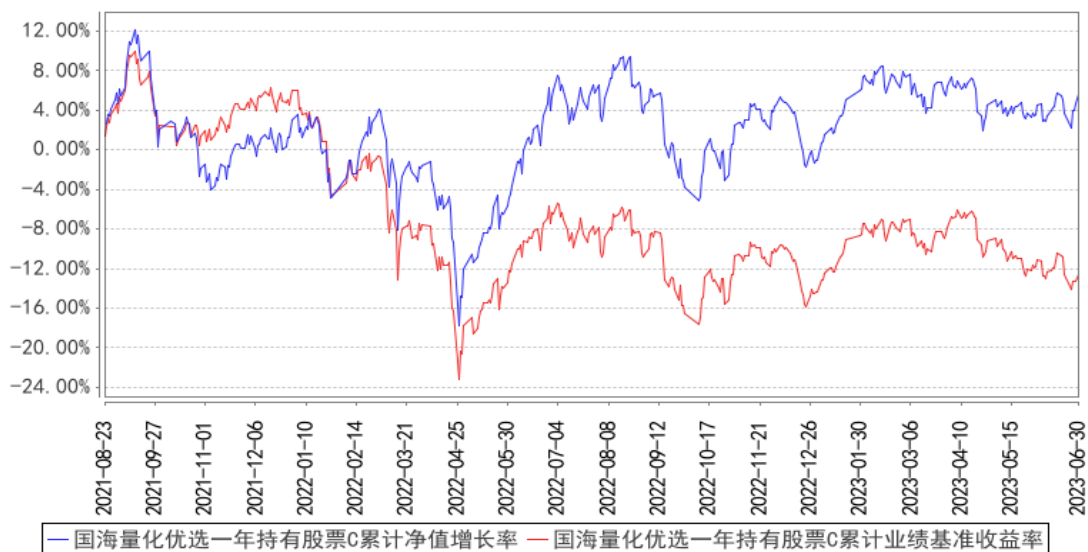
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	2.21%	0.84%	-0.77%	0.89%	2.98%	-0.05%
过去三个月	-0.75%	0.75%	-5.10%	0.78%	4.35%	-0.03%
过去六个月	6.84%	0.75%	2.20%	0.75%	4.64%	0.00%
过去一年	0.32%	0.92%	-6.65%	0.91%	6.97%	0.01%
自基金合同生效起至今	5.68%	1.17%	-12.54%	1.11%	18.22%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



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



3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
-	-
其他指标	报告期末（2023年6月30日）
-	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国海证券是一家涵盖证券、基金、期货、私募股权投资、另类投资等多元业务体系的全国性上市综合金融服务企业。公司成立于1988年，前身为广西证券公司，是国内首批设立也是在广西区内注册的唯一一家证券公司。2011年8月，借壳桂林集琦药业股份有限公司登陆A股市场，成为国内第16家上市证券公司（股票代码：000750）。截至2023年6月末，公司在全国21个省级区域设有28家分公司、98家营业部，控股国海富兰克林基金管理有限公司、国海良时期货有限公司，全资设立国海创新资本投资管理有限公司、国海证券投资有限公司，形成了以零售财富、企业金融、机构服务与投资、资产管理、精品研究等为支撑的业务体系，为个人、企业、机构及政府客户提供多元化金融服务。

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石雨萌	本基金的基金经理	2022 年 7 月 22 日	-	6	石雨萌先生，墨尔本大学信息技术硕士，6 年证券从业经验。2017 年加入国海证券资产管理分公司，历任投资助理、投资经理助理。

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

注：本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内，A 股市场表现出上半段强预期，下半段弱现实的情况。一季度初期，市场的强势表现源自于市场对国内经济转向的预期，疫情防控政策的优化、地产行业托底措施出台均有效提振了市场的信心。但进入二季度，宏观经济数据整体呈现弱复苏的现实，4-6 月官方 PMI 分别录得 49.2、48.8、49，连续三个月处于收缩区间，消费品、工业品价格下行压力有所加大。企业、居民部门投资意愿提升不足，4-5 月社融数据未及预期。

运作方面，我们在上半年坚持产品使用中证 500 指数增强策略，坚持高仓位运作。上半年量化选股策略超额收益较往年偏弱。主要原因是市场热点板块过于集中，在极端分化的市场环境下量化选股策略获取超额收益的难度加大。量化策略给我们提供了应对复杂市场环境的理论框架，通过高度分散，各行业全面配置，不追求风格极端暴露的股票组合，在长期以较大概率战胜业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.7948 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为 6.83%；C 类份额基金份额净值为 1.7926 元，本报告期份额净值增长率为 6.84%，同期业绩比较基准收益率为 2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为市场经过 5-6 月份的调整，当前市场情绪已经进入相对理性的区间，打破当前多空格局需要期待来自政策层面的助力。当前政策面已经关注到经济面临的压力，同时当前仍有较大的增量政策空间。

指增策略短期受到市场波动的影响，但长期来看超额收益的累积才是最大收益来源，我们建议投资者拉长持有时间，累积中长期超额收益。我们将继续对量化选股模型进行改进与迭代，力争获取更高的超额收益，为投资者提供更好的持有体验。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括投资风险负责人、基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关政策法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在对国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本托管人依法对国海证券股份有限公司编制和披露的国海证券量化优选一年持

有期股票型集合资产管理计划 2023 年上半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

本报告期内，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	37,683,614.78	55,699,125.18
结算备付金		9,452,355.60	10,890,187.67
存出保证金		1,775,603.68	2,100,750.78
交易性金融资产	6.4.7.2	628,782,271.10	672,548,444.77
其中：股票投资		628,782,271.10	672,548,444.77
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	6,657,888.61
应收股利		-	-
应收申购款		20,360.91	169,497.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		677,714,206.07	748,065,894.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	5,297,688.84
应付赎回款		102,042.29	201,987.08
应付管理人报酬		553,289.58	662,481.16
应付托管费		55,310.75	66,248.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	640,602.07	811,444.15
负债合计		1,351,244.69	7,039,849.33
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	377,276,966.01	441,600,125.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	299,085,995.37	299,425,920.09
净资产合计		676,362,961.38	741,026,045.18
负债和净资产总计		677,714,206.07	748,065,894.51

注：1) 报告截止日 2023 年 6 月 30 日，集合计划份额总额 377,276,966.01 份，资产总净值（暂估业绩报酬前）676,362,961.38 元。其中 A 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7948 元，集合计划份额总额 24,061,886.71 份，资产净值（暂估业绩报酬前）43,187,469.42 元，相关暂估业绩报酬余额 960,556.49 元，资产净值（暂估业绩报酬后）42,226,912.93 元；C 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7926 元，集合计划份额总额 353,215,079.30 份，资产净值（暂估业绩报酬前）633,175,491.96 元，相关暂估业绩报酬 237,443.60 元，资产净值（暂估业绩报酬后）632,938,048.36 元。

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

6.2 利润表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		55,372,342.60	25,286,587.52
1. 利息收入		175,142.94	149,042.94
其中：存款利息收入	6.4.7.13	175,142.94	149,042.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		44,867,597.80	-12,634,779.23
其中：股票投资收益	6.4.7.14	37,791,407.85	-17,219,061.47
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	250,269.01	-2,558,589.31
股利收益	6.4.7.19	6,825,920.94	7,142,871.55
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	10,329,601.86	37,722,781.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	49,542.23
减：二、营业总支出		4,564,134.74	4,140,475.98
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,940,672.66	3,745,321.59
2. 托管费	6.4.10.2.2	357,909.17	374,532.16
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		181,914.01	-
8. 其他费用	6.4.7.23	83,638.90	20,622.23
三、利润总额（亏损总额		50,808,207.86	21,146,111.54

以“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		50,808,207.86	21,146,111.54
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		50,808,207.86	21,146,111.54

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

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-64,323,159.08	-	-339,924.72	-64,663,083.80
（一）、综合收益总额	-	-	50,808,207.86	50,808,207.86
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-64,323,159.08	-	-51,148,132.58	-115,471,291.66
其中：1. 基金申购款	38,775,357.04	-	31,121,767.89	69,897,124.93
2. 基金赎回款	-103,098,516.12	-	-82,269,900.47	-185,368,416.59
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-	-

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）	377,276,966.01	-	299,085,995.37	676,362,961.38
项目	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	444,924,658.68	-	332,349,232.15	777,273,890.83
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）	444,924,658.68	-	332,349,232.15	777,273,890.83
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	24,879,204.54	-	37,382,519.19	62,261,723.73
（一）、综合收益总额	-	-	21,146,111.54	21,146,111.54
（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）	24,879,204.54	-	16,236,407.65	41,115,612.19
其中：1. 基金申购款	33,307,044.90	-	21,999,305.20	55,306,350.10
2. 基金赎回款	-8,427,840.36	-	-5,762,897.55	-14,190,737.91
（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)	469,803,863.22	-	369,731,751.34	839,535,614.56
-----------------	----------------	---	----------------	----------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>何春梅</u>	<u>谭志华</u>	<u>韦海乐</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由国海金贝壳 8 号集合资产管理计划变更而来。国海金贝壳 8 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划,2012 年 4 月 13 日经中国证券监督管理委员会出具的证监许可[2012]516 号核准设立,自 2012 年 7 月 5 日起开始募集,于 2012 年 8 月 3 日结束募集工作,并于 2012 年 8 月 9 日募集成立。

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和集合计划合同的有关规定,本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、债券(国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为:股票投资占集合计划资产的 80%-95%;每个交易日日终在

扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70

号文《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、增值税

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

根据财税[2017]56号文件的规定，自2018年1月1日(含)起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128号)文件的规定，管理人运用资产管理计划买卖股票，出股票按1‰的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
	2023 年 6 月 30 日
活期存款	37,683,614.78
等于：本金	37,679,987.43
加：应计利息	3,627.35
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	37,683,614.78

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	631,906,295.10	-	628,782,271.10	-3,124,024.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	-	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	631,906,295.10	-	628,782,271.10	-3,124,024.00

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	13,330,920.00	-	-	-
其中：股指期货投资	13,330,920.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,330,920.00	-	-	-

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

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2309	中证 500 股指期货 2309	11.00	13,134,000.00	-196,920.00
合计				-196,920.00
减：可抵销期货暂收款				-196,920.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

单位：人民币元

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
-	-	-
合计	-	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日						
	债券代 码	债券名称	约定 返售日	估值单 价	数量 (张)	估值 总额	其中：已出售 或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2023年6月30日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来12个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用减值)	整个存续期预期信用损失(已发生信用减值)	
期初余额	-	-	-	-

本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
交易所 市场 银行间 市场 - 小计	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
资产支持证 券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

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

本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日					
	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
-	-
合计	-

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

2023 年 6 月 30 日	
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	401,258.91
其中：交易所市场	401,258.91
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	239,343.16
合计	640,602.07

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,481,316.46	29,481,316.46
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-5,419,429.75	-5,419,429.75
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	24,061,886.71	24,061,886.71

国海量化优选一年持有股票 C

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	412,118,808.63	412,118,808.63
本期申购	38,775,357.04	38,775,357.04
本期赎回（以“-”号填列）	-97,679,086.37	-97,679,086.37
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	353,215,079.30	353,215,079.30

6.4.7.11 其他综合收益

单位：人民币元

项目	期初余额	本期发生金额				期末余额
		本期所得税 前发生额	减：前期计入 其他综合收	减：前期计入 其他综合收	减：所得税费 用	

			益当期转入 损益	益当期转入 留存收益		
一、不能重分类 进损益的其他 综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他权益 工具投资公允 价值变动	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
二、将重分类进 损益的其他综 合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他债权 投资公允价值 变动	-	-	-	-	-	-
其他债权投资 信用减值准备	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,296,444.25	1,752,834.10	20,049,278.35
本期利润	2,456,251.77	768,320.69	3,224,572.46
本期基金份额交易产生 的变动数	-3,496,301.45	-651,966.65	-4,148,268.10
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-3,496,301.45	-651,966.65	-4,148,268.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,256,394.57	1,869,188.14	19,125,582.71

国海量化优选一年持有股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	254,834,681.51	24,541,960.23	279,376,641.74
本期利润	38,022,354.23	9,561,281.17	47,583,635.40
本期基金份额交易产生 的变动数	-40,388,718.92	-6,611,145.56	-46,999,864.48
其中：基金申购款	26,988,781.49	4,132,986.40	31,121,767.89
基金赎回款	-67,377,500.41	-10,744,131.96	-78,121,632.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	252,468,316.82	27,492,095.84	279,960,412.66

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	75,431.14
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	98,213.62
其他	1,498.18
合计	175,142.94

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	37,791,407.85
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	37,791,407.85

注：股票投资收益中扣除了增值税的影响。

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,881,324,546.40
减：卖出股票成本总额	5,832,868,327.02
减：交易费用	10,664,811.53
买卖股票差价收入	37,791,407.85

注：卖出股票成交总额中扣除了增值税的影响。

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
出借证券现金清偿总额	-
减：出借证券成本总额	-
减：应收证券出借利息	-
减：交易费用	-
证券出借差价收入	-

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回债券成本总额	-
减：赎回债券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购债券成本总额	-
减：申购债券应计利息总额	-
减：交易费用	-

-	-
申购差价收入	-

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券 差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回资产支持证券成本总额	-
减：赎回资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
申购基金份额对价总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购资产支持证券成本总额	-
减：申购资产支持证券应计利息总额	-
减：交易费用	-

-	-
申购差价收入	-

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-
合计	-

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出贵金属成交总额	-
减：卖出贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-
买卖贵金属差价收入	-

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回贵金属份额对价总额	-
减：现金支付赎回款总额	-
减：赎回贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
赎回差价收入	-

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
申购贵金属份额总额	-
减：现金支付申购款总额	-
减：申购贵金属成本总额	-
减：交易费用	-
-	-
申购差价收入	-

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出权证成交总额	-
减：卖出权证成本总额	-
减：交易费用	-
减：买卖权证差价收入应缴纳 增值税额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	250,269.01

注：衍生工具投资收益中扣除了增值税的影响。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,825,920.94
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	6,825,920.94

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	10,001,881.86
股票投资	10,001,881.86
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	327,720.00
权证投资	-
期货投资	327,720.00
3. 其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	10,329,601.86

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
-	-
合计	-

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
银行存款	-
买入返售金融资产	-
债权投资	-
其他债权投资	-
其他	-
-	-
合计	-

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,295.74
合计	83,638.90

6.4.7.24 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本资产管理计划无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国海证券股份有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例（%）
国海证券	11,662,057,726.16	100.00	10,604,734,087.67	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未发生债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例（%）
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未发生债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未发生权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	3,863,490.11	100.00	401,258.91	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	3,513,382.61	100.00	732,753.97	100.00

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	3,940,672.66
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

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

③ 管理人业绩报酬计提方法：

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

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

④ 此处的管理费包含管理费 3,579,091.90 元，管理人业绩报酬 361,580.76 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	357,909.17	374,532.16

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

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方 名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海量化优选一年持有 股票 A	国海量化优选一年持有 股票 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方 名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海量化优选一年持有 股票 A	国海量化优选一年持有 股票 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
	-	-	-	-	-	-
上上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-
上上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
上上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 23 日）持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期初持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	1,131,926.77	13,425,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.30%	3.56%
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 23 日）持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期初持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.45%	2.86%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国海量化优选一年持有股票 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

份额单位：份

国海量化优选一年持有股票 C

关联方名 称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
-	-	-	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份 有限公司	37,683,614.78	75,431.14	48,020,515.49	80,100.36

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 计	-	-	-	-	-	-	-	-
国海量化优选一年持有股票 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
601916	浙 商 银 行	2023 年 06 月 27 日	1 个 月 以 内 （ 含）	新 股 未 上 市	2.02	2.64	27,840	56,236.80	73,497.60	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注

-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
6.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000561	烽火电子	2023年7月3日	重大事项停牌	11.57	-	-	1,600	16,870.00	18,512.00	-
600530	*ST 交昂	2023年5月4日	重大事项停牌	2.49	-	-	7,300	26,080.30	18,177.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
-	-	-	-	-	-
合计					-

注：本基金本期末未开展银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未开展交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

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

注：本基金本期末未参与转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-

-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值以及压

力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券主要在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12（如有）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合中利率敏感性金融工具配置比例等方法对上述利率风险进行管理。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	37,683,614.78	-	-	-	37,683,614.78
结算备付金	9,452,355.60	-	-	-	9,452,355.60
存出保证金	1,775,603.68	-	-	-	1,775,603.68
交易性金融资产	-	-	-	628,782,271.10	628,782,271.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	20,360.91	20,360.91

应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	48,911,574.06	-	-	-628,802,632.01	677,714,206.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	102,042.29	102,042.29
应付管理人报酬	-	-	-	553,289.58	553,289.58
应付托管费	-	-	-	55,310.75	55,310.75
应付清算款	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	640,602.07	640,602.07
负债总计	-	-	-	1,351,244.69	1,351,244.69
利率敏感度缺口	48,911,574.06	-	-	-627,451,387.32	676,362,961.38
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	55,699,125.18	-	-	-	55,699,125.18
结算备付金	10,890,187.67	-	-	-	10,890,187.67
存出保证金	2,100,750.78	-	-	-	2,100,750.78
交易性金融资产	-	-	-	-672,548,444.77	672,548,444.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	169,497.50	169,497.50
应收清算款	-	-	-	6,657,888.61	6,657,888.61
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	68,690,063.63	-	-	-679,375,830.88	748,065,894.51
负债					
应付赎回款	-	-	-	201,987.08	201,987.08
应付管理人报酬	-	-	-	662,481.16	662,481.16
应付托管费	-	-	-	66,248.10	66,248.10
应付清算款	-	-	-	5,297,688.84	5,297,688.84
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	811,444.15	811,444.15
负债总计	-	-	-	7,039,849.33	7,039,849.33
利率敏感度缺口	68,690,063.63	-	-	-672,335,981.55	741,026,045.18

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	-	-	-

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			合计
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负				

债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	-	-	-
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	-	-	-

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	628,782,271.10	92.97	672,548,444.77	90.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	628,782,271.10	92.97	672,548,444.77	90.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	31,990,020.16	36,672,449.06
	业绩比较基准下降5%	-31,990,020.16	-36,672,449.06

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-		
	-		
	-		
分析	风险价值 （单位：人民币元）	本期末（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	-	-	-
	合计	-	-

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	628,672,084.50	672,173,684.77
第二层次	110,186.60	374,760.00
第三层次	-	-
合计	628,782,271.10	672,548,444.77

注：根据《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》的要求，本集合计划期末使用亚式期权模型计算流动性折扣进行估值的尚处于限售期股票投资、违约债、非指数收益法估值长期停牌股票等估值模型中使用不可观察输入值进行估值的金融资产公允价值由第二层次划分为第三层次，同时本集合计划对上年度末可比数字按照此标准进行了追溯调整。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、暂估业绩报酬对集合计划份额净值的影响

截至资产负债表日，集合计划份额总额 377,276,966.01 份，集合计划暂估业绩报酬前的资产总净值 676,362,961.38 元，其中 A 型集合计划暂估业绩报酬前的资产净值 43,187,469.42 元，该净值未体现暂估业绩报酬 960,556.49 元，暂估业绩报酬后的资产净值 42,226,912.93 元，C 型集合计划暂估业绩报酬前的资产净值 633,175,491.96 元，该净值未体现暂估业绩报酬 237,443.60 元，暂估业绩报酬后的资产净值 632,938,048.36 元。

暂估业绩报酬为假设本集合计划以本报告期最后一个交易日(同资产管理合同约定)为清算确

认日，按照当日本集合计划份额净值(计提业绩报酬前)清算，根据计划份额持有人各自持有的份额(包括未到期份额)于当日按照期末净值(计提业绩报酬前)虚拟计提业绩报酬汇总数。上述暂估金额是各计划持有人的暂估业绩报酬的合计，各计划委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

2、除暂估业绩报酬外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	628,782,271.10	92.78
	其中：股票	628,782,271.10	92.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	47,135,970.38	6.96
-	-	-	-
8	其他各项资产	1,795,964.59	0.27
9	合计	677,714,206.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,093,821.04	0.61
B	采矿业	20,685,320.12	3.06
C	制造业	396,297,628.94	58.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,535,475.53	3.04
E	建筑业	14,425,056.74	2.13
F	批发和零售业	29,191,654.75	4.32
G	交通运输、仓储和邮政业	18,563,047.94	2.74
H	住宿和餐饮业	989,569.45	0.15

I	信息传输、软件和信息技术服务业	35,788,732.86	5.29
J	金融业	35,727,684.54	5.28
K	房地产业	14,139,923.49	2.09
L	租赁和商务服务业	6,190,060.20	0.92
M	科学研究和技术服务业	7,249,903.24	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	9,263,080.66	1.37
O	居民服务、修理和其他服务业	81,673.00	0.01
P	教育	249,516.00	0.04
Q	卫生和社会工作	2,663,693.40	0.39
R	文化、体育和娱乐业	10,887,482.20	1.61
S	综合	1,758,947.00	0.26
	合计	628,782,271.10	92.97

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
可选消费	-	-
主要消费	-	-
医药卫生	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002422	科伦药业	76,000	2,255,680.00	0.33
2	300724	捷佳伟创	18,592	2,088,811.20	0.31
3	002223	鱼跃医疗	51,100	1,839,089.00	0.27
4	603345	安井食品	11,500	1,688,200.00	0.25
5	300073	当升科技	32,700	1,645,791.00	0.24
6	600060	海信视像	65,900	1,631,025.00	0.24
7	002384	东山精密	62,203	1,611,057.70	0.24
8	300136	信维通信	79,626	1,598,890.08	0.24
9	600166	福田汽车	457,712	1,556,220.80	0.23
10	603688	石英股份	13,601	1,548,337.84	0.23

11	601162	天风证券	517,000	1,540,660.00	0.23
12	000997	新大陆	80,800	1,527,120.00	0.23
13	600642	申能股份	217,500	1,520,325.00	0.22
14	000623	吉林敖东	94,712	1,519,180.48	0.22
15	600271	航天信息	110,366	1,510,910.54	0.22
16	002131	利欧股份	633,600	1,457,280.00	0.22
17	603218	日月股份	76,500	1,452,735.00	0.21
18	600497	驰宏锌锗	285,000	1,430,700.00	0.21
19	300316	晶盛机电	20,098	1,424,948.20	0.21
20	600637	东方明珠	181,100	1,416,202.00	0.21
21	600489	中金黄金	135,200	1,396,616.00	0.21
22	600728	佳都科技	200,000	1,386,000.00	0.20
23	601128	常熟银行	203,200	1,385,824.00	0.20
24	601717	郑煤机	109,500	1,363,275.00	0.20
25	600487	亨通光电	92,600	1,357,516.00	0.20
26	601555	东吴证券	192,400	1,335,256.00	0.20
27	300014	亿纬锂能	21,600	1,306,800.00	0.19
28	600549	厦门钨业	68,650	1,306,409.50	0.19
29	600885	宏发股份	40,100	1,277,185.00	0.19
30	600582	天地科技	218,200	1,272,106.00	0.19
31	600512	腾达建设	473,400	1,268,712.00	0.19
32	300251	光线传媒	156,100	1,262,849.00	0.19
33	601098	中南传媒	108,300	1,256,280.00	0.19
34	000999	华润三九	20,583	1,248,564.78	0.18
35	300750	宁德时代	5,420	1,240,041.80	0.18
36	600066	宇通客车	82,500	1,216,050.00	0.18
37	000937	冀中能源	190,100	1,212,838.00	0.18
38	300122	智飞生物	27,273	1,205,466.60	0.18
39	002603	以岭药业	46,900	1,204,861.00	0.18
40	300450	先导智能	33,300	1,204,461.00	0.18
41	002737	葵花药业	48,900	1,190,226.00	0.18
42	603589	口子窖	23,800	1,174,530.00	0.17
43	600985	淮北矿业	101,900	1,173,888.00	0.17
44	000783	长江证券	201,500	1,168,700.00	0.17
45	601077	渝农商行	324,200	1,163,878.00	0.17
46	300866	安克创新	13,300	1,163,750.00	0.17
47	002169	智光电气	139,700	1,158,113.00	0.17
48	603605	珀莱雅	10,260	1,153,224.00	0.17
49	002373	千方科技	84,200	1,148,488.00	0.17
50	600390	五矿资本	213,120	1,146,585.60	0.17
51	002283	天润工业	178,100	1,143,402.00	0.17
52	601699	潞安环能	69,000	1,126,080.00	0.17
53	600566	济川药业	38,643	1,122,192.72	0.17

54	600038	中直股份	27,700	1,103,014.00	0.16
55	601619	嘉泽新能	242,400	1,102,920.00	0.16
56	000739	普洛药业	62,000	1,099,880.00	0.16
57	002233	塔牌集团	141,649	1,093,530.28	0.16
58	000822	山东海化	159,200	1,084,152.00	0.16
59	600862	中航高科	42,600	1,078,206.00	0.16
60	600329	达仁堂	23,849	1,070,581.61	0.16
61	600109	国金证券	123,200	1,068,144.00	0.16
62	002025	航天电器	16,700	1,065,460.00	0.16
63	002746	仙坛股份	134,900	1,063,012.00	0.16
64	601666	平煤股份	140,800	1,061,632.00	0.16
65	600498	烽火通信	51,600	1,051,092.00	0.16
66	300274	阳光电源	8,900	1,038,007.00	0.15
67	002367	康力电梯	113,500	1,036,255.00	0.15
68	002434	万里扬	115,500	1,033,725.00	0.15
69	000887	中鼎股份	78,900	1,032,801.00	0.15
70	300194	福安药业	264,200	1,025,096.00	0.15
71	600863	内蒙华电	245,262	1,017,837.30	0.15
72	601168	西部矿业	96,600	1,015,266.00	0.15
73	600704	物产中大	205,400	1,014,676.00	0.15
74	600035	楚天高速	247,500	1,009,800.00	0.15
75	002850	科达利	7,600	1,005,100.00	0.15
76	300872	天阳科技	64,600	1,003,884.00	0.15
77	603156	养元饮品	40,600	1,002,820.00	0.15
78	300773	拉卡拉	56,600	987,104.00	0.15
79	002588	史丹利	162,300	986,784.00	0.15
80	601515	东风股份	224,700	984,186.00	0.15
81	002056	横店东磁	53,961	982,629.81	0.15
82	600167	联美控股	140,200	977,194.00	0.14
83	300759	康龙化成	25,488	975,680.64	0.14
84	603613	国联股份	26,220	968,304.60	0.14
85	600398	海澜之家	139,900	962,512.00	0.14
86	000055	方大集团	194,400	962,280.00	0.14
87	002204	大连重工	187,200	962,208.00	0.14
88	603939	益丰药房	26,000	962,000.00	0.14
89	002419	天虹股份	164,300	961,155.00	0.14
90	600879	航天电子	113,000	959,370.00	0.14
91	000906	浙商中拓	107,257	956,732.44	0.14
92	603369	今世缘	18,100	955,680.00	0.14
93	601958	金钼股份	85,000	947,750.00	0.14
94	600026	中远海能	74,600	942,944.00	0.14
95	002236	大华股份	47,700	942,075.00	0.14
96	300003	乐普医疗	41,632	941,299.52	0.14

97	600597	光明乳业	90,500	941,200.00	0.14
98	000417	合肥百货	199,800	935,064.00	0.14
99	600261	阳光照明	255,825	933,761.25	0.14
100	600486	扬农化工	10,600	926,652.00	0.14
101	002926	华西证券	111,400	925,734.00	0.14
102	601997	贵阳银行	179,400	925,704.00	0.14
103	300413	芒果超媒	26,930	921,275.30	0.14
104	300110	华仁药业	226,800	914,004.00	0.14
105	601333	广深铁路	230,800	913,968.00	0.14
106	000517	荣安地产	299,100	912,255.00	0.13
107	000589	贵州轮胎	162,478	909,876.80	0.13
108	300532	今天国际	44,200	908,752.00	0.13
109	002673	西部证券	142,946	907,707.10	0.13
110	600188	兖矿能源	30,300	906,576.00	0.13
111	600635	大众公用	272,902	906,034.64	0.13
112	603969	银龙股份	195,624	903,782.88	0.13
113	002062	宏润建设	167,000	903,470.00	0.13
114	605196	华通线缆	126,800	902,816.00	0.13
115	000568	泸州老窖	4,300	901,151.00	0.13
116	688002	睿创微纳	20,095	900,256.00	0.13
117	000705	浙江震元	111,700	899,185.00	0.13
118	603987	康德莱	69,500	897,940.00	0.13
119	600399	抚顺特钢	87,700	894,540.00	0.13
120	688299	长阳科技	56,977	892,829.59	0.13
121	002438	江苏神通	77,700	891,996.00	0.13
122	300219	鸿利智汇	121,300	891,555.00	0.13
123	600570	恒生电子	20,113	890,804.77	0.13
124	300896	爱美客	2,000	889,900.00	0.13
125	000912	泸天化	194,100	888,978.00	0.13
126	601601	中国太保	34,200	888,516.00	0.13
127	002459	晶澳科技	21,305	888,418.50	0.13
128	688556	高测科技股份	16,709	887,916.26	0.13
129	300751	迈为股份	5,240	887,551.20	0.13
130	000528	柳工	112,300	887,170.00	0.13
131	002573	清新环境	160,900	886,559.00	0.13
132	603367	辰欣药业	58,373	886,102.14	0.13
133	000400	许继电气	38,300	882,815.00	0.13
134	603815	交建股份	128,000	870,400.00	0.13
135	600900	XD 长江电力	39,400	869,164.00	0.13
136	000738	航发控制	35,490	865,956.00	0.13
137	600717	天津港	193,400	856,762.00	0.13
138	600998	九州通	82,247	853,723.86	0.13
139	605066	天正电气	89,300	840,313.00	0.12

140	601668	中国建筑	146,200	839,188.00	0.12
141	600535	天士力	57,709	837,357.59	0.12
142	000415	渤海租赁	397,400	834,540.00	0.12
143	300185	通裕重工	298,300	832,257.00	0.12
144	002998	优彩资源	117,000	830,700.00	0.12
145	688009	中国通号	142,200	824,760.00	0.12
146	603858	步长制药	39,761	818,678.99	0.12
147	301239	普瑞眼科	8,300	814,064.00	0.12
148	002594	比亚迪	3,146	812,517.42	0.12
149	002498	汉缆股份	202,300	811,223.00	0.12
150	002763	汇洁股份	91,500	810,690.00	0.12
151	300760	迈瑞医疗	2,700	809,460.00	0.12
152	002308	威创股份	171,600	808,236.00	0.12
153	300142	沃森生物	30,553	808,126.85	0.12
154	002065	东华软件	114,300	806,958.00	0.12
155	300433	蓝思科技	68,507	805,642.32	0.12
156	300127	银河磁体	44,300	803,159.00	0.12
157	603041	美思德	66,683	801,529.66	0.12
158	603567	珍宝岛	53,500	800,360.00	0.12
159	300769	德方纳米	7,252	799,387.96	0.12
160	600592	龙溪股份	75,400	799,240.00	0.12
161	002448	中原内配	113,900	797,300.00	0.12
162	600229	城市传媒	93,400	795,768.00	0.12
163	300347	泰格医药	12,300	793,842.00	0.12
164	300408	三环集团	27,000	792,450.00	0.12
165	002139	拓邦股份	60,600	790,830.00	0.12
166	002337	赛象科技	116,400	777,552.00	0.11
167	003023	彩虹集团	37,900	777,329.00	0.11
168	300015	爱尔眼科	41,748	774,425.40	0.11
169	603689	皖天然气	88,280	774,215.60	0.11
170	300253	卫宁健康	71,540	774,062.80	0.11
171	000759	中百集团	171,000	771,210.00	0.11
172	002947	恒铭达	36,800	766,912.00	0.11
173	601318	中国平安	16,500	765,600.00	0.11
174	603706	东方环宇	50,800	764,540.00	0.11
175	002929	润建股份	17,543	761,541.63	0.11
176	600351	亚宝药业	107,200	761,120.00	0.11
177	600251	冠农股份	84,200	760,326.00	0.11
178	000878	云南铜业	68,500	756,925.00	0.11
179	300033	同花顺	4,309	755,281.52	0.11
180	300086	康芝药业	122,700	754,605.00	0.11
181	300223	北京君正	8,500	750,635.00	0.11
182	600757	长江传媒	87,100	749,060.00	0.11

183	002454	松芝股份	88,400	748,748.00	0.11
184	002029	七匹狼	117,900	748,665.00	0.11
185	002580	圣阳股份	79,700	748,383.00	0.11
186	601816	京沪高铁	142,100	747,446.00	0.11
187	688257	新锐股份	28,184	747,157.84	0.11
188	688385	复旦微电	14,853	744,135.30	0.11
189	300676	华大基因	12,400	743,876.00	0.11
190	002563	森马服饰	119,417	742,773.74	0.11
191	600531	豫光金铅	117,900	742,770.00	0.11
192	002179	中航光电	16,360	741,926.00	0.11
193	600809	山西汾酒	4,000	740,280.00	0.11
194	002303	美盈森	229,000	739,670.00	0.11
195	002206	海利得	137,997	739,663.92	0.11
196	300224	正海磁材	57,500	739,450.00	0.11
197	000632	三木集团	174,800	739,404.00	0.11
198	600664	哈药股份	224,500	738,605.00	0.11
199	000733	振华科技	7,700	738,045.00	0.11
200	002402	和而泰	43,400	736,932.00	0.11
201	600737	中粮糖业	91,300	734,965.00	0.11
202	002133	广宇集团	216,600	734,274.00	0.11
203	603637	镇海股份	89,000	734,250.00	0.11
204	300384	三联虹普	42,800	727,172.00	0.11
205	603197	保隆科技	13,400	726,950.00	0.11
206	300332	天壕环境	63,300	726,051.00	0.11
207	002512	达华智能	180,712	724,655.12	0.11
208	000875	吉电股份	134,100	722,799.00	0.11
209	600508	上海能源	49,200	722,256.00	0.11
210	300390	天华新能	20,150	721,370.00	0.11
211	601827	三峰环境	97,400	720,760.00	0.11
212	000685	中山公用	95,200	720,664.00	0.11
213	688012	中微半导体设备	4,600	719,670.00	0.11
214	002566	益盛药业	86,300	718,016.00	0.11
215	600133	东湖高新	108,901	717,657.59	0.11
216	603456	九洲药业	26,202	717,410.76	0.11
217	603012	创力集团	116,000	715,720.00	0.11
218	002129	TCL 中环	21,525	714,630.00	0.11
219	601618	中国中冶	179,300	711,821.00	0.11
220	000552	靖远煤电	213,200	709,956.00	0.10
221	002772	众兴菌业	62,800	709,640.00	0.10
222	601311	骆驼股份	76,400	708,992.00	0.10
223	600368	五洲交通	194,220	706,960.80	0.10
224	300439	美康生物	62,500	706,875.00	0.10
225	600297	广汇汽车	339,700	706,576.00	0.10

226	002483	润邦股份	121,800	706,440.00	0.10
227	300457	赢合科技	40,000	706,400.00	0.10
228	002500	山西证券	126,500	705,870.00	0.10
229	600611	大众交通	238,000	704,480.00	0.10
230	300133	华策影视	99,300	704,037.00	0.10
231	603158	腾龙股份	91,900	703,954.00	0.10
232	600502	安徽建工	133,300	703,824.00	0.10
233	300001	特锐德	33,858	703,569.24	0.10
234	002442	龙星化工	142,900	703,068.00	0.10
235	603661	恒林股份	21,200	702,992.00	0.10
236	000063	中兴通讯	15,400	701,316.00	0.10
237	601686	友发集团	102,500	701,100.00	0.10
238	688033	天宜上佳	36,644	700,633.28	0.10
239	002391	长青股份	101,800	699,366.00	0.10
240	002475	立讯精密	21,500	697,675.00	0.10
241	000852	石化机械	97,000	697,430.00	0.10
242	300661	圣邦股份	8,474	695,969.62	0.10
243	002412	汉森制药	105,900	695,763.00	0.10
244	600323	瀚蓝环境	36,700	694,731.00	0.10
245	605050	福然德	56,200	694,070.00	0.10
246	600794	保税科技	196,700	692,384.00	0.10
247	000563	陕国投 A	226,870	691,953.50	0.10
248	002839	张家港行	163,400	691,182.00	0.10
249	300511	雪榕生物	90,785	689,966.00	0.10
250	300037	新宙邦	13,280	689,099.20	0.10
251	002449	国星光电	77,500	688,975.00	0.10
252	600760	中航沈飞	15,280	687,600.00	0.10
253	600888	新疆众和	86,800	687,456.00	0.10
254	600829	人民同泰	97,600	687,104.00	0.10
255	000731	四川美丰	84,300	687,045.00	0.10
256	600130	波导股份	157,800	686,430.00	0.10
257	603022	新通联	72,850	685,518.50	0.10
258	603390	通达电气	81,600	685,440.00	0.10
259	600919	江苏银行	93,200	685,020.00	0.10
260	000650	仁和药业	111,500	684,610.00	0.10
261	603365	水星家纺	48,600	683,316.00	0.10
262	601500	通用股份	166,500	680,985.00	0.10
263	600558	XD 大西洋	171,500	680,855.00	0.10
264	601222	林洋能源	83,000	679,770.00	0.10
265	603948	建业股份	31,590	679,185.00	0.10
266	002613	北玻股份	146,100	676,443.00	0.10
267	601928	凤凰传媒	59,300	676,020.00	0.10
268	002986	宇新股份	24,500	675,710.00	0.10

269	601179	中国西电	124,900	675,709.00	0.10
270	002969	嘉美包装	172,800	675,648.00	0.10
271	002484	江海股份	31,700	674,893.00	0.10
272	688189	南新制药	71,684	674,546.44	0.10
273	603096	新经典	33,100	673,916.00	0.10
274	601908	京运通	111,300	673,365.00	0.10
275	603586	金麒麟	42,150	673,135.50	0.10
276	002441	众业达	59,000	672,600.00	0.10
277	002049	紫光国微	7,200	671,400.00	0.10
278	002144	宏达高科	60,000	671,400.00	0.10
279	000858	五粮液	4,100	670,637.00	0.10
280	300855	图南股份	18,980	670,373.60	0.10
281	002249	大洋电机	117,600	670,320.00	0.10
282	600488	津药药业	119,100	669,342.00	0.10
283	002361	神剑股份	165,100	668,655.00	0.10
284	002034	旺能环境	42,200	667,182.00	0.10
285	002135	东南网架	103,200	666,672.00	0.10
286	000042	中洲控股	89,000	665,720.00	0.10
287	601456	国联证券	73,100	665,210.00	0.10
288	600667	太极实业	91,500	664,290.00	0.10
289	600718	东软集团	62,300	664,118.00	0.10
290	603817	海峡环保	107,600	663,892.00	0.10
291	002370	亚太药业	162,600	663,408.00	0.10
292	600201	生物股份	69,700	662,847.00	0.10
293	600887	伊利股份	23,300	659,856.00	0.10
294	603900	莱绅通灵	105,000	659,400.00	0.10
295	605166	聚合顺	70,700	658,924.00	0.10
296	600309	万华化学	7,500	658,800.00	0.10
297	600208	新湖中宝	265,300	657,944.00	0.10
298	002526	山东矿机	263,100	657,750.00	0.10
299	603303	得邦照明	47,600	657,356.00	0.10
300	003816	中国广核	211,300	657,143.00	0.10
301	600162	香江控股	329,800	656,302.00	0.10
302	000026	飞亚达	54,400	656,064.00	0.10
303	688571	杭华油墨股份	103,699	654,340.69	0.10
304	000048	京基智农	33,500	653,920.00	0.10
305	600051	宁波联合	89,800	653,744.00	0.10
306	600480	凌云股份	83,140	653,480.40	0.10
307	300575	中旗股份	62,950	653,421.00	0.10
308	601211	国泰君安	46,700	653,333.00	0.10
309	600690	海尔智家	27,800	652,744.00	0.10
310	002912	中新赛克	14,800	651,348.00	0.10
311	600373	中文传媒	48,900	651,348.00	0.10

312	600321	正源股份	389,000	649,630.00	0.10
313	600210	紫江企业	122,100	649,572.00	0.10
314	605122	四方新材	43,700	648,508.00	0.10
315	300047	天源迪科	79,600	647,944.00	0.10
316	600973	宝胜股份	132,800	644,080.00	0.10
317	002304	洋河股份	4,900	643,615.00	0.10
318	600843	上工申贝	110,900	643,220.00	0.10
319	002266	浙富控股	155,700	643,041.00	0.10
320	601010	文峰股份	262,200	642,390.00	0.09
321	600681	百川能源	137,200	640,724.00	0.09
322	300058	蓝色光标	66,200	640,154.00	0.09
323	688377	迪威尔高端制造	25,522	639,326.10	0.09
324	000407	胜利股份	174,900	638,385.00	0.09
325	002160	常铝股份	157,700	637,108.00	0.09
326	002531	天顺风能	41,800	636,614.00	0.09
327	300130	新国都	22,400	634,592.00	0.09
328	000751	锌业股份	191,300	631,290.00	0.09
329	600028	中国石化	99,170	630,721.20	0.09
330	002701	奥瑞金	139,200	627,792.00	0.09
331	002311	海大集团	13,400	627,656.00	0.09
332	000789	万年青	80,673	625,215.75	0.09
333	300900	广联航空	21,700	625,177.00	0.09
334	300259	新天科技	155,100	621,951.00	0.09
335	601918	新集能源	146,100	620,925.00	0.09
336	600156	华升股份	139,900	615,560.00	0.09
337	000949	新乡化纤	191,400	614,394.00	0.09
338	002017	东信和平	46,850	614,203.50	0.09
339	300496	中科创达	6,300	607,005.00	0.09
340	000089	深圳机场	87,100	605,345.00	0.09
341	300018	中元股份	88,300	601,323.00	0.09
342	603127	昭衍新药	14,700	601,230.00	0.09
343	002745	木林森	65,100	598,920.00	0.09
344	688006	浙江杭可科技	19,631	598,156.57	0.09
345	002152	广电运通	50,900	596,548.00	0.09
346	600481	双良节能	42,645	596,177.10	0.09
347	605300	佳禾食品	27,200	591,328.00	0.09
348	600971	恒源煤电	75,880	591,105.20	0.09
349	300776	帝尔激光	9,100	590,590.00	0.09
350	603338	浙江鼎力	10,500	588,105.00	0.09
351	000900	现代投资	144,500	582,335.00	0.09
352	603883	老百姓	19,500	582,075.00	0.09
353	300748	金力永磁	19,400	580,448.00	0.09
354	601328	交通银行	100,000	580,000.00	0.09

355	000951	中国重汽	34,400	579,640.00	0.09
356	601388	怡球资源	201,200	579,456.00	0.09
357	603719	良品铺子	23,096	577,630.96	0.09
358	000888	峨眉山 A	50,400	577,584.00	0.09
359	600858	银座股份	95,100	574,404.00	0.08
360	603507	振江股份	15,800	572,908.00	0.08
361	688188	上海柏楚电子科技	3,038	572,845.28	0.08
362	300115	长盈精密	47,900	570,489.00	0.08
363	600883	博闻科技	74,613	566,312.67	0.08
364	300088	长信科技	93,700	565,011.00	0.08
365	000012	南玻 A	94,700	564,412.00	0.08
366	600325	华发股份	57,300	564,405.00	0.08
367	600211	西藏药业	9,500	564,300.00	0.08
368	000156	华数传媒	64,600	562,020.00	0.08
369	600674	川投能源	37,200	559,860.00	0.08
370	300207	欣旺达	34,247	558,911.04	0.08
371	300677	英科医疗	25,260	555,720.00	0.08
372	300618	寒锐钴业	17,075	553,400.75	0.08
373	300363	博腾股份	18,700	553,333.00	0.08
374	002104	恒宝股份	63,600	553,320.00	0.08
375	300296	利亚德	84,687	553,006.11	0.08
376	600327	大东方	118,923	552,991.95	0.08
377	300232	洲明科技	60,500	552,970.00	0.08
378	300124	汇川技术	8,600	552,206.00	0.08
379	300373	扬杰科技	13,600	551,752.00	0.08
380	300763	锦浪科技	5,300	551,730.00	0.08
381	601088	中国神华	17,940	551,655.00	0.08
382	300568	星源材质	32,089	551,609.91	0.08
383	300601	康泰生物	21,699	550,937.61	0.08
384	300383	光环新网	51,200	550,400.00	0.08
385	601933	永辉超市	175,800	550,254.00	0.08
386	600956	新天绿能	63,100	550,232.00	0.08
387	603121	华培动力	61,700	549,747.00	0.08
388	300482	万孚生物	20,600	548,578.00	0.08
389	002518	科士达	13,700	548,137.00	0.08
390	000811	冰轮环境	34,700	546,872.00	0.08
391	300970	华绿生物	23,400	546,624.00	0.08
392	300059	东方财富	38,461	546,146.20	0.08
393	300239	东宝生物	88,600	545,776.00	0.08
394	601169	北京银行	117,700	544,951.00	0.08
395	600477	杭萧钢构	133,200	544,788.00	0.08
396	600348	华阳股份	68,650	543,021.50	0.08
397	300869	康泰医学	23,600	541,856.00	0.08

398	002381	双箭股份	70,000	540,400.00	0.08
399	300595	欧普康视	17,850	538,891.50	0.08
400	000828	东莞控股	58,800	538,020.00	0.08
401	300418	昆仑万维	13,300	535,724.00	0.08
402	002423	中粮资本	66,700	533,600.00	0.08
403	002698	博实股份	30,500	533,445.00	0.08
404	300782	卓胜微	5,500	531,465.00	0.08
405	300638	广和通	23,380	530,258.40	0.08
406	002739	万达电影	42,100	527,934.00	0.08
407	600901	江苏金租	127,800	527,814.00	0.08
408	600517	国网英大	91,900	523,830.00	0.08
409	603103	横店影视	31,100	523,724.00	0.08
410	601567	三星医疗	41,400	522,882.00	0.08
411	603368	柳药集团	21,140	522,369.40	0.08
412	601003	柳钢股份	129,088	521,515.52	0.08
413	600350	山东高速	81,610	519,855.70	0.08
414	600339	中油工程	127,600	519,332.00	0.08
415	601187	厦门银行	103,100	517,562.00	0.08
416	603707	健友股份	38,200	515,700.00	0.08
417	300279	和晶科技	92,200	515,398.00	0.08
418	002852	道道全	39,800	514,614.00	0.08
419	300304	云意电气	92,824	514,244.96	0.08
420	603170	宝立食品科技	24,057	511,451.82	0.08
421	603878	武进不锈	60,418	510,532.10	0.08
422	301039	中集车辆	38,500	509,355.00	0.08
423	600016	民生银行	135,500	508,125.00	0.08
424	300326	凯利泰	78,100	507,650.00	0.08
425	688676	海南金盘智能 科技	16,728	506,691.12	0.07
426	000521	长虹美菱	66,300	506,532.00	0.07
427	600197	伊力特	18,600	505,362.00	0.07
428	600315	上海家化	17,400	504,774.00	0.07
429	002215	诺普信	67,000	503,170.00	0.07
430	300674	宇信科技	28,400	502,112.00	0.07
431	688518	联赢激光股份	17,939	499,780.54	0.07
432	300715	凯伦股份	35,186	498,937.48	0.07
433	600276	恒瑞医药	10,400	498,160.00	0.07
434	000967	盈峰环境	98,500	497,425.00	0.07
435	002779	中坚科技	18,700	491,997.00	0.07
436	600200	江苏吴中	68,200	491,722.00	0.07
437	300777	中简科技	10,400	491,504.00	0.07
438	601939	建设银行	78,300	490,158.00	0.07
439	300031	宝通科技	19,800	489,456.00	0.07
440	300210	森远股份	158,900	489,412.00	0.07

441	603488	展鹏科技	60,700	487,421.00	0.07
442	002416	爱施德	65,900	486,342.00	0.07
443	300319	麦捷科技	56,700	485,352.00	0.07
444	605259	绿田机械	12,500	485,250.00	0.07
445	300481	濮阳惠成	23,600	485,216.00	0.07
446	002123	梦网科技	36,500	485,085.00	0.07
447	603950	长源东谷	32,420	485,003.20	0.07
448	002685	华东重机	124,000	484,840.00	0.07
449	688019	安集科技	2,940	484,600.20	0.07
450	600073	上海梅林	66,383	484,595.90	0.07
451	002489	浙江永强	119,600	484,380.00	0.07
452	301087	可孚医疗	9,820	484,126.00	0.07
453	603181	皇马科技	43,400	483,476.00	0.07
454	002446	盛路通信	51,100	482,895.00	0.07
455	300041	回天新材	40,880	482,384.00	0.07
456	002284	亚太股份	53,700	481,689.00	0.07
457	600540	新赛股份	105,800	481,390.00	0.07
458	600269	赣粤高速	130,900	480,403.00	0.07
459	603877	太平鸟	18,900	477,792.00	0.07
460	600027	华电国际	71,400	477,666.00	0.07
461	000538	云南白药	9,100	477,568.00	0.07
462	600606	绿地控股	173,400	476,850.00	0.07
463	002371	北方华创	1,500	476,475.00	0.07
464	002948	青岛银行	152,200	476,386.00	0.07
465	601137	博威合金	30,600	476,136.00	0.07
466	600180	瑞茂通	79,500	475,410.00	0.07
467	002990	盛视科技	12,900	474,720.00	0.07
468	002277	友阿股份	150,100	474,316.00	0.07
469	603209	兴通股份	22,340	473,831.40	0.07
470	000541	佛山照明	82,969	473,752.99	0.07
471	002687	乔治白	98,400	472,320.00	0.07
472	002612	朗姿股份	19,800	470,844.00	0.07
473	600981	汇鸿集团	162,200	470,380.00	0.07
474	600874	创业环保	80,100	469,386.00	0.07
475	688819	天能电池集团 股份	12,738	469,267.92	0.07
476	000550	江铃汽车	33,903	469,217.52	0.07
477	603020	爱普股份	51,200	468,992.00	0.07
478	600292	远达环保	80,400	468,732.00	0.07
479	603191	望变电气	24,081	468,375.45	0.07
480	002600	领益智造	67,600	467,116.00	0.07
481	600510	黑牡丹	76,800	466,176.00	0.07
482	601800	中国交建	42,700	465,857.00	0.07
483	600389	江山股份	19,584	465,120.00	0.07

484	002330	得利斯	80,800	464,600.00	0.07
485	000631	顺发恒业	164,700	464,454.00	0.07
486	301029	怡合达	10,380	463,778.40	0.07
487	000833	粤桂股份	71,000	463,630.00	0.07
488	688011	新光光电科技 股份	17,955	463,598.10	0.07
489	002731	萃华珠宝	32,400	462,348.00	0.07
490	600997	开滦股份	77,400	462,078.00	0.07
491	600873	梅花生物	51,722	461,877.46	0.07
492	600897	厦门空港	22,300	461,387.00	0.07
493	002829	星网宇达	10,500	461,265.00	0.07
494	605100	华丰股份	26,100	460,143.00	0.07
495	002478	常宝股份	61,700	459,665.00	0.07
496	002273	水晶光电	38,407	458,579.58	0.07
497	002895	川恒股份	23,268	458,379.60	0.07
498	000554	泰山石油	81,300	457,719.00	0.07
499	600019	宝钢股份	81,400	457,468.00	0.07
500	301103	何氏眼科	10,900	457,364.00	0.07
501	600355	精伦电子	131,800	456,028.00	0.07
502	688070	成都纵横	9,924	455,511.60	0.07
503	002027	分众传媒	66,500	452,865.00	0.07
504	002154	报喜鸟	81,900	452,088.00	0.07
505	002676	顺威股份	112,100	451,763.00	0.07
506	002392	北京利尔	124,693	451,388.66	0.07
507	000020	深华发 A	39,000	451,230.00	0.07
508	603511	爱慕股份	26,200	450,640.00	0.07
509	002952	亚世光电	25,300	448,569.00	0.07
510	301081	严牌股份	45,080	448,546.00	0.07
511	601519	大智慧	62,500	447,500.00	0.07
512	600099	XD 林海股份	47,800	447,408.00	0.07
513	300729	乐歌股份	25,060	447,070.40	0.07
514	300441	鲍斯股份	73,100	446,641.00	0.07
515	603321	梅轮电梯	57,300	446,367.00	0.07
516	601166	兴业银行	28,500	446,025.00	0.07
517	600724	宁波富达	121,500	445,905.00	0.07
518	688335	复洁环保科技	18,152	445,450.08	0.07
519	002344	海宁皮城	94,065	444,927.45	0.07
520	600064	南京高科	67,289	444,780.29	0.07
521	600537	亿晶光电	58,100	443,884.00	0.07
522	000533	顺钠股份	104,400	443,700.00	0.07
523	300636	同和药业	36,100	442,586.00	0.07
524	600909	华安证券	94,706	442,277.02	0.07
525	605058	澳弘电子	19,700	442,265.00	0.07
526	600302	标准股份	83,900	442,153.00	0.07

527	002545	东方铁塔	62,600	441,956.00	0.07
528	002885	京泉华	20,231	441,845.04	0.07
529	688599	天合光能	10,315	439,522.15	0.06
530	600928	西安银行	124,800	439,296.00	0.06
531	603696	安记食品	46,500	438,960.00	0.06
532	300247	融捷健康	128,700	437,580.00	0.06
533	601336	新华保险	11,900	437,563.00	0.06
534	002138	顺络电子	18,290	437,313.90	0.06
535	001227	兰州银行	152,900	437,294.00	0.06
536	600267	海正药业	38,400	436,992.00	0.06
537	002923	润都股份	32,080	436,608.80	0.06
538	002661	克明食品	39,500	434,895.00	0.06
539	300226	上海钢联	13,420	434,808.00	0.06
540	601607	上海医药	19,400	434,754.00	0.06
541	002860	星帅尔	32,200	434,056.00	0.06
542	002296	辉煌科技	50,400	433,440.00	0.06
543	300190	维尔利	108,500	432,915.00	0.06
544	301207	华兰疫苗	13,000	432,380.00	0.06
545	301268	铭利达	10,324	432,265.88	0.06
546	600516	方大炭素	69,700	432,140.00	0.06
547	603289	泰瑞机器	38,500	431,970.00	0.06
548	300032	金龙机电	68,300	431,656.00	0.06
549	603518	锦泓集团	38,000	431,300.00	0.06
550	688178	万德斯环保	22,224	430,923.36	0.06
551	688129	东来涂料技术 股份	30,906	430,520.58	0.06
552	300155	安居宝	85,350	430,164.00	0.06
553	600986	浙文互联	67,200	430,080.00	0.06
554	002435	长江健康	88,300	430,021.00	0.06
555	000532	华金资本	38,700	429,183.00	0.06
556	300583	赛托生物	16,600	429,110.00	0.06
557	688186	张家港广大特 材	13,185	428,908.05	0.06
558	002985	北摩高科	9,700	427,964.00	0.06
559	600423	柳化股份	137,562	427,817.82	0.06
560	603686	福龙马	41,000	427,630.00	0.06
561	002347	泰尔股份	74,600	427,458.00	0.06
562	300131	英唐智控	81,400	427,350.00	0.06
563	300622	博士眼镜	18,100	427,160.00	0.06
564	600980	北矿科技	27,000	426,600.00	0.06
565	601890	亚星锚链	36,800	426,144.00	0.06
566	688625	呈和科技	10,861	425,642.59	0.06
567	600869	远东股份	77,100	425,592.00	0.06
568	688098	申联生物医药	57,622	425,250.36	0.06

569	300243	瑞丰高材	48,319	425,207.20	0.06
570	603317	天味食品	29,100	425,151.00	0.06
571	001323	慕思股份	12,500	424,500.00	0.06
572	600444	国机通用	30,900	424,257.00	0.06
573	301055	张小泉	29,800	424,054.00	0.06
574	600273	嘉化能源	45,000	423,900.00	0.06
575	600202	哈空调	75,800	423,722.00	0.06
576	000060	中金岭南	89,069	423,077.75	0.06
577	000677	恒天海龙	155,400	422,688.00	0.06
578	300416	苏试试验	19,600	422,576.00	0.06
579	002660	茂硕电源	43,800	421,794.00	0.06
580	002666	德联集团	81,500	421,355.00	0.06
581	600598	北大荒	31,600	421,228.00	0.06
582	002472	双环传动	11,600	421,080.00	0.06
583	300358	楚天科技	28,200	421,026.00	0.06
584	300063	天龙集团	97,200	420,876.00	0.06
585	002203	海亮股份	35,040	420,830.40	0.06
586	002014	永新股份	48,400	420,112.00	0.06
587	300113	顺网科技	24,400	419,924.00	0.06
588	600616	金枫酒业	61,000	419,680.00	0.06
589	000728	国元证券	64,290	419,170.80	0.06
590	601089	福元医药	25,700	418,910.00	0.06
591	601366	利群股份	78,300	418,905.00	0.06
592	600571	信雅达	45,800	418,612.00	0.06
593	002094	青岛金王	114,600	418,290.00	0.06
594	300599	雄塑科技	50,800	418,084.00	0.06
595	603311	金海高科	33,700	417,880.00	0.06
596	601101	昊华能源	71,800	417,876.00	0.06
597	300195	长荣股份	66,500	417,620.00	0.06
598	002622	皓宸医疗	132,100	417,436.00	0.06
599	300569	天能重工	49,500	416,790.00	0.06
600	002106	莱宝高科	49,000	416,500.00	0.06
601	605006	山东玻纤	55,500	416,250.00	0.06
602	300738	奥飞数据	40,800	416,160.00	0.06
603	688683	莱尔科技	18,665	415,296.25	0.06
604	600170	上海建工	154,300	415,067.00	0.06
605	000598	兴蓉环境	76,300	414,309.00	0.06
606	300193	佳士科技	54,206	414,133.84	0.06
607	002973	侨银股份	35,700	414,120.00	0.06
608	002128	电投能源	31,200	412,464.00	0.06
609	600108	亚盛集团	136,502	412,236.04	0.06
610	603315	福鞍股份	34,400	412,112.00	0.06
611	003006	百亚股份	23,800	411,264.00	0.06

612	601225	陕西煤业	22,600	411,094.00	0.06
613	603161	科华控股	28,200	410,874.00	0.06
614	300375	鹏翎股份	106,717	410,860.45	0.06
615	300597	吉大通信	41,400	410,274.00	0.06
616	002469	三维化学	66,700	410,205.00	0.06
617	000926	福星股份	98,100	410,058.00	0.06
618	002458	益生股份	33,200	410,020.00	0.06
619	300231	银信科技	46,000	409,860.00	0.06
620	603090	宏盛股份	18,400	409,400.00	0.06
621	603339	四方科技	25,700	408,887.00	0.06
622	603955	大千生态	26,900	408,880.00	0.06
623	688060	江苏云涌电子科技	7,403	407,905.30	0.06
624	002437	誉衡药业	190,300	407,242.00	0.06
625	600603	广汇物流	58,400	406,464.00	0.06
626	300590	移为通信	33,100	404,482.00	0.06
627	603366	日出东方	69,400	403,214.00	0.06
628	000625	长安汽车	31,100	402,123.00	0.06
629	603700	宁水集团	27,500	402,050.00	0.06
630	600288	大恒科技	33,300	401,931.00	0.06
631	688096	江苏京源环保	40,741	400,891.44	0.06
632	001914	招商积余	26,600	400,330.00	0.06
633	000597	东北制药	77,100	400,149.00	0.06
634	300349	金卡智能	28,800	399,744.00	0.06
635	601326	秦港股份	118,200	399,516.00	0.06
636	000636	风华高科	26,000	398,840.00	0.06
637	605287	德才股份	16,800	398,160.00	0.06
638	002695	煌上煌	37,200	397,668.00	0.06
639	300138	晨光生物	22,200	397,380.00	0.06
640	002774	快意电梯	49,966	397,229.70	0.06
641	300839	博汇股份	29,882	397,131.78	0.06
642	600195	中牧股份	34,000	397,120.00	0.06
643	603768	常青股份	22,300	396,271.00	0.06
644	603188	亚邦股份	113,800	396,024.00	0.06
645	600789	鲁抗医药	61,674	395,947.08	0.06
646	300756	金马游乐	20,700	395,784.00	0.06
647	002170	芭田股份	57,500	395,025.00	0.06
648	603027	千禾味业	18,700	394,944.00	0.06
649	301056	森赫股份	43,000	393,880.00	0.06
650	002212	天融信	40,600	393,820.00	0.06
651	001289	龙源电力	17,500	393,750.00	0.06
652	600379	宝光股份	38,600	393,720.00	0.06
653	002334	英威腾	30,900	393,666.00	0.06
654	301102	兆讯传媒	14,645	393,511.15	0.06

655	600628	新世界	54,400	393,312.00	0.06
656	000036	华联控股	95,370	392,924.40	0.06
657	000062	深圳华强	34,400	392,848.00	0.06
658	688138	清溢光电	18,423	388,909.53	0.06
659	600729	重庆百货	12,362	388,661.28	0.06
660	600461	洪城环境	47,567	388,622.39	0.06
661	000157	中联重科	57,500	388,125.00	0.06
662	002851	麦格米特	10,600	386,582.00	0.06
663	600138	中青旅	30,900	386,559.00	0.06
664	000928	中钢国际	40,041	386,395.65	0.06
665	600258	首旅酒店	20,271	384,135.45	0.06
666	002820	桂发祥	33,800	383,292.00	0.06
667	002415	海康威视	11,500	380,765.00	0.06
668	600380	XD 健康元	29,900	380,029.00	0.06
669	002275	桂林三金	21,100	380,011.00	0.06
670	300697	电工合金	31,600	378,568.00	0.06
671	600741	华域汽车	20,500	378,430.00	0.06
672	002335	科华数据	10,500	377,475.00	0.06
673	603187	海容冷链	18,820	376,211.80	0.06
674	300775	三角防务	11,118	375,566.04	0.06
675	603309	维力医疗	24,200	374,374.00	0.06
676	600120	浙江东方	97,000	371,510.00	0.05
677	300853	申昊科技	10,500	368,550.00	0.05
678	601727	上海电气	80,500	367,885.00	0.05
679	002817	黄山胶囊	42,300	367,164.00	0.05
680	002003	伟星股份	39,130	366,256.80	0.05
681	603619	中曼石油	21,600	365,472.00	0.05
682	002320	海峡股份	60,400	364,816.00	0.05
683	688526	武汉科前生物	15,209	361,822.11	0.05
684	603101	汇嘉时代	59,100	361,692.00	0.05
685	300246	宝莱特	28,950	360,427.50	0.05
686	600153	建发股份	32,800	357,848.00	0.05
687	003003	天元股份	33,800	357,604.00	0.05
688	600918	中泰证券	50,800	351,028.00	0.05
689	600011	华能国际	37,800	350,028.00	0.05
690	601579	会稽山	29,600	348,984.00	0.05
691	000301	东方盛虹	29,500	348,690.00	0.05
692	002238	天威视讯	50,101	347,199.93	0.05
693	600572	康恩贝	50,600	346,610.00	0.05
694	000596	古井贡酒	1,400	346,332.00	0.05
695	601006	大秦铁路	46,400	344,752.00	0.05
696	000090	天健集团	68,399	344,730.96	0.05
697	688021	奥福环保	13,211	342,429.12	0.05

698	300545	联得装备	12,300	341,571.00	0.05
699	300937	药易购	10,700	340,153.00	0.05
700	601566	九牧王	28,200	338,964.00	0.05
701	600395	盘江股份	48,600	337,770.00	0.05
702	002728	特一药业	22,148	337,757.00	0.05
703	003017	大洋生物	10,000	336,500.00	0.05
704	603639	海利尔	18,700	335,104.00	0.05
705	600383	金地集团	45,982	331,530.22	0.05
706	600639	浦东金桥	26,700	331,347.00	0.05
707	688390	固德威电源	1,976	329,715.36	0.05
708	600096	云天化	19,300	329,451.00	0.05
709	603808	歌力思	24,900	326,937.00	0.05
710	600054	黄山旅游	25,500	326,400.00	0.05
711	002959	小熊电器	3,900	325,650.00	0.05
712	002038	双鹭药业	32,262	325,523.58	0.05
713	002900	哈三联	24,300	324,891.00	0.05
714	600479	千金药业	28,800	324,864.00	0.05
715	600031	三一重工	19,500	324,285.00	0.05
716	002956	西麦食品	20,740	324,166.20	0.05
717	300095	华伍股份	34,200	323,532.00	0.05
718	600191	华资实业	56,500	323,180.00	0.05
719	001209	洪兴股份	18,100	322,361.00	0.05
720	002012	凯恩股份	49,500	322,245.00	0.05
721	600958	东方证券	33,200	322,040.00	0.05
722	600282	南钢股份	95,400	321,498.00	0.05
723	600410	华胜天成	43,300	321,286.00	0.05
724	600400	红豆股份	97,900	321,112.00	0.05
725	605199	葫芦娃	21,200	320,968.00	0.05
726	600583	海油工程	54,500	318,825.00	0.05
727	603959	百利科技	27,700	318,550.00	0.05
728	600748	上实发展	80,500	317,975.00	0.05
729	688357	建龙微纳	4,900	316,981.00	0.05
730	000425	徐工机械	46,800	316,836.00	0.05
731	002372	伟星新材	15,400	316,316.00	0.05
732	002053	云南能投	28,100	315,282.00	0.05
733	603630	拉芳家化	19,700	314,609.00	0.05
734	002560	通达股份	33,000	314,160.00	0.05
735	601028	玉龙股份	29,200	313,900.00	0.05
736	001218	丽臣实业	13,860	313,374.60	0.05
737	603983	丸美股份	9,600	310,560.00	0.05
738	601857	中国石油	41,500	310,005.00	0.05
739	300107	建新股份	63,300	309,537.00	0.05
740	002126	银轮股份	17,406	308,086.20	0.05

741	603899	晨光股份	6,900	308,016.00	0.05
742	603568	伟明环保	17,590	308,000.90	0.05
743	300973	立高食品	4,500	307,890.00	0.05
744	603919	金徽酒	13,103	307,658.44	0.05
745	600965	福成股份	48,600	307,638.00	0.05
746	002940	昂利康	15,940	306,207.40	0.05
747	002611	东方精工	53,300	305,942.00	0.05
748	600009	上海机场	6,700	304,314.00	0.04
749	688208	道通科技	10,029	303,978.99	0.04
750	601688	华泰证券	22,000	302,940.00	0.04
751	600004	白云机场	21,100	302,574.00	0.04
752	002559	亚威股份	33,900	301,032.00	0.04
753	603758	秦安股份	28,200	300,048.00	0.04
754	600977	中国电影	21,300	299,265.00	0.04
755	600694	大商股份	16,857	298,874.61	0.04
756	603050	科林电气	18,500	298,035.00	0.04
757	601988	中国银行	76,000	297,160.00	0.04
758	002035	华帝股份	41,765	296,531.50	0.04
759	002088	鲁阳节能	16,058	296,109.52	0.04
760	000581	威孚高科	18,766	295,564.50	0.04
761	002394	联发股份	34,500	293,595.00	0.04
762	600376	首开股份	75,200	293,280.00	0.04
763	600785	新华百货	21,500	292,185.00	0.04
764	301098	金埔园林	24,000	289,200.00	0.04
765	601163	三角轮胎	18,200	288,834.00	0.04
766	300864	南大环境	13,050	286,839.00	0.04
767	603109	神驰机电	16,060	286,671.00	0.04
768	002983	芯瑞达	11,600	286,172.00	0.04
769	601319	中国人保	49,000	286,160.00	0.04
770	688630	芯碁微装	3,400	285,668.00	0.04
771	000913	钱江摩托	15,600	284,388.00	0.04
772	600048	保利发展	21,800	284,054.00	0.04
773	603139	康惠制药	17,300	283,374.00	0.04
774	603798	康普顿	27,890	283,362.40	0.04
775	002153	石基信息	20,210	282,940.00	0.04
776	300837	浙矿股份	7,368	282,931.20	0.04
777	600926	杭州银行	24,000	282,000.00	0.04
778	600173	卧龙地产	53,500	281,945.00	0.04
779	300871	回盛生物	17,100	281,808.00	0.04
780	600551	时代出版	25,500	281,775.00	0.04
781	000548	湖南投资	58,200	281,688.00	0.04
782	301076	新瀚新材	14,300	280,566.00	0.04
783	603199	九华旅游	8,100	279,855.00	0.04

784	000725	京东方 A	68,400	279,756.00	0.04
785	603508	思维列控	16,400	279,620.00	0.04
786	600218	全柴动力	31,200	279,552.00	0.04
787	002938	鹏鼎控股	11,500	279,335.00	0.04
788	003008	开普检测	9,700	278,681.00	0.04
789	601009	南京银行	34,600	276,800.00	0.04
790	300146	汤臣倍健	11,541	276,753.18	0.04
791	002968	新大正	18,300	276,513.00	0.04
792	601216	君正集团	67,300	275,930.00	0.04
793	601086	国芳集团	61,900	275,455.00	0.04
794	600125	铁龙物流	45,600	275,424.00	0.04
795	600023	浙能电力	54,300	275,301.00	0.04
796	601956	东贝集团	46,500	275,280.00	0.04
797	002593	日上集团	71,100	275,157.00	0.04
798	601107	四川成渝	67,600	275,132.00	0.04
799	603886	元祖股份	15,000	275,100.00	0.04
800	600438	通威股份	8,000	274,480.00	0.04
801	002413	雷科防务	52,400	274,052.00	0.04
802	300815	玉禾田	18,380	273,494.40	0.04
803	002443	金洲管道	41,000	273,060.00	0.04
804	600939	重庆建工	79,800	272,916.00	0.04
805	600526	菲达环保	56,500	272,330.00	0.04
806	600683	京投发展	44,900	272,094.00	0.04
807	002093	国脉科技	32,200	271,768.00	0.04
808	603967	中创物流	29,700	271,458.00	0.04
809	002976	瑞玛精密	9,700	271,309.00	0.04
810	603881	数据港	12,000	271,080.00	0.04
811	600783	鲁信创投	20,900	270,237.00	0.04
812	300236	上海新阳	6,800	269,620.00	0.04
813	000570	苏常柴 A	48,400	269,588.00	0.04
814	600600	青岛啤酒	2,600	269,438.00	0.04
815	601818	光大银行	87,600	268,932.00	0.04
816	601000	唐山港	76,100	268,633.00	0.04
817	605222	起帆电缆	13,000	268,580.00	0.04
818	605077	华康股份	10,140	268,507.20	0.04
819	002267	陕天然气	33,900	268,488.00	0.04
820	600215	派斯林	31,400	268,470.00	0.04
821	600428	中远海特	42,500	267,750.00	0.04
822	000768	中航西飞	10,000	267,500.00	0.04
823	605288	凯迪股份	6,200	266,848.00	0.04
824	301190	善水科技	14,200	266,818.00	0.04
825	000605	渤海股份	42,200	266,704.00	0.04
826	000153	丰原药业	26,400	266,640.00	0.04

827	000729	燕京啤酒	21,300	265,611.00	0.04
828	600403	大有能源	64,600	265,506.00	0.04
829	300308	中际旭创	1,800	265,410.00	0.04
830	300790	宇瞳光学	17,400	265,176.00	0.04
831	603337	杰克股份	13,900	264,656.00	0.04
832	002688	金河生物	55,900	263,848.00	0.04
833	300181	佐力药业	21,600	263,736.00	0.04
834	300453	三鑫医疗	38,611	263,713.13	0.04
835	003016	欣贺股份	26,100	263,610.00	0.04
836	603799	华友钴业	5,741	263,569.31	0.04
837	603861	白云电器	27,400	263,040.00	0.04
838	688111	金山办公	557	263,026.54	0.04
839	300434	金石亚药	19,400	262,676.00	0.04
840	603839	安正时尚	34,880	262,297.60	0.04
841	002404	嘉欣丝绸	38,900	262,186.00	0.04
842	603587	地素时尚	17,900	262,056.00	0.04
843	603579	荣泰健康	12,500	261,500.00	0.04
844	002353	杰瑞股份	10,400	261,352.00	0.04
845	603856	东宏股份	19,800	261,162.00	0.04
846	003013	地铁设计	14,300	260,975.00	0.04
847	605080	浙江自然	8,700	260,826.00	0.04
848	300120	经纬辉开	33,800	260,598.00	0.04
849	603535	嘉诚国际	16,045	260,570.80	0.04
850	301003	江苏博云	11,270	260,449.70	0.04
851	000919	金陵药业	33,300	260,406.00	0.04
852	002636	金安国纪	28,200	260,286.00	0.04
853	600089	特变电工	11,677	260,280.33	0.04
854	688005	容百科技	4,800	259,296.00	0.04
855	300534	陇神戎发	25,600	259,072.00	0.04
856	000680	山推股份	46,000	258,980.00	0.04
857	002540	亚太科技	44,800	258,944.00	0.04
858	300890	翔丰华	6,300	258,930.00	0.04
859	300976	达瑞电子	5,100	258,570.00	0.04
860	603290	斯达半导	1,200	258,240.00	0.04
861	600716	凤凰股份	68,300	258,174.00	0.04
862	300628	亿联网络	7,360	258,115.20	0.04
863	002202	金风科技	24,300	258,066.00	0.04
864	603869	新智认知	22,700	257,872.00	0.04
865	002388	新亚制程	36,200	257,744.00	0.04
866	002697	红旗连锁	44,100	257,544.00	0.04
867	300857	协创数据	9,800	257,544.00	0.04
868	688127	蓝特光学	14,605	257,486.15	0.04
869	603633	徕木股份	19,700	257,479.00	0.04

870	000404	长虹华意	37,200	257,424.00	0.04
871	301126	达嘉维康	19,200	257,280.00	0.04
872	300448	浩云科技	43,000	257,140.00	0.04
873	605183	确成股份	14,200	257,020.00	0.04
874	688336	三生国健	15,035	256,948.15	0.04
875	301065	本立科技	12,400	256,556.00	0.04
876	300407	凯发电气	28,100	256,553.00	0.04
877	002293	罗莱生活	22,300	256,450.00	0.04
878	300143	盈康生命	22,600	256,284.00	0.04
879	603989	艾华集团	12,165	256,194.90	0.04
880	600256	广汇能源	37,345	256,186.70	0.04
881	600020	中原高速	69,800	256,166.00	0.04
882	600697	欧亚集团	20,800	256,048.00	0.04
883	688468	科美诊断	26,948	256,006.00	0.04
884	300783	三只松鼠	13,100	255,974.00	0.04
885	600884	杉杉股份	16,900	255,866.00	0.04
886	300696	爱乐达	10,400	255,840.00	0.04
887	300735	光弘科技	23,900	255,730.00	0.04
888	300732	设研院	25,700	255,715.00	0.04
889	002884	凌霄泵业	16,768	255,712.00	0.04
890	002033	丽江股份	23,500	255,680.00	0.04
891	301116	益客食品	16,600	255,640.00	0.04
892	000166	申万宏源	55,300	255,486.00	0.04
893	600830	香溢融通	41,800	255,398.00	0.04
894	600613	神奇制药	38,000	255,360.00	0.04
895	605158	华达新材	33,600	255,360.00	0.04
896	600356	恒丰纸业	32,600	255,258.00	0.04
897	002752	昇兴股份	53,700	255,075.00	0.04
898	002269	美邦服饰	162,400	254,968.00	0.04
899	603093	南华期货	23,400	254,826.00	0.04
900	300387	富邦股份	35,000	254,800.00	0.04
901	301149	隆华新材	24,400	254,736.00	0.04
902	002743	富煌钢构	44,300	254,725.00	0.04
903	600429	三元股份	53,400	254,718.00	0.04
904	603183	建研院	53,940	254,596.80	0.04
905	000686	东北证券	36,680	254,559.20	0.04
906	300265	通光线缆	24,500	254,310.00	0.04
907	300878	维康药业	11,200	254,240.00	0.04
908	600731	湖南海利	32,700	254,079.00	0.04
909	688639	华恒生物	2,808	254,067.84	0.04
910	600513	联环药业	26,300	254,058.00	0.04
911	000931	中关村	44,100	254,016.00	0.04
912	600496	精工钢构	68,100	254,013.00	0.04

913	300805	电声股份	30,400	253,840.00	0.04
914	600658	电子城	45,900	253,827.00	0.04
915	002241	歌尔股份	14,300	253,825.00	0.04
916	301136	招标股份	18,500	253,820.00	0.04
917	600875	东方电气	13,600	253,640.00	0.04
918	603185	弘元绿能	3,400	253,470.00	0.04
919	300513	恒实科技	18,300	253,455.00	0.04
920	000544	中原环保	35,300	253,454.00	0.04
921	601126	四方股份	16,663	253,110.97	0.04
922	000902	新洋丰	24,600	252,888.00	0.04
923	300164	通源石油	58,000	252,880.00	0.04
924	688366	昊海生物科技	3,002	252,828.44	0.04
925	000737	北方铜业	46,900	252,791.00	0.04
926	002818	富森美	19,100	252,693.00	0.04
927	603038	华立股份	28,700	252,560.00	0.04
928	600777	新潮能源	99,800	252,494.00	0.04
929	002867	周大生	14,200	252,476.00	0.04
930	000923	河钢资源	18,700	252,450.00	0.04
931	002239	奥特佳	94,500	252,315.00	0.04
932	300388	节能国祯	37,600	252,296.00	0.04
933	300941	创识科技	12,400	252,216.00	0.04
934	601007	金陵饭店	29,600	252,192.00	0.04
935	601995	中金公司	7,100	252,192.00	0.04
936	600763	通策医疗	2,600	251,836.00	0.04
937	600838	上海九百	39,400	251,766.00	0.04
938	601877	正泰电器	9,100	251,615.00	0.04
939	000061	农产品	42,000	251,580.00	0.04
940	600050	中国联通	52,400	251,520.00	0.04
941	002736	国信证券	28,800	251,424.00	0.04
942	000701	厦门信达	37,800	251,370.00	0.04
943	603529	爱玛科技	7,800	251,316.00	0.04
944	002492	恒基达鑫	43,703	251,292.25	0.04
945	601808	中海油服	18,100	251,228.00	0.04
946	600030	中信证券	12,700	251,206.00	0.04
947	601186	中国铁建	25,500	251,175.00	0.04
948	600469	风神股份	39,000	251,160.00	0.04
949	688187	时代电气	6,000	251,160.00	0.04
950	601921	浙版传媒	28,900	251,141.00	0.04
951	002555	三七互娱	7,200	251,136.00	0.04
952	600693	东百集团	63,900	251,127.00	0.04
953	603697	有友食品	27,380	251,074.60	0.04
954	600999	招商证券	18,500	251,045.00	0.04
955	000617	中油资本	34,700	250,881.00	0.04

956	002398	垒知集团	44,000	250,800.00	0.04
957	300154	瑞凌股份	31,300	250,713.00	0.04
958	601229	上海银行	43,600	250,700.00	0.04
959	600061	国投资本	35,200	250,624.00	0.04
960	002539	云图控股	27,900	250,542.00	0.04
961	600362	XD 江西铜业	13,200	250,536.00	0.04
962	600015	华夏银行	46,300	250,483.00	0.04
963	000735	罗牛山	38,300	250,482.00	0.04
964	600736	苏州高新	49,400	250,458.00	0.04
965	002258	利尔化学	19,400	250,454.00	0.04
966	000338	潍柴动力	20,100	250,446.00	0.04
967	688126	上海硅产业集团	11,977	250,319.30	0.04
968	600196	复星医药	8,100	250,290.00	0.04
969	601288	农业银行	70,900	250,277.00	0.04
970	603648	畅联股份	26,200	250,210.00	0.04
971	601689	拓普集团	3,100	250,170.00	0.04
972	601390	中国中铁	33,000	250,140.00	0.04
973	601512	中新集团	26,800	250,044.00	0.04
974	000803	山高环能	24,200	249,986.00	0.04
975	600320	振华重工	67,000	249,910.00	0.04
976	600629	华建集团	35,800	249,884.00	0.04
977	003029	吉大正元	7,700	249,865.00	0.04
978	600837	海通证券	27,100	249,862.00	0.04
979	600000	XD 浦发银行	34,500	249,780.00	0.04
980	002556	辉隆股份	34,400	249,744.00	0.04
981	603358	华达科技	13,100	249,686.00	0.04
982	002659	凯文教育	52,200	249,516.00	0.04
983	600745	闻泰科技	5,100	249,390.00	0.04
984	000860	顺鑫农业	7,400	249,306.00	0.04
985	600594	益佰制药	47,302	249,281.54	0.04
986	603259	药明康德	4,000	249,240.00	0.04
987	600039	四川路桥	25,400	249,174.00	0.04
988	600617	国新能源	57,400	249,116.00	0.04
989	002393	力生制药	10,200	248,880.00	0.04
990	300957	贝泰妮	2,800	248,864.00	0.04
991	601728	中国电信	44,200	248,846.00	0.04
992	600057	厦门象屿	28,600	248,820.00	0.04
993	605368	蓝天燃气	26,000	248,820.00	0.04
994	601600	中国铝业	45,300	248,697.00	0.04
995	000708	中信特钢	15,700	248,688.00	0.04
996	301047	义翘神州	2,900	248,530.00	0.04
997	600811	东方集团	110,900	248,416.00	0.04
998	300435	中泰股份	17,200	248,368.00	0.04

999	000560	我爱我家	93,700	248,305.00	0.04
1,000	603003	龙宇股份	26,000	248,300.00	0.04
1,001	601628	中国人寿	7,100	248,216.00	0.04
1,002	002727	一心堂	9,400	248,160.00	0.04
1,003	600984	建设机械	54,900	248,148.00	0.04
1,004	601825	沪农商行	45,500	247,975.00	0.04
1,005	601669	中国电建	43,200	247,968.00	0.04
1,006	002142	宁波银行	9,800	247,940.00	0.04
1,007	603053	成都燃气	24,600	247,722.00	0.04
1,008	601177	杭齿前进	20,300	247,660.00	0.04
1,009	002460	赣锋锂业	4,060	247,497.60	0.04
1,010	000333	美的集团	4,200	247,464.00	0.04
1,011	000862	银星能源	32,300	247,418.00	0.04
1,012	601989	中国重工	51,300	247,266.00	0.04
1,013	000963	华东医药	5,700	247,209.00	0.04
1,014	000001	平安银行	22,000	247,060.00	0.04
1,015	600916	中国黄金	20,900	246,829.00	0.04
1,016	600803	新奥股份	13,000	246,740.00	0.04
1,017	600960	渤海汽车	65,400	246,558.00	0.04
1,018	603299	苏盐井神	24,700	246,506.00	0.04
1,019	600905	三峡能源	45,900	246,483.00	0.04
1,020	600346	恒力石化	17,200	246,476.00	0.04
1,021	600633	浙数文化	15,200	246,392.00	0.04
1,022	600576	祥源文旅	30,900	246,273.00	0.04
1,023	001205	盛航股份	11,600	246,152.00	0.04
1,024	600036	招商银行	7,500	245,700.00	0.04
1,025	600094	大名城	79,500	245,655.00	0.04
1,026	300241	瑞丰光电	49,000	245,490.00	0.04
1,027	601838	成都银行	20,000	244,200.00	0.04
1,028	000968	蓝焰控股	32,300	244,188.00	0.04
1,029	300999	金龙鱼	6,104	244,098.96	0.04
1,030	603595	东尼电子	5,700	244,074.00	0.04
1,031	601012	隆基绿能	8,500	243,695.00	0.04
1,032	002421	达实智能	69,200	243,584.00	0.04
1,033	600177	雅戈尔	38,552	243,263.12	0.04
1,034	600312	平高电气	19,600	242,844.00	0.04
1,035	000786	北新建材	9,900	242,649.00	0.04
1,036	601518	吉林高速	101,940	242,617.20	0.04
1,037	300604	长川科技	5,100	242,199.00	0.04
1,038	605499	东鹏饮料	1,400	242,060.00	0.04
1,039	002989	中天精装	14,800	241,240.00	0.04
1,040	002471	中超控股	90,300	241,101.00	0.04
1,041	600807	济南高新	81,700	241,015.00	0.04

1,042	002480	新筑股份	51,400	240,552.00	0.04
1,043	002271	东方雨虹	8,800	239,888.00	0.04
1,044	000698	沈阳化工	58,200	239,202.00	0.04
1,045	600800	渤海化学	68,500	239,065.00	0.04
1,046	300687	赛意信息	8,600	238,908.00	0.04
1,047	688356	键凯科技	2,236	238,245.80	0.04
1,048	002517	恺英网络	15,100	237,674.00	0.04
1,049	600233	圆通速递	16,300	237,328.00	0.04
1,050	600761	安徽合力	11,900	237,167.00	0.04
1,051	600754	锦江酒店	5,600	237,104.00	0.04
1,052	601218	吉鑫科技	63,500	236,855.00	0.04
1,053	600198	大唐电信	34,500	236,325.00	0.03
1,054	601969	海南矿业	35,800	235,564.00	0.03
1,055	688148	芳源股份	19,233	234,642.60	0.03
1,056	002466	天齐锂业	3,356	234,617.96	0.03
1,057	002352	顺丰控股	5,200	234,468.00	0.03
1,058	002479	富春环保	50,300	234,398.00	0.03
1,059	603019	中科曙光	4,600	234,140.00	0.03
1,060	688081	兴图新科	12,200	233,874.00	0.03
1,061	300502	新易盛	3,440	233,816.80	0.03
1,062	002920	德赛西威	1,500	233,715.00	0.03
1,063	600732	爱旭股份	7,600	233,700.00	0.03
1,064	688063	派能科技	1,177	233,340.25	0.03
1,065	002409	雅克科技	3,197	232,997.36	0.03
1,066	000938	紫光股份	7,300	232,505.00	0.03
1,067	000656	金科股份	209,300	232,323.00	0.03
1,068	601888	XD 中国中免	2,100	232,113.00	0.03
1,069	300827	上能电气	6,434	231,945.70	0.03
1,070	002455	百川股份	30,100	231,770.00	0.03
1,071	002481	双塔食品	51,700	230,582.00	0.03
1,072	688510	航亚科技	11,583	230,385.87	0.03
1,073	000955	欣龙控股	53,300	229,723.00	0.03
1,074	600770	综艺股份	40,800	229,704.00	0.03
1,075	000402	金融街	50,669	229,023.88	0.03
1,076	600548	深高速	25,498	228,972.04	0.03
1,077	601998	中信银行	38,200	228,436.00	0.03
1,078	300567	精测电子	2,400	228,360.00	0.03
1,079	000707	双环科技	26,800	227,800.00	0.03
1,080	300377	赢时胜	28,100	227,610.00	0.03
1,081	603609	禾丰股份	24,900	226,590.00	0.03
1,082	002628	成都路桥	69,500	226,570.00	0.03
1,083	002624	完美世界	13,400	226,326.00	0.03
1,084	002082	万邦德	31,900	226,171.00	0.03

1,085	300212	易华录	6,800	225,964.00	0.03
1,086	601231	环旭电子	15,100	225,896.00	0.03
1,087	300132	青松股份	39,700	225,099.00	0.03
1,088	688107	安路科技	4,058	224,772.62	0.03
1,089	600790	轻纺城	51,900	224,727.00	0.03
1,090	600377	宁沪高速	22,845	224,566.35	0.03
1,091	600866	星湖科技	40,800	224,400.00	0.03
1,092	002420	毅昌科技	36,600	224,358.00	0.03
1,093	300779	惠城环保	4,200	223,818.00	0.03
1,094	300712	永福股份	6,300	223,650.00	0.03
1,095	002061	浙江交科	50,115	223,512.90	0.03
1,096	002225	濮耐股份	59,100	223,398.00	0.03
1,097	002641	公元股份	39,600	223,344.00	0.03
1,098	601011	宝泰隆	62,200	223,298.00	0.03
1,099	300230	永利股份	63,060	223,232.40	0.03
1,100	603566	普莱柯	9,600	223,200.00	0.03
1,101	002132	恒星科技	62,500	223,125.00	0.03
1,102	600727	鲁北化工	39,100	222,870.00	0.03
1,103	002324	普利特	15,600	222,612.00	0.03
1,104	002768	国恩股份	9,200	222,548.00	0.03
1,105	603032	德新科技	6,440	222,437.60	0.03
1,106	002567	唐人神	33,400	222,110.00	0.03
1,107	002121	科陆电子	30,300	222,099.00	0.03
1,108	002549	凯美特气	19,300	221,950.00	0.03
1,109	300318	博晖创新	40,900	221,269.00	0.03
1,110	600638	新黄浦	41,800	221,122.00	0.03
1,111	300477	合纵科技	47,300	220,891.00	0.03
1,112	603985	恒润股份	10,500	220,185.00	0.03
1,113	600805	悦达投资	51,200	219,648.00	0.03
1,114	300080	易成新能	43,100	219,379.00	0.03
1,115	600165	宁科生物	53,100	219,303.00	0.03
1,116	600363	联创光电	5,900	218,890.00	0.03
1,117	688221	前沿生物	20,512	218,657.92	0.03
1,118	688559	海目星激光	4,644	218,314.44	0.03
1,119	000801	四川九洲	29,900	218,270.00	0.03
1,120	600684	珠江股份	68,200	218,240.00	0.03
1,121	002368	太极股份	5,300	218,201.00	0.03
1,122	300379	东方通	10,600	218,042.00	0.03
1,123	002141	贤丰控股	66,261	217,998.69	0.03
1,124	688608	恒玄科技	1,800	217,854.00	0.03
1,125	002436	兴森科技	14,000	217,000.00	0.03
1,126	600746	江苏索普	33,200	216,796.00	0.03
1,127	600662	外服控股	37,900	216,788.00	0.03

1,128	002582	好想你	27,700	216,337.00	0.03
1,129	003026	中晶科技	5,500	216,315.00	0.03
1,130	002675	东诚药业	14,700	216,237.00	0.03
1,131	688008	澜起科技	3,760	215,899.20	0.03
1,132	000612	焦作万方	44,600	215,864.00	0.03
1,133	603708	家家悦	17,200	215,688.00	0.03
1,134	000961	中南建设	137,300	215,561.00	0.03
1,135	000726	鲁泰 A	31,500	215,460.00	0.03
1,136	002486	嘉麟杰	72,800	214,760.00	0.03
1,137	603305	旭升集团	7,700	214,599.00	0.03
1,138	603596	伯特利	2,707	214,556.82	0.03
1,139	600935	华塑股份	57,000	213,750.00	0.03
1,140	600079	人福医药	7,900	212,826.00	0.03
1,141	000034	神州数码	8,000	212,720.00	0.03
1,142	600358	国旅联合	41,300	212,695.00	0.03
1,143	002396	星网锐捷	9,400	212,346.00	0.03
1,144	603212	赛伍技术	10,200	212,262.00	0.03
1,145	600533	栖霞建设	68,900	212,212.00	0.03
1,146	688981	中芯国际	4,200	212,184.00	0.03
1,147	002734	利民股份	23,000	212,060.00	0.03
1,148	600990	四创电子	6,700	211,988.00	0.03
1,149	002158	汉钟精机	8,493	211,985.28	0.03
1,150	002570	贝因美	49,700	211,722.00	0.03
1,151	603681	永冠新材	14,800	211,344.00	0.03
1,152	300066	三川智慧	38,700	211,302.00	0.03
1,153	601228	广州港	65,400	211,242.00	0.03
1,154	002510	天汽模	54,300	211,227.00	0.03
1,155	300444	双杰电气	27,400	210,980.00	0.03
1,156	002645	华宏科技	17,200	210,872.00	0.03
1,157	300337	银邦股份	31,600	210,772.00	0.03
1,158	000030	富奥股份	41,800	210,672.00	0.03
1,159	603927	中科软	5,462	210,614.72	0.03
1,160	001696	宗申动力	29,700	210,276.00	0.03
1,161	688660	电气风电	37,621	209,548.97	0.03
1,162	002148	北纬科技	34,300	209,230.00	0.03
1,163	002516	旷达科技	43,200	209,088.00	0.03
1,164	002522	浙江众成	40,800	208,896.00	0.03
1,165	000066	中国长城	15,100	208,833.00	0.03
1,166	000539	粤电力 A	28,600	208,780.00	0.03
1,167	601898	中煤能源	24,700	208,468.00	0.03
1,168	002390	信邦制药	47,000	208,210.00	0.03
1,169	301155	海力风电	2,700	208,116.00	0.03
1,170	002063	远光软件	23,912	207,556.16	0.03

1,171	600827	百联股份	15,500	207,235.00	0.03
1,172	600604	市北高新	44,100	206,388.00	0.03
1,173	002783	凯龙股份	24,700	205,998.00	0.03
1,174	600118	中国卫星	7,300	205,933.00	0.03
1,175	603323	苏农银行	48,900	205,869.00	0.03
1,176	603628	清源股份	13,000	205,790.00	0.03
1,177	600361	创新新材	42,800	205,440.00	0.03
1,178	000869	张裕 A	6,700	205,422.00	0.03
1,179	000426	兴业矿业	23,000	204,240.00	0.03
1,180	000507	珠海港	36,900	204,057.00	0.03
1,181	000505	京粮控股	27,400	203,856.00	0.03
1,182	600284	浦东建设	33,300	203,796.00	0.03
1,183	000791	甘肃能源	38,800	202,924.00	0.03
1,184	600584	长电科技	6,500	202,605.00	0.03
1,185	688037	芯源微电子	1,184	202,404.80	0.03
1,186	002197	证通电子	19,200	202,368.00	0.03
1,187	002439	启明星辰	6,800	202,368.00	0.03
1,188	688521	芯原微电子	2,800	201,376.00	0.03
1,189	300842	帝科股份	2,200	201,168.00	0.03
1,190	603718	海利生物	21,300	200,859.00	0.03
1,191	002268	电科网安	7,200	200,664.00	0.03
1,192	600067	冠城大通	75,700	200,605.00	0.03
1,193	300459	汤姆猫	30,900	200,541.00	0.03
1,194	002140	东华科技	22,188	200,357.64	0.03
1,195	600966	博汇纸业	33,800	200,096.00	0.03
1,196	301096	百诚医药	3,300	200,013.00	0.03
1,197	600507	方大特钢	42,900	198,627.00	0.03
1,198	002558	巨人网络	11,000	197,230.00	0.03
1,199	600033	福建高速	62,900	196,877.00	0.03
1,200	603444	吉比特	400	196,444.00	0.03
1,201	002554	惠博普	53,600	196,176.00	0.03
1,202	000895	双汇发展	8,000	195,920.00	0.03
1,203	600336	澳柯玛	34,000	195,840.00	0.03
1,204	300573	兴齐眼药	900	192,420.00	0.03
1,205	002601	龙佰集团	11,592	191,268.00	0.03
1,206	002159	三特索道	10,500	190,995.00	0.03
1,207	002146	荣盛发展	123,100	189,574.00	0.03
1,208	688082	XD 盛美上海半 导体	1,709	188,673.60	0.03
1,209	002110	三钢闽光	44,614	188,271.08	0.03
1,210	002085	万丰奥威	27,000	187,110.00	0.03
1,211	002648	卫星化学	12,400	185,504.00	0.03
1,212	000652	泰达股份	45,000	185,400.00	0.03
1,213	600037	歌华有线	22,200	184,482.00	0.03

1,214	000002	万科 A	13,100	183,662.00	0.03
1,215	601616	广电电气	54,300	183,534.00	0.03
1,216	600612	老凤祥	2,600	181,688.00	0.03
1,217	300682	朗新科技	7,700	179,256.00	0.03
1,218	002664	信质集团	12,700	178,816.00	0.03
1,219	603517	绝味食品	4,800	178,320.00	0.03
1,220	688032	禾迈股份	498	176,864.70	0.03
1,221	605388	均瑶健康	13,900	176,669.00	0.03
1,222	600433	冠豪高新	51,400	175,274.00	0.03
1,223	000813	德展健康	59,300	174,342.00	0.03
1,224	002741	光华科技	10,300	173,864.00	0.03
1,225	603355	莱克电气	6,802	172,838.82	0.03
1,226	300173	福能东方	36,800	172,592.00	0.03
1,227	688379	华光新材	8,475	172,127.25	0.03
1,228	002682	龙洲股份	42,000	171,360.00	0.03
1,229	002655	共达电声	13,100	170,169.00	0.03
1,230	300128	锦富技术	40,700	169,719.00	0.03
1,231	300109	新开源	6,800	169,116.00	0.03
1,232	600519	贵州茅台	100	169,100.00	0.03
1,233	300206	理邦仪器	11,200	168,896.00	0.02
1,234	002749	国光股份	14,905	168,873.65	0.02
1,235	300182	捷成股份	26,600	167,846.00	0.02
1,236	002647	仁东控股	29,800	167,774.00	0.02
1,237	002551	尚荣医疗	43,500	167,475.00	0.02
1,238	600017	日照港	55,900	167,141.00	0.02
1,239	605168	三人行	1,940	166,723.60	0.02
1,240	300856	科思股份	2,110	166,204.70	0.02
1,241	600585	海螺水泥	7,000	166,180.00	0.02
1,242	002837	英维克	5,500	164,670.00	0.02
1,243	605117	德业股份	1,100	164,505.00	0.02
1,244	688041	海光信息	2,400	163,848.00	0.02
1,245	603123	翠微股份	16,800	163,632.00	0.02
1,246	300320	海达股份	20,800	162,864.00	0.02
1,247	300323	华灿光电	23,600	161,660.00	0.02
1,248	601002	晋亿实业	32,500	161,200.00	0.02
1,249	300458	全志科技	5,900	160,775.00	0.02
1,250	000818	航锦科技	4,800	160,176.00	0.02
1,251	000582	北部湾港	21,000	159,600.00	0.02
1,252	002358	森源电气	34,800	159,036.00	0.02
1,253	300054	鼎龙股份	6,400	158,272.00	0.02
1,254	300653	正海生物	4,600	158,194.00	0.02
1,255	002345	潮宏基	20,100	157,986.00	0.02
1,256	002859	洁美科技	5,700	157,890.00	0.02

1,257	000545	金浦钛业	54,300	157,470.00	0.02
1,258	601058	赛轮轮胎	13,800	157,182.00	0.02
1,259	600223	福瑞达	15,300	156,978.00	0.02
1,260	600886	国投电力	12,400	156,860.00	0.02
1,261	600318	新力金融	24,700	156,598.00	0.02
1,262	605286	同力日升	5,400	156,168.00	0.02
1,263	000032	深桑达 A	4,700	154,630.00	0.02
1,264	002369	卓翼科技	27,500	154,000.00	0.02
1,265	000960	锡业股份	9,900	153,945.00	0.02
1,266	000659	珠海中富	57,400	153,832.00	0.02
1,267	603308	应流股份	8,400	153,720.00	0.02
1,268	600933	爱柯迪	6,600	153,714.00	0.02
1,269	002307	北新路桥	30,600	153,000.00	0.02
1,270	002893	华通热力	14,200	152,934.00	0.02
1,271	600797	浙大网新	21,400	152,796.00	0.02
1,272	300758	七彩化学	15,370	152,624.10	0.02
1,273	002400	省广集团	31,700	152,477.00	0.02
1,274	002723	小崧股份	14,900	152,278.00	0.02
1,275	300314	戴维医疗	7,200	152,208.00	0.02
1,276	688036	传音控股	1,035	152,145.00	0.02
1,277	603000	人民网	5,200	151,840.00	0.02
1,278	002288	超华科技	35,900	151,498.00	0.02
1,279	300174	元力股份	9,600	151,392.00	0.02
1,280	300693	盛弘股份	4,100	151,372.00	0.02
1,281	002493	荣盛石化	13,000	151,320.00	0.02
1,282	603660	苏州科达	22,000	151,140.00	0.02
1,283	300078	思创医惠	33,400	150,300.00	0.02
1,284	688348	昱能科技	800	150,264.00	0.02
1,285	600160	巨化股份	10,900	150,202.00	0.02
1,286	601865	福莱特	3,900	150,189.00	0.02
1,287	002230	科大讯飞	2,200	149,512.00	0.02
1,288	002028	思源电气	3,200	149,504.00	0.02
1,289	002010	传化智联	28,100	149,492.00	0.02
1,290	000950	重药控股	22,200	149,406.00	0.02
1,291	002011	盾安环境	10,800	149,364.00	0.02
1,292	002508	老板电器	5,900	149,211.00	0.02
1,293	000607	华媒控股	29,600	149,184.00	0.02
1,294	300768	迪普科技	9,000	149,130.00	0.02
1,295	000927	中国铁物	53,600	149,008.00	0.02
1,296	002270	华明装备	13,600	148,920.00	0.02
1,297	000573	粤宏远 A	43,700	148,580.00	0.02
1,298	000908	景峰医药	58,700	148,511.00	0.02
1,299	600861	北京人力	6,400	148,480.00	0.02

1,300	002332	仙琚制药	11,200	148,400.00	0.02
1,301	600970	中材国际	11,600	147,900.00	0.02
1,302	603486	科沃斯	1,900	147,763.00	0.02
1,303	000885	城发环境	11,100	147,741.00	0.02
1,304	603035	常熟汽饰	7,600	147,668.00	0.02
1,305	300832	新产业	2,500	147,500.00	0.02
1,306	600132	重庆啤酒	1,600	147,456.00	0.02
1,307	002083	孚日股份	32,300	147,288.00	0.02
1,308	300953	震裕科技	2,000	147,260.00	0.02
1,309	688569	铁科轨道	3,500	147,245.00	0.02
1,310	301043	绿岛风	4,600	147,062.00	0.02
1,311	001269	欧晶科技	2,000	147,060.00	0.02
1,312	601899	紫金矿业	12,900	146,673.00	0.02
1,313	601965	中国汽研	7,100	146,615.00	0.02
1,314	002208	合肥城建	22,900	146,560.00	0.02
1,315	600523	贵航股份	10,200	146,472.00	0.02
1,316	002187	广百股份	22,700	146,188.00	0.02
1,317	002297	博云新材	18,200	146,146.00	0.02
1,318	300203	聚光科技	7,200	145,944.00	0.02
1,319	002360	同德化工	19,600	145,628.00	0.02
1,320	300123	亚光科技	20,000	145,600.00	0.02
1,321	688428	诺诚健华	12,585	145,356.75	0.02
1,322	601368	绿城水务	27,400	145,220.00	0.02
1,323	000717	中南股份	52,200	145,116.00	0.02
1,324	000498	山东路桥	22,600	145,092.00	0.02
1,325	300645	正元智慧	5,300	144,796.00	0.02
1,326	002967	广电计量	7,200	144,648.00	0.02
1,327	600104	上汽集团	10,154	143,882.18	0.02
1,328	000987	越秀资本	22,600	143,510.00	0.02
1,329	000558	莱茵体育	47,300	143,319.00	0.02
1,330	300298	三诺生物	5,300	143,312.00	0.02
1,331	002572	索菲亚	8,200	142,844.00	0.02
1,332	688173	希荻微电子	6,193	141,695.84	0.02
1,333	002605	姚记科技	3,000	139,290.00	0.02
1,334	000932	华菱钢铁	29,200	139,284.00	0.02
1,335	603331	百达精工	9,400	138,932.00	0.02
1,336	603676	卫信康	9,900	136,818.00	0.02
1,337	600808	马钢股份	52,300	134,411.00	0.02
1,338	002536	飞龙股份	8,900	133,500.00	0.02
1,339	600353	旭光电子	16,160	132,512.00	0.02
1,340	000014	沙河股份	11,500	131,560.00	0.02
1,341	000534	万泽股份	7,800	130,806.00	0.02
1,342	300389	艾比森	6,300	128,331.00	0.02

1,343	688029	南微医学科技	1,554	126,744.24	0.02
1,344	688053	思科瑞微电子	2,000	124,280.00	0.02
1,345	300745	欣锐科技	2,800	123,676.00	0.02
1,346	601021	春秋航空	2,100	120,687.00	0.02
1,347	688488	艾迪药业	9,774	120,415.68	0.02
1,348	688516	奥特维科技	636	119,822.40	0.02
1,349	603225	新凤鸣	10,692	118,146.60	0.02
1,350	001210	金房节能	5,260	118,139.60	0.02
1,351	600415	小商品城	13,700	116,861.00	0.02
1,352	300672	国科微	1,400	116,690.00	0.02
1,353	300036	超图软件	4,900	116,179.00	0.02
1,354	002847	盐津铺子	1,350	114,817.50	0.02
1,355	603885	吉祥航空	7,400	114,182.00	0.02
1,356	600778	友好集团	16,600	112,880.00	0.02
1,357	301257	普蕊斯	2,000	112,400.00	0.02
1,358	002966	苏州银行	16,920	110,826.00	0.02
1,359	601636	旗滨集团	12,300	106,026.00	0.02
1,360	300020	银江技术	11,400	105,450.00	0.02
1,361	600688	上海石化	33,500	104,185.00	0.02
1,362	688018	乐鑫科技	800	103,856.00	0.02
1,363	605108	同庆楼	3,100	103,540.00	0.02
1,364	003011	海象新材	3,200	103,200.00	0.02
1,365	688580	伟思医疗	1,419	102,593.70	0.02
1,366	002991	甘源食品	1,300	99,710.00	0.01
1,367	688132	邦彦技术股份	3,627	98,581.86	0.01
1,368	300982	苏文电能	1,600	96,896.00	0.01
1,369	300702	天宇股份	3,900	94,653.00	0.01
1,370	002970	锐明技术	3,000	94,470.00	0.01
1,371	000921	海信家电	3,500	94,325.00	0.01
1,372	605599	菜百股份	6,800	89,828.00	0.01
1,373	301367	怡和嘉业	600	89,004.00	0.01
1,374	300984	金沃股份	3,380	88,657.40	0.01
1,375	002775	文科园林	23,600	88,500.00	0.01
1,376	002803	吉宏股份	4,300	87,978.00	0.01
1,377	600587	新华医疗	2,400	84,792.00	0.01
1,378	600824	益民集团	23,600	84,016.00	0.01
1,379	002234	民和股份	4,600	83,766.00	0.01
1,380	300736	百邦科技	6,700	81,673.00	0.01
1,381	002533	金杯电工	9,934	81,061.44	0.01
1,382	605167	利柏特	8,300	80,344.00	0.01
1,383	601916	浙商银行	29,740	78,513.60	0.01
1,384	688408	中信博新能源	930	78,426.90	0.01
1,385	688223	晶科能源	5,534	77,808.04	0.01

1,386	002530	金财互联	8,500	77,010.00	0.01
1,387	600961	株冶集团	9,500	76,855.00	0.01
1,388	002357	富临运业	11,300	75,936.00	0.01
1,389	300267	尔康制药	23,500	75,905.00	0.01
1,390	688395	深圳正弦电气股份	2,777	73,840.43	0.01
1,391	688551	科威尔股份	1,122	73,580.76	0.01
1,392	603165	荣晟环保	4,500	72,180.00	0.01
1,393	002638	勤上股份	21,500	71,595.00	0.01
1,394	600100	同方股份	8,800	71,456.00	0.01
1,395	600129	太极集团	1,200	71,388.00	0.01
1,396	300861	美畅股份	1,639	71,083.43	0.01
1,397	301117	佳缘科技	1,100	71,082.00	0.01
1,398	002918	蒙娜丽莎	4,600	71,024.00	0.01
1,399	600822	上海物贸	5,201	70,993.65	0.01
1,400	300456	赛微电子	2,900	70,992.00	0.01
1,401	688418	震有科技	3,340	70,407.20	0.01
1,402	300624	万兴科技	600	70,290.00	0.01
1,403	603230	内蒙新华	5,441	70,188.90	0.01
1,404	688277	天智航医疗	3,800	70,072.00	0.01
1,405	688023	安恒信息	400	69,884.00	0.01
1,406	600085	同仁堂	1,200	69,072.00	0.01
1,407	300718	长盛轴承	3,100	68,975.00	0.01
1,408	601966	玲珑轮胎	3,100	68,882.00	0.01
1,409	688262	苏州国芯科技	1,684	68,521.96	0.01
1,410	002527	新时达	5,000	68,000.00	0.01
1,411	300454	深信服	600	67,950.00	0.01
1,412	000911	南宁糖业	7,000	67,340.00	0.01
1,413	300943	春晖智控	3,965	67,246.40	0.01
1,414	688677	青岛海泰新光	1,175	66,669.50	0.01
1,415	688793	倍轻松科技	1,236	66,620.40	0.01
1,416	000998	隆平高科	4,300	66,005.00	0.01
1,417	300225	金力泰	9,000	65,700.00	0.01
1,418	002080	中材科技	3,200	65,664.00	0.01
1,419	603787	新日股份	3,900	65,559.00	0.01
1,420	601377	兴业证券	10,700	65,484.00	0.01
1,421	003000	劲仔食品	5,200	65,468.00	0.01
1,422	002568	百润股份	1,800	65,430.00	0.01
1,423	300633	开立医疗	1,200	65,400.00	0.01
1,424	300147	香雪制药	12,400	65,348.00	0.01
1,425	300592	华凯易佰	2,400	65,328.00	0.01
1,426	605179	一鸣食品	6,000	65,280.00	0.01
1,427	603208	江山欧派	1,790	65,191.80	0.01
1,428	600375	汉马科技	8,600	65,188.00	0.01

1,429	002355	兴民智通	13,300	65,170.00	0.01
1,430	300262	巴安水务	24,500	65,170.00	0.01
1,431	603520	司太立	3,900	65,052.00	0.01
1,432	603129	春风动力	400	64,760.00	0.01
1,433	000516	国际医学	7,700	64,757.00	0.01
1,434	002333	罗普斯金	10,700	64,735.00	0.01
1,435	300005	探路者	7,700	64,680.00	0.01
1,436	600864	哈投股份	12,600	64,386.00	0.01
1,437	000531	穗恒运 A	8,900	64,347.00	0.01
1,438	300129	泰胜风能	6,700	64,253.00	0.01
1,439	600418	江淮汽车	5,100	64,209.00	0.01
1,440	300464	星徽股份	9,600	64,032.00	0.01
1,441	605188	国光连锁	7,400	63,788.00	0.01
1,442	300740	水羊股份	4,100	63,550.00	0.01
1,443	600859	王府井	3,200	63,328.00	0.01
1,444	600029	南方航空	10,500	63,315.00	0.01
1,445	600115	中国东航	13,300	63,308.00	0.01
1,446	000966	长源电力	11,300	63,054.00	0.01
1,447	002905	金逸影视	6,100	63,013.00	0.01
1,448	300811	铂科新材	1,060	63,006.40	0.01
1,449	688121	卓然技术	1,683	62,944.20	0.01
1,450	603997	继峰股份	4,400	62,920.00	0.01
1,451	002096	南岭民爆	5,300	62,699.00	0.01
1,452	300997	欢乐家	4,300	62,651.00	0.01
1,453	601111	中国国航	7,600	62,624.00	0.01
1,454	600397	安源煤业	21,500	62,350.00	0.01
1,455	301030	仕净科技	900	62,190.00	0.01
1,456	301089	拓新药业	1,000	61,940.00	0.01
1,457	600298	安琪酵母	1,700	61,557.00	0.01
1,458	688212	澳华内镜	900	61,110.00	0.01
1,459	603499	翔港科技	6,400	61,056.00	0.01
1,460	688777	中控技术	959	60,206.02	0.01
1,461	688305	科德数控	600	60,156.00	0.01
1,462	002669	康达新材	4,500	60,075.00	0.01
1,463	603949	雪龙集团	3,800	59,964.00	0.01
1,464	300465	高伟达	5,900	58,587.00	0.01
1,465	002066	瑞泰科技	4,900	58,555.00	0.01
1,466	603690	至纯科技	1,680	58,531.20	0.01
1,467	300098	高新兴	16,000	58,400.00	0.01
1,468	000838	财信发展	14,800	58,016.00	0.01
1,469	300365	恒华科技	7,600	57,836.00	0.01
1,470	002463	沪电股份	2,730	57,166.20	0.01
1,471	603278	大业股份	5,100	56,865.00	0.01

1,472	603757	大元泵业	1,900	56,696.00	0.01
1,473	603298	杭叉集团	2,400	56,520.00	0.01
1,474	300850	新强联	1,500	56,070.00	0.01
1,475	300170	汉得信息	4,837	55,818.98	0.01
1,476	688099	晶晨半导体	657	55,398.24	0.01
1,477	002111	威海广泰	5,760	54,950.40	0.01
1,478	300818	耐普矿机	2,300	54,625.00	0.01
1,479	002136	安纳达	4,800	54,624.00	0.01
1,480	301236	软通动力	2,000	54,420.00	0.01
1,481	002156	通富微电	2,400	54,240.00	0.01
1,482	603126	中材节能	7,000	54,180.00	0.01
1,483	600547	山东黄金	2,304	54,097.92	0.01
1,484	002782	可立克	3,500	53,515.00	0.01
1,485	603986	兆易创新	500	53,125.00	0.01
1,486	600742	一汽富维	6,400	52,416.00	0.01
1,487	688083	中望软件	360	52,160.40	0.01
1,488	002191	劲嘉股份	8,500	51,170.00	0.01
1,489	603519	立霸股份	3,400	50,388.00	0.01
1,490	002651	利君股份	6,400	49,728.00	0.01
1,491	603679	华体科技	3,300	49,236.00	0.01
1,492	603611	诺力股份	1,840	48,465.60	0.01
1,493	603167	渤海轮渡	6,800	48,280.00	0.01
1,494	601038	一拖股份	4,100	48,134.00	0.01
1,495	300978	东箭科技	3,500	47,705.00	0.01
1,496	603102	百合股份	1,100	47,509.00	0.01
1,497	600301	华锡有色	2,600	46,670.00	0.01
1,498	603578	三星新材	3,150	45,769.50	0.01
1,499	603709	中源家居	2,500	45,350.00	0.01
1,500	603283	赛腾股份	1,000	44,500.00	0.01
1,501	300263	隆华科技	5,300	44,096.00	0.01
1,502	603136	天目湖	1,700	43,860.00	0.01
1,503	300452	山河药辅	2,500	43,600.00	0.01
1,504	301258	富士莱	1,100	43,252.00	0.01
1,505	688722	同益中新材料	2,235	41,436.90	0.01
1,506	688288	鸿泉物联	1,600	40,672.00	0.01
1,507	002890	弘宇股份	2,700	39,879.00	0.01
1,508	688378	奥来德光电	800	39,520.00	0.01
1,509	300092	科新机电	2,400	39,360.00	0.01
1,510	600784	鲁银投资	5,432	39,327.68	0.01
1,511	002971	和远气体	1,500	38,475.00	0.01
1,512	300951	博硕科技	700	38,241.00	0.01
1,513	300002	神州泰岳	2,700	37,800.00	0.01
1,514	300774	倍杰特	3,200	37,248.00	0.01

1,515	600082	海泰发展	11,600	36,540.00	0.01
1,516	688626	翔宇医疗	800	36,408.00	0.01
1,517	688663	新风光科技	1,101	35,000.79	0.01
1,518	603393	新天然气	1,300	34,892.00	0.01
1,519	600908	无锡银行	6,300	33,768.00	0.00
1,520	601700	风范股份	6,300	33,453.00	0.00
1,521	002870	香山股份	1,000	33,170.00	0.00
1,522	002103	广博股份	5,500	32,945.00	0.00
1,523	605123	派克新材	300	32,595.00	0.00
1,524	300443	金雷股份	900	31,905.00	0.00
1,525	603112	华翔股份	2,700	31,752.00	0.00
1,526	688112	鼎阳科技	600	31,668.00	0.00
1,527	600989	宝丰能源	2,500	31,525.00	0.00
1,528	300971	博亚精工	1,200	31,500.00	0.00
1,529	301006	迈拓股份	1,200	31,380.00	0.00
1,530	688318	财富趋势	308	30,790.76	0.00
1,531	300938	信测标准	700	30,660.00	0.00
1,532	301276	嘉曼服饰	1,200	30,600.00	0.00
1,533	000795	英洛华	4,000	30,320.00	0.00
1,534	300615	欣天科技	1,700	30,073.00	0.00
1,535	001979	招商蛇口	2,300	29,969.00	0.00
1,536	300508	维宏股份	800	29,936.00	0.00
1,537	688025	杰普特光电	334	29,174.90	0.00
1,538	300803	指南针	600	29,154.00	0.00
1,539	605009	豪悦护理	600	28,800.00	0.00
1,540	300823	建科机械	1,400	28,770.00	0.00
1,541	603215	比依股份	1,600	28,704.00	0.00
1,542	002578	闽发铝业	7,800	28,626.00	0.00
1,543	002979	雷赛智能	1,200	28,512.00	0.00
1,544	301328	维峰电子	500	28,470.00	0.00
1,545	688387	中信科移动	3,400	28,390.00	0.00
1,546	002237	恒邦股份	2,600	28,314.00	0.00
1,547	300589	江龙船艇	1,800	28,206.00	0.00
1,548	002576	通达动力	1,400	27,986.00	0.00
1,549	688004	北京博汇科技	800	27,976.00	0.00
1,550	603040	新坐标	1,050	27,919.50	0.00
1,551	688718	唯赛勃科技	1,600	27,696.00	0.00
1,552	002987	京北方	1,260	27,619.20	0.00
1,553	600419	天润乳业	1,700	27,574.00	0.00
1,554	300509	新美星	3,635	27,444.25	0.00
1,555	002815	崇达技术	2,200	27,390.00	0.00
1,556	002476	宝莫股份	6,100	27,389.00	0.00
1,557	000058	深赛格	4,400	27,192.00	0.00

1,558	601975	招商南油	9,500	27,170.00	0.00
1,559	000488	晨鸣纸业	5,600	27,160.00	0.00
1,560	000959	首钢股份	7,700	26,950.00	0.00
1,561	002997	瑞鹄模具	900	26,757.00	0.00
1,562	603098	森特股份	1,300	26,650.00	0.00
1,563	300634	彩讯股份	1,000	26,400.00	0.00
1,564	300723	一品红	900	26,370.00	0.00
1,565	688621	阳光诺和	440	25,880.80	0.00
1,566	688711	江苏宏微科技	440	25,669.60	0.00
1,567	000826	启迪环境	9,000	25,290.00	0.00
1,568	002984	森麒麟	800	25,168.00	0.00
1,569	002222	福晶科技	900	24,966.00	0.00
1,570	600370	三房巷	9,300	24,924.00	0.00
1,571	300945	曼卡龙	1,600	24,832.00	0.00
1,572	603178	圣龙股份	2,000	24,640.00	0.00
1,573	688071	华依科技集团	400	24,460.00	0.00
1,574	688589	力合微电子	600	24,444.00	0.00
1,575	300747	锐科激光	800	24,384.00	0.00
1,576	002172	澳洋健康	6,900	24,219.00	0.00
1,577	002649	博彦科技	1,700	24,021.00	0.00
1,578	300968	格林精密	2,700	24,003.00	0.00
1,579	300378	鼎捷软件	700	23,975.00	0.00
1,580	688080	映翰通网络	490	23,961.00	0.00
1,581	603806	福斯特	643	23,913.17	0.00
1,582	688655	迅捷兴科技	1,450	23,838.00	0.00
1,583	688215	瑞晟智能科技	600	23,664.00	0.00
1,584	600850	电科数字	1,000	23,590.00	0.00
1,585	002865	钧达股份	154	23,489.62	0.00
1,586	600714	金瑞矿业	2,500	23,425.00	0.00
1,587	688092	爱科科技股份有限公司	784	23,418.08	0.00
1,588	300244	迪安诊断	900	23,067.00	0.00
1,589	603617	君禾股份	2,200	23,056.00	0.00
1,590	300641	正丹股份	4,250	22,907.50	0.00
1,591	300885	海昌新材	2,200	22,902.00	0.00
1,592	603327	福蓉科技	1,920	22,809.60	0.00
1,593	300849	锦盛新材	2,100	22,806.00	0.00
1,594	300396	迪瑞医疗	700	22,743.00	0.00
1,595	600967	内蒙一机	2,250	22,725.00	0.00
1,596	301002	崧盛股份	1,100	22,704.00	0.00
1,597	603182	嘉华生物科技股份	1,500	22,680.00	0.00
1,598	603002	宏昌电子	4,400	22,660.00	0.00
1,599	300091	金通灵	7,600	22,648.00	0.00
1,600	600602	云赛智联	1,500	22,590.00	0.00

1,601	600193	创兴资源	4,300	22,575.00	0.00
1,602	300324	旋极信息	6,800	22,508.00	0.00
1,603	300884	狄耐克	1,700	22,508.00	0.00
1,604	000988	华工科技	592	22,501.92	0.00
1,605	002836	新宏泽	2,760	22,494.00	0.00
1,606	301153	中科江南	300	22,488.00	0.00
1,607	002696	百洋股份	3,600	22,464.00	0.00
1,608	603226	菲林格尔	4,400	22,440.00	0.00
1,609	300289	利德曼	4,000	22,400.00	0.00
1,610	301238	瑞泰新材	1,100	22,374.00	0.00
1,611	300762	上海瀚讯	1,900	22,363.00	0.00
1,612	002620	瑞和股份	4,300	22,360.00	0.00
1,613	301221	光庭信息	400	22,332.00	0.00
1,614	600184	光电股份	1,700	22,321.00	0.00
1,615	300227	光韵达	2,800	22,316.00	0.00
1,616	002383	合众思壮	3,400	22,304.00	0.00
1,617	603739	蔚蓝生物	1,700	22,287.00	0.00
1,618	300411	金盾股份	3,400	22,270.00	0.00
1,619	600053	九鼎投资	1,800	22,266.00	0.00
1,620	300647	超频三	3,100	22,258.00	0.00
1,621	600235	民丰特纸	4,100	22,222.00	0.00
1,622	002389	航天彩虹	1,000	22,210.00	0.00
1,623	002631	德尔未来	4,100	22,140.00	0.00
1,624	600889	南京化纤	4,700	22,137.00	0.00
1,625	603789	星光农机	2,300	22,126.00	0.00
1,626	300067	安诺其	7,600	22,116.00	0.00
1,627	600319	亚星化学	4,400	22,088.00	0.00
1,628	600080	金花股份	3,000	22,080.00	0.00
1,629	600178	东安动力	3,300	22,077.00	0.00
1,630	601369	陕鼓动力	2,420	22,046.20	0.00
1,631	300385	雪浪环境	3,600	22,032.00	0.00
1,632	600983	惠而浦	2,900	22,011.00	0.00
1,633	300743	天地数码	1,400	22,008.00	0.00
1,634	603636	南威软件	1,500	22,005.00	0.00
1,635	600595	中孚实业	8,300	21,995.00	0.00
1,636	002662	京威股份	6,600	21,978.00	0.00
1,637	600448	华纺股份	7,400	21,978.00	0.00
1,638	300281	金明精机	4,100	21,976.00	0.00
1,639	300420	五洋停车	6,700	21,976.00	0.00
1,640	603235	天新药业	700	21,952.00	0.00
1,641	600538	国发股份	5,200	21,944.00	0.00
1,642	688280	精进电动	2,412	21,925.08	0.00
1,643	600867	通化东宝	2,100	21,924.00	0.00

1,644	000078	海王生物	6,800	21,896.00	0.00
1,645	000509	华塑控股	6,800	21,896.00	0.00
1,646	300703	创源股份	2,300	21,896.00	0.00
1,647	600052	东望时代	5,100	21,879.00	0.00
1,648	000973	佛塑科技	4,900	21,854.00	0.00
1,649	002278	神开股份	4,100	21,853.00	0.00
1,650	002224	三力士	4,600	21,850.00	0.00
1,651	002513	蓝丰生化	3,800	21,850.00	0.00
1,652	002214	大立科技	1,600	21,840.00	0.00
1,653	002523	天桥起重	7,500	21,825.00	0.00
1,654	605567	春雪食品	1,700	21,811.00	0.00
1,655	000823	超声电子	2,300	21,804.00	0.00
1,656	000599	青岛双星	5,100	21,777.00	0.00
1,657	300145	中金环境	7,400	21,756.00	0.00
1,658	300102	乾照光电	3,300	21,714.00	0.00
1,659	601113	华鼎股份	6,700	21,708.00	0.00
1,660	600391	航发科技	900	21,699.00	0.00
1,661	603819	神力股份	1,300	21,684.00	0.00
1,662	601718	际华集团	7,300	21,681.00	0.00
1,663	002084	海鸥住工	5,500	21,670.00	0.00
1,664	300180	华峰超纤	6,000	21,660.00	0.00
1,665	300101	振芯科技	1,117	21,658.63	0.00
1,666	002637	赞宇科技	2,100	21,651.00	0.00
1,667	600279	重庆港	5,200	21,632.00	0.00
1,668	603023	威帝股份	5,299	21,619.92	0.00
1,669	300004	南风股份	4,000	21,600.00	0.00
1,670	600815	厦工股份	8,000	21,600.00	0.00
1,671	002379	宏创控股	5,100	21,573.00	0.00
1,672	300933	中辰股份	2,800	21,560.00	0.00
1,673	600227	赤天化	7,700	21,560.00	0.00
1,674	603132	金徽股份	1,900	21,546.00	0.00
1,675	600299	安迪苏	2,700	21,519.00	0.00
1,676	600712	南宁百货	5,800	21,518.00	0.00
1,677	301186	超达装备	600	21,516.00	0.00
1,678	002134	天津普林	2,100	21,504.00	0.00
1,679	601212	白银有色	7,900	21,488.00	0.00
1,680	300485	赛升药业	2,100	21,483.00	0.00
1,681	300798	锦鸡股份	3,000	21,480.00	0.00
1,682	002244	滨江集团	2,435	21,476.70	0.00
1,683	300523	辰安科技	900	21,474.00	0.00
1,684	600691	阳煤化工	6,800	21,420.00	0.00
1,685	002672	东江环保	3,600	21,420.00	0.00
1,686	300126	锐奇股份	3,300	21,417.00	0.00

1,687	600293	三峡新材	8,100	21,384.00	0.00
1,688	603898	好莱客	2,200	21,384.00	0.00
1,689	300394	天孚通信	200	21,366.00	0.00
1,690	002490	山东墨龙	4,900	21,364.00	0.00
1,691	600678	四川金顶	4,000	21,360.00	0.00
1,692	603009	北特科技	3,000	21,360.00	0.00
1,693	301217	铜冠铜箔	1,500	21,345.00	0.00
1,694	600186	莲花健康	7,400	21,312.00	0.00
1,695	603727	博迈科	1,800	21,276.00	0.00
1,696	300694	蠡湖股份	2,000	21,260.00	0.00
1,697	300397	天和防务	1,900	21,242.00	0.00
1,698	600979	广安爱众	5,900	21,240.00	0.00
1,699	300611	美力科技	2,200	21,208.00	0.00
1,700	601611	中国核建	2,500	21,125.00	0.00
1,701	601777	力帆科技	5,900	21,063.00	0.00
1,702	002793	罗欣药业	3,900	21,021.00	0.00
1,703	300345	华民股份	2,000	20,920.00	0.00
1,704	688100	威胜信息	700	20,867.00	0.00
1,705	600810	神马股份	2,930	20,832.30	0.00
1,706	603206	嘉环科技	1,200	20,700.00	0.00
1,707	000639	西王食品	4,500	20,655.00	0.00
1,708	688358	祥生医疗科技	400	20,400.00	0.00
1,709	688013	天臣国际医疗科技	847	20,082.37	0.00
1,710	600590	泰豪科技	2,800	19,964.00	0.00
1,711	301200	大族数控	500	19,940.00	0.00
1,712	002496	辉丰股份	7,600	19,912.00	0.00
1,713	301120	新特电气	1,300	19,786.00	0.00
1,714	300927	江天化学	1,200	19,644.00	0.00
1,715	600559	老白干酒	800	19,608.00	0.00
1,716	600699	均胜电子	1,100	19,404.00	0.00
1,717	001313	粤海饲料	2,400	18,960.00	0.00
1,718	301219	腾远钴业	500	18,680.00	0.00
1,719	000561	烽火电子	1,600	18,512.00	0.00
1,720	301302	华如科技	500	18,400.00	0.00
1,721	603211	晋拓科技股份	1,000	18,380.00	0.00
1,722	605577	龙版传媒	1,600	18,224.00	0.00
1,723	603828	柯利达	6,100	18,178.00	0.00
1,724	600530	*ST 交昂	7,300	18,177.00	0.00
1,725	600249	两面针	3,281	18,045.50	0.00
1,726	301280	珠城科技	500	17,880.00	0.00
1,727	000518	四环生物	6,900	17,871.00	0.00
1,728	001270	铖昌科技	200	17,460.00	0.00
1,729	605336	帅丰电器	1,000	17,200.00	0.00

1,730	301004	嘉益股份	438	16,994.40	0.00
1,731	603533	掌阅科技	600	16,632.00	0.00
1,732	600332	白云山	500	15,940.00	0.00
1,733	600758	辽宁能源	3,400	15,878.00	0.00
1,734	300879	大叶股份	800	15,224.00	0.00
1,735	002174	游族网络	900	15,120.00	0.00
1,736	300822	贝仕达克	1,100	15,004.00	0.00
1,737	688588	凌志软件	953	14,819.15	0.00
1,738	300838	浙江力诺	800	14,616.00	0.00
1,739	300360	炬华科技	800	14,304.00	0.00
1,740	300030	阳普医疗	1,900	14,193.00	0.00
1,741	301160	翔楼新材	400	14,060.00	0.00
1,742	600509	天富能源	1,800	14,058.00	0.00
1,743	300417	南华仪器	1,300	13,962.00	0.00
1,744	688511	天微电子	400	13,640.00	0.00
1,745	300739	明阳电路	900	13,401.00	0.00
1,746	002583	海能达	2,300	13,363.00	0.00
1,747	688056	莱伯泰科仪器	300	13,302.00	0.00
1,748	002738	中矿资源	260	13,244.40	0.00
1,749	000031	大悦城	3,600	13,176.00	0.00
1,750	605033	美邦股份	700	13,090.00	0.00
1,751	300017	网宿科技	1,800	12,798.00	0.00
1,752	300852	四会富仕	300	12,438.00	0.00
1,753	002186	全聚德	1,000	12,180.00	0.00
1,754	002937	兴瑞科技	490	12,054.00	0.00
1,755	002652	扬子新材	4,500	11,880.00	0.00
1,756	002149	西部材料	700	11,753.00	0.00
1,757	600511	国药股份	300	11,655.00	0.00
1,758	300068	南都电源	600	11,616.00	0.00
1,759	300563	神宇股份	700	11,438.00	0.00
1,760	688560	明冠新材料	400	11,116.00	0.00
1,761	002786	银宝山新	1,700	10,965.00	0.00
1,762	600756	浪潮软件	659	10,952.58	0.00
1,763	600300	维维股份	3,600	10,944.00	0.00
1,764	603056	德邦股份	700	10,794.00	0.00
1,765	301312	智立方	100	10,616.00	0.00
1,766	603229	奥翔药业	500	10,490.00	0.00
1,767	600212	绿能慧充	1,100	10,318.00	0.00
1,768	300632	光莆股份	800	10,224.00	0.00
1,769	300752	隆利科技	600	10,218.00	0.00
1,770	301123	奕东电子	400	10,216.00	0.00
1,771	603809	豪能股份	900	10,107.00	0.00
1,772	300881	盛德鑫泰	300	9,885.00	0.00

1,773	603600	永艺股份	1,000	9,510.00	0.00
1,774	688389	深圳普门科技	400	9,396.00	0.00
1,775	002216	三全食品	600	9,348.00	0.00
1,776	688617	惠泰医疗	25	9,343.75	0.00
1,777	002950	奥美医疗	900	9,342.00	0.00
1,778	603766	隆鑫通用	1,700	8,976.00	0.00
1,779	688701	浙江卓锦股份	1,000	8,970.00	0.00
1,780	301286	侨源股份	300	8,850.00	0.00
1,781	603466	风语筑	600	8,340.00	0.00
1,782	688799	华纳大药厂	200	8,124.00	0.00
1,783	688303	大全能源	200	8,090.00	0.00
1,784	605255	天普股份	500	7,900.00	0.00
1,785	002060	粤水电	1,200	7,896.00	0.00
1,786	301183	东田微	100	7,880.00	0.00
1,787	605338	巴比食品	300	7,575.00	0.00
1,788	603357	设计总院	720	7,560.00	0.00
1,789	002916	深南电路	100	7,537.00	0.00
1,790	603233	大参林	260	7,282.60	0.00
1,791	600458	时代新材	600	7,194.00	0.00
1,792	603926	铁流股份	680	6,956.40	0.00
1,793	002491	通鼎互联	1,000	6,920.00	0.00
1,794	000068	华控赛格	2,300	6,877.00	0.00
1,795	002863	今飞凯达	1,100	6,864.00	0.00
1,796	600623	华谊集团	1,100	6,853.00	0.00
1,797	002627	三峡旅游	1,300	6,786.00	0.00
1,798	002765	蓝黛科技	800	6,688.00	0.00
1,799	600750	江中药业	300	6,579.00	0.00
1,800	002196	方正电机	900	6,336.00	0.00
1,801	003019	宸展光电	300	6,150.00	0.00
1,802	603063	禾望电气	200	6,150.00	0.00
1,803	600903	贵州燃气	700	6,055.00	0.00
1,804	603667	五洲新春	400	5,952.00	0.00
1,805	600580	卧龙电驱	400	5,844.00	0.00
1,806	002161	远望谷	1,100	5,731.00	0.00
1,807	603383	顶点软件	100	5,542.00	0.00
1,808	601020	华钰矿业	640	5,497.60	0.00
1,809	603800	道森股份	200	5,440.00	0.00
1,810	603778	乾景园林	1,000	5,400.00	0.00
1,811	300658	延江股份	819	5,364.45	0.00
1,812	000423	东阿阿胶	100	5,345.00	0.00
1,813	002871	伟隆股份	400	5,280.00	0.00
1,814	603551	奥普家居	400	5,172.00	0.00
1,815	000920	沃顿科技	500	5,060.00	0.00

1,816	300366	创意信息	400	4,944.00	0.00
1,817	002757	南兴股份	300	4,839.00	0.00
1,818	300558	贝达药业	100	4,803.00	0.00
1,819	603328	依顿电子	561	4,645.08	0.00
1,820	603788	宁波高发	370	4,558.40	0.00
1,821	603166	福达股份	674	4,542.76	0.00
1,822	002732	燕塘乳业	200	4,324.00	0.00
1,823	300305	裕兴股份	400	4,320.00	0.00
1,824	600021	上海电力	400	4,308.00	0.00
1,825	600248	陕建股份	900	4,293.00	0.00
1,826	603088	宁波精达	500	4,190.00	0.00
1,827	300554	三超新材	200	4,166.00	0.00
1,828	300467	迅游科技	200	4,086.00	0.00
1,829	000409	云鼎科技	400	3,996.00	0.00
1,830	600578	京能电力	1,000	3,910.00	0.00
1,831	001332	锡装股份	100	3,891.00	0.00
1,832	600114	东睦股份	500	3,810.00	0.00
1,833	603871	嘉友国际	240	3,770.40	0.00
1,834	601360	三六零	300	3,762.00	0.00
1,835	001316	润贝航科	100	3,727.00	0.00
1,836	600007	中国国贸	200	3,704.00	0.00
1,837	000603	盛达资源	300	3,627.00	0.00
1,838	002301	齐心集团	500	3,595.00	0.00
1,839	002892	科力尔	260	3,588.00	0.00
1,840	002432	九安医疗	100	3,521.00	0.00
1,841	600062	华润双鹤	200	3,484.00	0.00
1,842	300588	熙菱信息	300	3,468.00	0.00
1,843	603071	物产环能	200	3,318.00	0.00
1,844	600237	铜峰电子	400	3,292.00	0.00
1,845	300537	广信材料	200	3,268.00	0.00
1,846	603822	嘉澳环保	100	3,255.00	0.00
1,847	002650	加加食品	800	3,160.00	0.00
1,848	603767	中马传动	200	3,092.00	0.00
1,849	688425	铁建重工	600	2,886.00	0.00
1,850	600993	马应龙	100	2,781.00	0.00
1,851	301130	西点药业	100	2,748.00	0.00
1,852	002048	宁波华翔	200	2,680.00	0.00
1,853	002097	山河智能	400	2,660.00	0.00
1,854	605258	协和电子	100	2,598.00	0.00
1,855	603556	海兴电力	100	2,524.00	0.00
1,856	300680	隆盛科技	100	2,487.00	0.00
1,857	001230	劲旅环境	100	2,451.00	0.00
1,858	002276	万马股份	200	2,422.00	0.00

1,859	300476	胜宏科技	100	2,411.00	0.00
1,860	002494	华斯股份	500	2,315.00	0.00
1,861	600420	国药现代	200	2,258.00	0.00
1,862	002081	金螳螂	500	2,255.00	0.00
1,863	600268	国电南自	300	2,247.00	0.00
1,864	605500	森林包装	300	2,238.00	0.00
1,865	300907	康平科技	100	2,147.00	0.00
1,866	300992	泰福泵业	100	2,012.00	0.00
1,867	000682	东方电子	200	1,944.00	0.00
1,868	300447	全信股份	100	1,919.00	0.00
1,869	601801	皖新传媒	200	1,878.00	0.00
1,870	601019	山东出版	200	1,834.00	0.00
1,871	000848	承德露露	200	1,770.00	0.00
1,872	603657	春光科技	100	1,755.00	0.00
1,873	300050	世纪鼎利	400	1,740.00	0.00
1,874	600285	羚锐制药	100	1,606.00	0.00
1,875	000056	皇庭国际	400	1,556.00	0.00
1,876	300711	广哈通信	100	1,496.00	0.00
1,877	600230	沧州大化	100	1,468.00	0.00
1,878	603701	德宏股份	100	1,419.00	0.00
1,879	600895	张江高科	100	1,392.00	0.00
1,880	002635	安洁科技	100	1,380.00	0.00
1,881	603811	诚意药业	100	1,243.00	0.00
1,882	300144	宋城演艺	100	1,240.00	0.00
1,883	600281	华阳新材	300	1,215.00	0.00
1,884	603506	南都物业	100	1,183.00	0.00
1,885	603028	赛福天	100	1,182.00	0.00
1,886	300462	华铭智能	100	1,174.00	0.00
1,887	000719	中原传媒	100	1,170.00	0.00
1,888	000975	银泰黄金	100	1,170.00	0.00
1,889	000419	通程控股	200	1,098.00	0.00
1,890	300824	北鼎股份	100	1,048.00	0.00
1,891	002314	南山控股	300	990.00	0.00
1,892	600528	中铁工业	100	988.00	0.00
1,893	600676	交运股份	200	874.00	0.00
1,894	300169	天晟新材	200	836.00	0.00
1,895	601798	蓝科高新	100	759.00	0.00
1,896	600798	宁波海运	200	702.00	0.00
1,897	301215	中汽股份	100	627.00	0.00
1,898	301175	中科环保	100	623.00	0.00
1,899	002546	新联电子	100	615.00	0.00
1,900	002264	新华都	100	599.00	0.00
1,901	000700	模塑科技	100	558.00	0.00

1,902	002429	兆驰股份	100	550.00	0.00
1,903	600491	龙元建设	100	504.00	0.00
1,904	000753	漳州发展	100	485.00	0.00
1,905	000428	华天酒店	100	418.00	0.00
1,906	002341	新纶新材	100	348.00	0.00
1,907	600545	卓郎智能	100	248.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002273	水晶光电	10,662,183.83	1.44
2	000999	华润三九	10,607,348.86	1.43
3	301302	华如科技	9,379,538.40	1.27
4	300701	森霸传感	9,308,346.44	1.26
5	600549	厦门钨业	9,228,299.50	1.25
6	301268	铭利达	9,221,187.16	1.24
7	000063	中兴通讯	9,203,779.36	1.24
8	603688	石英股份	9,185,275.00	1.24
9	600284	浦东建设	9,079,295.77	1.23
10	000738	航发控制	9,044,592.90	1.22
11	600969	郴电国际	8,788,324.20	1.19
12	002353	杰瑞股份	8,685,343.00	1.17
13	000728	国元证券	8,658,171.68	1.17
14	300015	爱尔眼科	8,585,323.94	1.16
15	603178	圣龙股份	8,569,284.00	1.16
16	603191	望变电气	8,546,360.45	1.15
17	002152	广电运通	8,539,468.00	1.15
18	603939	益丰药房	8,523,625.28	1.15
19	001228	永泰运	8,401,731.60	1.13
20	300136	信维通信	8,330,301.88	1.12

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002273	水晶光电	10,607,461.00	1.43
2	000999	华润三九	9,726,096.67	1.31
3	300701	森霸传感	9,417,477.62	1.27
4	301302	华如科技	9,254,710.04	1.25
5	600284	浦东建设	9,158,060.84	1.24
6	000063	中兴通讯	8,934,244.29	1.21
7	600969	郴电国际	8,900,866.20	1.20

8	300015	爱尔眼科	8,795,358.52	1.19
9	300136	信维通信	8,750,501.00	1.18
10	603178	圣龙股份	8,699,850.00	1.17
11	000738	航发控制	8,628,026.00	1.16
12	301268	铭利达	8,502,663.00	1.15
13	000728	国元证券	8,469,162.90	1.14
14	603060	国检集团	8,458,847.14	1.14
15	300002	神州泰岳	8,455,695.00	1.14
16	002353	杰瑞股份	8,444,792.20	1.14
17	600549	厦门钨业	8,443,344.00	1.14
18	000402	金融街	8,433,991.00	1.14
19	300003	乐普医疗	8,379,535.00	1.13
20	001228	永泰运	8,341,511.60	1.13

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,779,100,271.49
卖出股票收入（成交）总额	5,881,324,546.40

注：卖出股票收入（成交）总额中扣除了增值税的影响。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
-	-	-	-
9	其他	-	-
10	合计	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

金额单位：人民币元

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

注：本基金本期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期内无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内无国债期货投资。

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

无。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,775,603.68

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,360.91
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	1,795,964.59

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

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

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

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

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国海量化优选一年持有股票 A	149	161,489.17	3,987,792.94	16.57	20,074,093.77	83.43
国海量化优选一年持有股票 C	10,146	34,813.23	18,382,984.42	5.20	334,832,094.88	94.80

合计	10,295	36,646.62	22,370,777.36	5.93	354,906,188.65	94.07
----	--------	-----------	---------------	------	----------------	-------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	国海量化优选一年持有股票 A	500,196.12	0.13
	国海量化优选一年持有股票 C	6,923,194.76	1.83
	合计	7,423,390.88	1.97

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国海量化优选一年持有股票 A	-
	国海量化优选一年持有股票 C	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	国海量化优选一年持有股票 A	-
	国海量化优选一年持有股票 C	0~10
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日 (2021年8月23日) 基金份额总额	61,870,332.78	-
本报告期期初基金份额总额	29,481,316.46	412,118,808.63
本报告期基金总申购份额	-	38,775,357.04
减：本报告期基金总赎回份额	5,419,429.75	97,679,086.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	24,061,886.71	353,215,079.30

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

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

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	2	11,662,057,726.16	100.00	3,863,490.11	100.00	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 1 月 28 日
2	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 1 月 28 日
3	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 14 日
4	国海证券股份有限公司关于旗下部分集合资产管理计划增加盈米基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 27 日
5	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 3 月 31 日
6	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2022 年年度报告	中国证监会规定网站	2023 年 3 月 31 日
7	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 4 月 21 日

8	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 4 月 21 日
9	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 5 月 12 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，

投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

国海证券股份有限公司

2023 年 8 月 31 日