

南华丰汇混合型证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:南华基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月29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。

本报告期自2023年1月1日起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	105
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	106
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	106
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	106

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	106
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	106
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	106
8.12 投资组合报告附注.....	106
§9 基金份额持有人信息	108
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	108
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	109
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	109
§10 开放式基金份额变动	109
§11 重大事件揭示.....	109
11.1 基金份额持有人大会决议	109
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	110
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	110
11.4 基金投资策略的改变	111
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	111
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	111
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	111
11.8 其他重大事件	112
§12 影响投资者决策的其他重要信息	118
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	118
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	119
§13 备查文件目录.....	119
13.1 备查文件目录.....	119
13.2 存放地点	119
13.3 查阅方式	119

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南华丰汇混合型证券投资基金
基金简称	南华丰汇混合
基金主代码	015245
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年02月28日
基金管理人	南华基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	659,559,050.22份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>本基金把握宏观经济和投资市场的变化趋势，动态调整投资组合比例，自上而下配置资产，有效分散风险，力求获取超额收益。</p> <p>1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、衍生品投资策略；6、存托凭证投资策略。</p>
业绩比较基准	70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价（总值）指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型基金，风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	南华基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 姓名	卞璐璐	陆志俊

露负责人	联系电话	0571-26896499	95559
	电子邮箱	services@nanhuafunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400-810-5599	95559
传真		0571-56108133	021-62701216
注册地址		浙江省东阳市横店影视产业 实验区商务楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		浙江省杭州市上城区横店大 厦801室	中国（上海）长宁区仙霞路1 8号
邮政编码		310008	200336
法定代表人		朱坚	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nanhuafunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 （特殊普通合伙）	中国上海市浦东新区东育路588号前 滩中心42楼
注册登记机构	南华基金管理有限公司	浙江省杭州市上城区横店大厦801室

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年02月28日（基金合同 生效日）-2022年12月31日
----------------------	-------	--------------------------------------

本期已实现收益	14,765,406.65	1,694,531.89
本期利润	11,673,644.82	1,223,104.23
加权平均基金份额本期利润	0.0514	0.0647
本期加权平均净值利润率	4.15%	6.19%
本期基金份额净值增长率	21.96%	3.21%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末
期末可供分配利润	137,689,664.77	339,596.21
期末可供分配基金份额利润	0.2088	0.0321
期末基金资产净值	830,250,218.28	10,906,367.43
期末基金份额净值	1.2588	1.0321
3.1.3 累计期末指标	2023年末	2022年末
基金份额累计净值增长率	25.88%	3.21%

注：（1）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；

（2）上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；

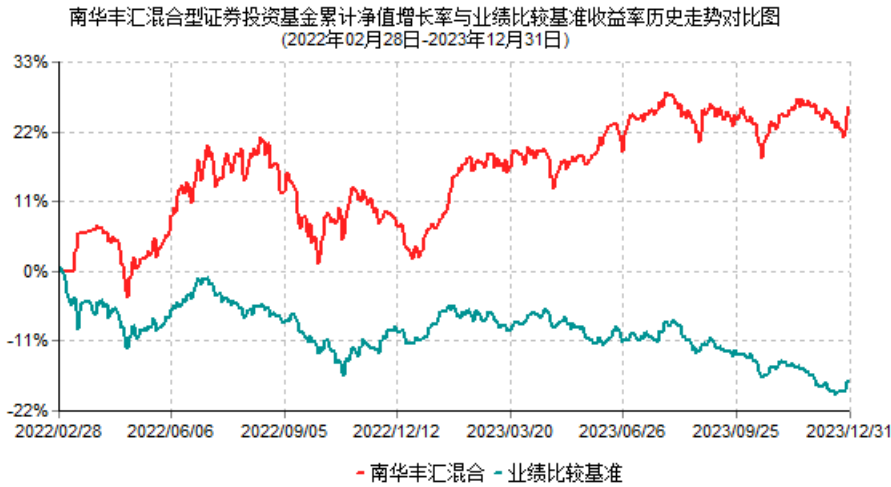
3.2 基金净值表现

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

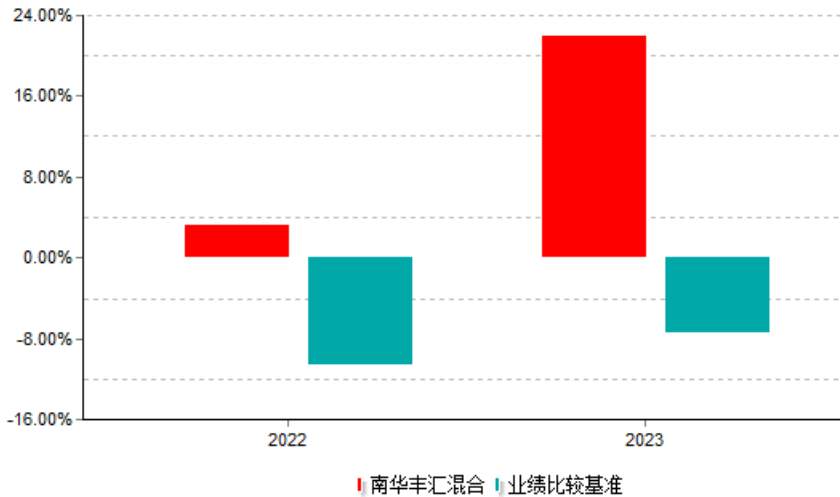
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.12%	0.79%	-4.68%	0.55%	4.80%	0.24%
过去六个月	1.54%	0.77%	-7.30%	0.59%	8.84%	0.18%
过去一年	21.96%	0.79%	-7.37%	0.59%	29.33%	0.20%
自基金合同	25.88%	1.02%	-17.19%	0.76%	43.07%	0.26%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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



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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日（2022年2月28日）至本报告期末未实施利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

南华基金管理有限公司于2016年10月18日经中国证监会核准设立，于2016年11月17日经工商注册登记成立，是国内第一家由期货公司全资控股的公募基金管理公司，股东为南华期货股份有限公司。公司注册资本2.5亿元，注册地为浙江省东阳市横店影视产业实验区商务楼。

截止报告期末，南华基金管理有限公司旗下共管理15只公募基金，分别为南华瑞盈混合型发起式证券投资基金、南华丰淳混合型证券投资基金、南华瑞鑫定期开放债券型发起式证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金、南华瑞元定期开放债券型发起式证券投资基金、南华价值启航纯债债券型证券投资基金、南华瑞泽债券型证券投资基金、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金、南华瑞利债券型证券投资基金、南华丰汇混合型证券投资基金、南华瑞诚一年定期开放债券型发起式证券投资基金及南华瑞富一年定期开放债券型发起式证券投资基金，资产管理规模约172.56亿元。

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		
黄志钢	本基金基金经理	2022-03-05	-	18	硕士研究生，具有基金从业资格。2004年7月5日至2005年7月14日在美国未来之路任交易员，2005年7月15日至2006年12月10日任海通期货研究发展部研究员，2006年12月10日至2008年10月21日任国元证券衍生产品部高级经理，2008年10月21日至2015年6月5日任国联安基金量化投资部基金经理，2015年6月8日至2018年6月30日任金鹰基金指数

					及量化投资部总经理，2019年1月1日至2019年8月1日任南华期货研究所量化投资总监，2019年8月入职南华基金管理有限公司，现任公司总经理助理兼量化投资部总经理。现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2022年1月29日起任职）、南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2022年1月29日起任职）、南华丰汇混合型证券投资基金基金经理（2022年3月5日起任职）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理（2023年11月18日起任职）、南华丰元量化选股混合型证券投资基金基金经理（2024年1月23日起任职）
康冬	本基金基金经理助理	2022-03-10	-	6	博士研究生，具有基金从业资格。曾先后工作于中航证券有限公司风险管理部和南华期货股份有限公司基金部，于2020年1月13日入职南华基金管理有限公司量化投资部，先后担任研究员、投资经理助理。曾任南华瑞泰39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华瑞

				<p>泽债券型证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日至2022年8月26日止）、南华瑞盈混合型发起式证券投资基金基金经理助理（2021年12月11日至2022年8月26日止）、南华瑞恒中短债债券型证券投资基金基金经理助理（2022年6月24日至2022年8月26日止）、南华瑞扬纯债债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月15日至2022年8月26日止）、南华丰淳混合型证券投资基金基金经理助理（2022年7月21日至2022年8月26日止）、南华瑞利债券型证券投资基金基金经理助理（2022年3月28日至2022年8月26日止，2022年3月15日至2022年3月27日任职南华瑞利纯债债券型证券投资基金基金经理助理，南华瑞利纯债债券型证券投资基金后转型为南华瑞利债券型证券投资基金）。现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2023年8月30日起任职），南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2023年8月30日起任职）、南华丰</p>
--	--	--	--	---

					汇混合型证券投资基金基金经理助理（2022年3月10日起任职）、南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理助理（2023年11月21日起任职）。
王步余	基金经理助理	2023-12-14	-	2	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任浙江安诚数盈投资管理有限公司量化策略研究员、正则私募证券基金管理（深圳）有限公司基金经理助理。现任南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理（2023年11月29日起任职），南华中证杭州湾区交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理（2023年11月29日起任职），南华瑞泽债券型证券投资基金基金经理助理（2023年12月14日起任职），南华丰汇混合型证券投资基金基金经理助理（2023年12月14日起任职）。

- (1) 基金经理黄志钢、基金经理助理康冬、王步余的任职日期是指公司做出决定后公告之日；
- (2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定；
- (3) 本基金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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有

人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》以及《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《南华基金管理有限公司公平交易管理细则》，对公平交易的原则与内容、研究支持、投资决策内部控制、交易执行内部控制、行为监控和分析评估、信息披露及外部监督等进行了详细的规范。

本基金管理人根据相关制度建立科学的研究、投资决策、交易、公平交易分析体系，并通过加强交易执行环节内部控制，通过工作流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过对投资交易行为的监控，分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《南华基金管理有限公司公平交易管理细则》的规定，通过系统和人工等方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。

在投资决策内部控制方面，本基金管理人确保各投资组合在获取研究信息、投资建议及实施投资决策方面享有平等的机会。健全投资授权制度，明确各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策。建立投资组合投资信息的管理及保密制度，通过岗位设置、制度约束、技术手段相结合的方式，使不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

在交易执行控制方面，本基金管理人实行集中交易制度，交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，确保公平对待各投资组合。对于一级市场申购等场外交易，按照公平交易原则建立和完善了相关分配机制。

本报告期内，公司对不同时间窗下（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合合同向交易的差价进行分析，未发现违反公平交易原则的异常情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制及监控制度，报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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，市场结构分化延续，小市值、价值风格表现相对强势，而大市值、成长风格的表现相对落后。这种持续的撕裂结构，无疑增大了投资的难度，无论是采取趋势跟随还是采取均值回复，都会承受心理和业绩上的双重考验。我们继续秉持相对中庸的做法，在宏观上不做预测，在行业上不赌赛道，在风格上不走极端，我们相信行稳方可致远。在四季度，为防范大市值股票的脉冲式行情导致净值的波动，我们小比例配置了大市值股票组合，形成非对称的哑铃型结构，虽然这部分配置，对组合有一定的负向贡献，但是从预防风险角度来看，还是具有一定的配置价值。

我们主策略较2022年底基本没有大的调整，形成了相对成熟的量化价值策略。策略从价值投资的底层原理出发，就“安全边际的构建、价值陷阱的识别、个股潜在回报的定价”三个维度进行量化，从而实现“人为市场立法”，使得投资不做随市场随波逐流。

我们的选股方法始终是全市场内选股，并没有刻意在某个市值域内选股，这种自下而上的选股方法，在市值上是自适应的，最终表现出来的组合特征，在股价上偏左侧，在基本上偏右侧。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末南华丰汇混合基金份额净值为1.2588元，本报告期内，基金份额净值增长率为21.96%，同期业绩比较基准收益率为-7.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年在市场逐步出清下，供需结构将有所改善，预期全年经济增速将维持平稳。

A股估值方面，从市盈率来看，2023年12月31日沪深300市盈率TTM为10.85，位于近5年的3.53%分位数，处于历史底部。从股息率来看，沪深300的最新股息率为3.16%，高出中国10年期国债收益率60BP。A股无论是在相对估值或是不同资产中的绝对收益上，均体现出一定优势。

企业盈利方面，从上市公司财务数据看，2023年三季度上市公司的企业盈利能力仍处于近5年底部，但是以消费、服务类为主的部分行业企业盈利能力已经得到改善。国家统计局公布的工业企业盈利数据显示，四季度工业企业的盈利增速已经开始转正，随着上市公司年报的陆续披露，上市公司企业盈利增速的改善也可能得到逐步验证。

利率方面，截至2024年3月26日，美国国债10年期收益率为4.23%，相较于2023年的高位已经下滑79BP；中国国债10年期收益率为2.28%，接近历史低位。随着美元指数走弱，美债收益率下滑，A股在国内以及全球的大类资产配置中，性价比愈发凸显。

综上，当前A股估值处在历史底部，企业盈利未来有望边际改善，海内外利率下行背景下，A股极具投资性价比，主要宏观经济指标持续改善，中国经济正逐步修复。随着经济回暖，2024年A股有望震荡上行。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内与本基金相关的内部监察稽核主要工作如下：

在合规稽核方面，本基金管理人以中国证监会“季度监察稽核项目表”为基础，对包含本基金在内的所有产品的投资、研究、交易、基金会计、注册登记、营销、宣传推介等重要业务进行每季度的风险自查，并形成季度监察稽核报告提交公司董事及独立董事审阅。除定期稽核外，本基金管理人还对公司的关键业务部门及业务流程进行检查、管理。在投资、研究及交易环节，持续对研究报告进行合规性检查，对投资池建立及完善进行跟踪检查，对基金投资比例进行日常监控，对关联交易进行严格管理，对基金持仓流动性风险持续关注，对公平交易执行情况监督，并推动完善交易对手库管理、交易对手筛选及质押券风险管理等等；在营销方面，本基金管理人持续对本基金宣传推介材料的合规性进行审核，并对直销机构履行投资者适当性管理义务进行合规性检查；在基金的运营方面，本基金管理人加强对注册登记业务、基金会计业务、基金清算业务以及基金估值业务的管理，并通过基金托管人的独立复核，确保本基金财务数据的准确性；在反洗钱工作方面，本基金管理人根据监管机构要求制定并实施反洗钱专门制度和 workflows，落实洗钱风险监测标准制定和实施，在开户环节和日常业务中严格反洗钱客户身份识别，可疑客户和可疑交易筛查和分析，防控反洗钱风险。

本基金管理人在事中、事后等阶段对基金投资合规情况及风险情况进行严格的内部监控和管理。报告期内，本基金的投资运作符合国家相关法律法规、监管部门的有关规定以及公司相关制度的规定，未出现利益输送、内幕交易及其他损害基金投资者利益的行为。本基金的投资目标、投资决策依据和投资管理程序均符合相关基金合同和招募说明书的约定。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。本基金管理人估值委员会成员包括公司分管投资部门的高管、分管运营部门的高管、监察稽核部、运营管理部代表。基金经理可向估值委员会提出相关意见和建议，但不参与意见表决。

基金日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司合作，由其提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未实施利润分配。

4.9 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

本基金报告期存在连续超过60个工作日基金资产净值低于五千万的情形，时间段为2023年1月1日至2023年3月30日。根据2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件，本基金管理人已向中国证券监督管理委员会提交解决方案。本基金报告期存在连续超过20个工作日基金资产净值低于五千万的情形，时间段为2023年4月13日至2023年5月25日。根据2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的条件，本基金管理人已在定期报告中予以披露。

§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，交通银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在南华丰汇混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律、法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由南华基金管理有限公司编制、本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第26398号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南华丰汇混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了南华丰汇混合型证券投资基金(以下简称"南华丰汇混合基金")的财务报表, 包括2023年12月31日的资产负债表, 2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二) 我们的意见 我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制, 公允反映了南华丰汇混合基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则, 我们独立于南华丰汇混合基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-

其他信息	<p>南华丰汇混合基金的基金管理人南华基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括南华丰汇混合基金2023年度年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估南华丰汇混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南华丰汇混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督南华丰汇混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职</p>

	<p>业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对南华丰汇混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致南华丰汇混合基金不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	郭蕙心、李旭芳
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2024-03-28

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：南华丰汇混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	47,597,077.23	903,105.10
结算备付金		3,099,280.29	4,133.17
存出保证金		253,774.08	3,927.54
交易性金融资产	7.4.7.2	753,179,294.56	10,194,321.97
其中：股票投资		751,907,206.67	9,186,979.01
基金投资		-	-
债券投资		1,272,087.89	1,007,342.96
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	27,996,778.09	-
应收清算款		4,907,903.61	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,849,215.99	1,498.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		839,883,323.85	11,106,985.98
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		7,987,087.08	43,546.36
应付管理人报酬		425,311.89	4,881.68
应付托管费		70,885.33	813.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		29.29	19.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,149,791.98	151,357.44
负债合计		9,633,105.57	200,618.55
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	659,559,050.22	10,566,771.22
未分配利润	7.4.7.12	170,691,168.06	339,596.21
净资产合计		830,250,218.28	10,906,367.43
负债和净资产总计		839,883,323.85	11,106,985.98

注：

- 1.本基金基金合同生效日为2022年2月28日。
- 2.报告截止日2023年12月31日，基金份额净值1.2588元，基金份额总额659,559,050.22份。

7.2 利润表

会计主体：南华丰汇混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日 (基金合同生效 日)至2022年12

			月31日
一、营业总收入		13,741,137.18	1,458,778.55
1.利息收入		379,580.93	112,402.03
其中：存款利息收入	7.4.7.13	222,948.16	108,280.54
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		156,632.77	4,121.49
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		15,216,835.99	212,609.00
其中：股票投资收益	7.4.7.14	13,865,113.81	7,547.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	92,851.78	102,738.49
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	1,258,870.40	102,323.20
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-3,091,761.83	-471,427.66
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,236,482.09	1,605,195.18
减：二、营业总支出		2,067,492.36	235,674.32
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	1,641,624.82	88,569.28
2.托管费	7.4.10.2.2	273,604.14	14,761.50
3.销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-

5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7.税金及附加		27.73	12.63
8.其他费用	7.4.7.23	152,235.67	132,330.91
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,673,644.82	1,223,104.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,673,644.82	1,223,104.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,673,644.82	1,223,104.23

7.3 净资产变动表

会计主体：南华丰汇混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,566,771.22	339,596.21	10,906,367.43
二、本期期初净资产	10,566,771.22	339,596.21	10,906,367.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	648,992,279.00	170,351,571.85	819,343,850.85
(一)、综合收益总额	-	11,673,644.82	11,673,644.82
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资	648,992,279.00	158,677,927.03	807,670,206.03

产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	908,568,060.68	220,089,142.87	1,128,657,203.55
2.基金赎回款	-259,575,781.68	-61,411,215.84	-320,986,997.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	659,559,050.22	170,691,168.06	830,250,218.28
项目	上年度可比期间 2022年02月28日(基金合同生效日)至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	202,729,068.62	-	202,729,068.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-192,162,297.40	339,596.21	-191,822,701.19
(一)、综合收益总额	-	1,223,104.23	1,223,104.23
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-192,162,297.40	-883,508.02	-193,045,805.42
其中：1.基金申购款	26,254,923.99	2,263,124.46	28,518,048.45
2.基金赎回款	-218,417,221.39	-3,146,632.48	-221,563,853.87

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	10,566,771.22	339,596.21	10,906,367.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

曾媛

连省

母学贤

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

南华丰汇混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]3686号《关于准予南华丰汇混合型证券投资基金注册的批复》注册，由南华基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币202,713,916.79元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0198号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》于2022年2月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为202,729,068.62份基金份额，其中认购资金利息折合15,151.83份基金份额。本基金的基金管理人为南华基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票(包括创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)和存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货、货币市场工具、同业存单、银行存款以及现金，以及法律法规或中国证监会允许基金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基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，

可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票、存托凭证的比例占基金资产的60%-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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金的业绩比较基准为70%×沪深300指数收益率+30%×中债综合全价(总值)指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人南华基金管理有限公司于2024年3月28日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较期财务报表的实际编制期间为2022年2月28日(基金合同生效日)至2022年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，

包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公

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

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

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1)赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2)该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3)该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4)除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5)该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关

于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	47,597,077.23	903,105.10
等于：本金	47,581,924.47	902,793.62
加：应计利息	15,152.76	311.48
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	47,597,077.23	903,105.10

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	755,413,298.28	-	751,907,206.67	-3,506,091.61
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,644.89	1,272,087.89	-57,097.88
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,644.89	1,272,087.89	-57,097.88
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	756,738,839.16	3,644.89	753,179,294.56	-3,563,189.49
项目	上年度末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	9,634,412.89	-	9,186,979.01	-447,433.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,203.96	1,007,342.96	-23,993.78
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,203.96	1,007,342.96	-23,993.78
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	10,662,545.67	3,203.96	10,194,321.97	-471,427.66

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	27,996,778.09	-
银行间市场	-	-
合计	27,996,778.09	-
项目	上年度末 2022年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	9,288.72	54.54
应付交易费用	990,503.26	21,302.90
其中：交易所市场	990,503.26	21,302.90
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	130,000.00
合计	1,149,791.98	151,357.44

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,566,771.22	10,566,771.22
本期申购	908,568,060.68	908,568,060.68
本期赎回（以“-”号填列）	-259,575,781.68	-259,575,781.68
本期末	659,559,050.22	659,559,050.22

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	339,596.21
本期期初	786,359.99	-446,763.78	339,596.21
本期利润	14,765,406.65	-3,091,761.83	11,673,644.82
本期基金份额交易产生的变动数	122,137,898.13	36,540,028.90	158,677,927.03
其中：基金申购款	172,431,568.28	47,657,574.59	220,089,142.87
基金赎回款	-50,293,670.15	-11,117,545.69	-61,411,215.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	137,689,664.77	33,001,503.29	170,691,168.06

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
活期存款利息收入	199,755.94	30,715.46
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	22,070.99	77,519.86
其他	1,121.23	45.22
合计	222,948.16	108,280.54

7.4.7.14 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01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	935,149,948.72	36,459,033.78
减：卖出股票成本总额	918,647,092.06	36,348,132.26
减：交易费用	2,637,742.85	103,354.21
买卖股票差价收入	13,865,113.81	7,547.31

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	10,572.94	6,463.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	82,278.84	96,275.03
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	92,851.78	102,738.49

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	3,505,730.77	2,710,081.67
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	3,412,554.16	2,601,973.06
减：应计利息总额	10,657.16	11,685.24
减：交易费用	240.61	148.34
买卖债券差价收入	82,278.84	96,275.03

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,258,870.40	102,323.20
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,258,870.40	102,323.20

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-3,091,761.83	-471,427.66
——股票投资	-3,058,657.73	-447,433.88
——债券投资	-33,104.10	-23,993.78
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
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	-3,091,761.83	-471,427.66

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至202 3年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
基金赎回费收入	1,234,821.86	1,605,153.95
基金转换费收入	1,660.23	41.23
合计	1,236,482.09	1,605,195.18

注：

- 1.本基金的赎回费率按持有期间递减。对于持有期少于30日的南华丰汇混合所收取的赎回费，赎回费用全额归入基金财产；对于持有期不少于30日但少于90日的南华丰汇混合所收取的赎回费，不低于赎回费用的75%归入基金财产；对持续持有期不少于90日但少于180日的投资者收取的赎回费，将赎回费总额的50%计入基金财产。
- 2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
审计费用	30,000.00	30,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
银行汇划手续费	2,235.67	1,930.91
证券开户费	-	400.00
合计	152,235.67	132,330.91

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南华基金管理有限公司("南华基金")	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人、基金销售机构
南华期货股份有限公司("南华期货公司")	基金管理人的股东、基金销售机构
横店集团得邦照明股份有限公司	基金管理人的股东关联方
江苏常熟农村商业银行股份有限公司	基金管理人的股东关联方

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬**7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,641,624.82	88,569.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	526,186.15	23,438.40
应支付基金管理人的净管理费	1,115,438.67	65,130.88

注：支付基金管理人南华基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.60%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生
----	-------------------	------------------------------

	至2023年12月31日	效日)至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	273,604.14	14,761.50

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值X0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01 日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年02月28日（基金 合同生效日）至2022年1 2月31日
基金合同生效日（2022年02月28日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	4,213,777.60	-
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	4,213,777.60	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.64%	0.00%

7.4.10.4.2 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

关联方名	本期末	上年度末
------	-----	------

称	2023年12月31日		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
南华期货公司	4,258,724.04	0.65%	0.00	0.00%

7.4.10.5 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01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年02月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	47,597,077.23	199,755.94	903,105.10	30,715.46

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

1、本基金本报告期，于2023年10月20日买入横店集团得邦照明股份有限公司在上海证券交易所发行的股票。

证券名称：得邦照明，证券代码：603303.SH，买入单位价格：13.8474元，总计金额：710373.85.00元，买入数量：51300股。

上述股票发行人为本基金基金管理人股东的关联公司。该关联交易符合本基金的投资范围和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，交易价格公允。本公司严格按照法律法规的要求和基金合同的约定，履行相关程序，不存在利益输送情况。

2、本基金本报告期，于2023年10月23日卖出横店集团得邦照明股份有限公司在上海证券交易所发行的股票。

证券名称：得邦照明，证券代码：603303.SH，成交均价：13.2927元，总计金额：681916.34.00元，卖出数量：51300股。

上述股票发行人为本基金基金管理人股东的关联公司。该关联交易符合本基金的投资范围和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，交易价格公允。本公司严格按照法律法规的要求和基金合同的约定，履行相关程序，不存在利益输送情况。

3、本基金本报告期，于2023年10月16日买入江苏常熟农村商业银行股份有限公司在上海证券交易所发行的股票。

证券名称：常熟银行，证券代码：601128.SH，买入单位价格：7.4093元，总计金额：314894.8700元，买入数量：42500股。

上述股票发行人为本基金基金管理人股东的关联公司。该关联交易符合本基金的投资范围和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，交易价格公允。本公司严格按照法律法规的要求和基金合同的约定，履行相关程序，不存在利益输送情况。

4、本基金本报告期，于2023年12月18日卖出江苏常熟农村商业银行股份有限公司在上海证券交易所发行的股票。

证券名称：常熟银行，证券代码：601128.SH，成交均价：6.6141元，总计金额：626351.8200元，卖出数量：94700股。

上述股票发行人为本基金基金管理人股东的关联公司。该关联交易符合本基金的投资范围和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，交易价格公允。本公司严格按照法律法规的要求和基金合同的约定，履行相关程序，不存在利益输送情况。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301526	国际复材	2023-12-19	6个月	新股流通受限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股流通受限	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-

301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股流通受限	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月	新股流通受限	11.25	11.07	1,116	12,555.00	12,354.12	-
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301516	中远通	2023-12-01	6个月	新股流通受限	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股流通受限	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6个月	新股流通受限	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股流通受限	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股流通受限	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股流通受限	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-

603373	安邦 护卫	2023-12-13	6个月	新股 流通 受限	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
--------	----------	------------	-----	----------------	-------	-------	----	----------	----------	---

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，风险水平和预期收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，综合运用多种投资策略，力争实现基金资产的持续稳健增值。

本基金的基金管理人建立了全面风险管理体系，在董事会下设立风险管理委员会，根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策，并对其实施情况及效果进行监督和评价，指导公司的风险管理和内控制度建设；对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估；监督公司的财务状况，审计公司的财务报表，评估公司的财务表现，保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准。在管理层层面设立风险防控委员会，主要负责制定公司经营管理中的风险控制政策，组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度；对公司在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督；以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面，监察稽核部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制并承担其他风险的管理职责，负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由风险防控委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告等确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人交通银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	235,033.13	195,955.16

AAA以下	1,037,054.76	811,387.80
未评级	-	-
合计	1,272,087.89	1,007,342.96

注：1、上述评级均取自第三方评级机构。

2、以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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的久期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货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	47,597,077.23	-	-	-	47,597,077.23
结算备付金	3,099,280.29	-	-	-	3,099,280.29
存出保证金	253,774.08	-	-	-	253,774.08
交易性金融资产	65,338.52	1,088,022.00	118,727.37	751,907,206.67	753,179,294.56
买入返售金融资产	27,996,778.09	-	-	-	27,996,778.09
应收清算款	-	-	-	4,907,903.61	4,907,903.61
应收申购款	-	-	-	2,849,215.99	2,849,215.99
资产总计	79,012,248.21	1,088,022.00	118,727.37	759,664,326.27	839,883,323.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,987,087.08	7,987,087.08
应付管理人报酬	-	-	-	425,311.89	425,311.89

应付托管费	-	-	-	70,885.33	70,885.33
应交税费	-	-	-	29.29	29.29
其他负债	-	-	-	1,149,791.98	1,149,791.98
负债总计	-	-	-	9,633,105.57	9,633,105.57
利率敏感度缺口	79,012,248.21	1,088,022.00	118,727.37	750,031,220.70	830,250,218.28
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					
货币资金	903,105.10	-	-	-	903,105.10
结算备付金	4,133.17	-	-	-	4,133.17
存出保证金	3,927.54	-	-	-	3,927.54
交易性金融资产	67,621.52	731,927.93	207,793.51	9,186,979.01	10,194,321.97
应收申购款	-	-	-	1,498.20	1,498.20
资产总计	978,787.33	731,927.93	207,793.51	9,188,477.21	11,106,985.98
负债					
应付赎回款	-	-	-	43,546.36	43,546.36
应付管理人报酬	-	-	-	4,881.68	4,881.68
应付托	-	-	-	813.60	813.60

管费					
应交税费	-	-	-	19.47	19.47
其他负债	-	-	-	151,357.44	151,357.44
负债总计	-	-	-	200,618.55	200,618.55
利率敏感度缺口	978,787.33	731,927.93	207,793.51	8,987,858.66	10,906,367.43

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31日，本基金持有的交易性债券投资和公允价值占基金净资产的比例为0.15%（2022年12月31日：9.24%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格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除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合中股票、存托凭证投资比例占基金资产的比例范围为60%-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，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一

年以内的政府债券，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31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	751,907,206.67	90.56	9,186,979.01	84.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,272,087.89	0.15	1,007,342.96	9.24
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	753,179,294.56	90.72	10,194,321.97	93.47

注：由于四舍五入的原因，公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有误差。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)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12月31日	上年度末 2022年12月31日

	业绩比较基准上升5%	48,129,605.15	393,610.80
	业绩比较基准下降5%	-48,129,605.15	-393,610.80

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	753,031,316.91	10,194,321.97
第二层次	-	-
第三层次	147,977.65	-
合计	753,179,294.56	10,194,321.97

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	91,071.67	91,071.67
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	56,905.98	56,905.98
其中：计入损益的利得或损失	-	56,905.98	56,905.98
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	147,977.65	147,977.65
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	56,905.98	56,905.98
项目	上年度可比期间		
	2022年02月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
债券投资	股票投资		
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-

计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	147,977.65	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	8.0080%-27.4249%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022年12月31日：同）。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	751,907,206.67	89.53
	其中：股票	751,907,206.67	89.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,272,087.89	0.15
	其中：债券	1,272,087.89	0.15
	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	27,996,778.09	3.33
	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	50,696,357.52	6.04
8	其他各项资产	8,010,893.68	0.95
9	合计	839,883,323.85	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	955,376.00	0.12
B	采矿业	21,490,473.00	2.59
C	制造业	493,777,443.05	59.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,439,596.00	8.00
E	建筑业	935,064.00	0.11

F	批发和零售业	8,171,022.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	38,752,951.32	4.67
H	住宿和餐饮业	8,118,002.00	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,482,955.00	3.19
J	金融业	14,505,630.30	1.75
K	房地产业	14,393,978.00	1.73
L	租赁和商务服务业	9,923,826.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	13,873,244.00	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	20,438,744.00	2.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	953,946.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	12,694,956.00	1.53
S	综合	-	-
	合计	751,907,206.67	90.56

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601816	京沪高铁	1,034,400	5,089,248.00	0.61
2	600887	伊利股份	187,500	5,015,625.00	0.60
3	002783	凯龙股份	430,400	4,988,336.00	0.60
4	688408	中信博	65,909	4,728,970.75	0.57
5	002749	国光股份	390,900	4,682,982.00	0.56
6	688226	威腾电气	245,847	4,621,923.60	0.56
7	603507	振江股份	177,100	4,588,661.00	0.55

8	605167	利柏特	480,400	4,558,996.00	0.55
9	003002	壶化股份	298,700	4,537,253.00	0.55
10	603315	福鞍股份	312,200	4,536,266.00	0.55
11	300860	锋尚文化	82,900	4,528,827.00	0.55
12	300808	久量股份	289,400	4,508,852.00	0.54
13	603225	新凤鸣	314,300	4,463,060.00	0.54
14	300902	国安达	126,600	4,462,650.00	0.54
15	300001	特锐德	221,300	4,448,130.00	0.54
16	603993	洛阳钼业	849,300	4,416,360.00	0.53
17	688772	珠海冠宇	199,700	4,395,397.00	0.53
18	000027	深圳能源	679,300	4,381,485.00	0.53
19	300068	南都电源	337,800	4,371,132.00	0.53
20	688223	晶科能源	493,300	4,370,638.00	0.53
21	300851	交大思诺	140,200	4,370,034.00	0.53
22	000777	中核科技	299,800	4,359,092.00	0.53
23	300644	南京聚隆	210,000	4,357,500.00	0.52
24	688636	智明达	66,800	4,355,360.00	0.52
25	300387	富邦股份	521,300	4,347,642.00	0.52
26	002782	可立克	308,000	4,327,400.00	0.52
27	601966	玲珑轮胎	225,000	4,326,750.00	0.52
28	605288	凯迪股份	91,800	4,325,616.00	0.52
29	688571	杭华股份	578,238	4,325,220.24	0.52
30	300457	赢合科技	234,100	4,316,804.00	0.52
31	002823	凯中精密	339,600	4,312,920.00	0.52
32	002686	亿利达	636,300	4,307,751.00	0.52
33	688033	天宜上佳	254,298	4,297,636.20	0.52
34	688080	映翰通	105,900	4,297,422.00	0.52
35	601500	通用股份	1,035,200	4,285,728.00	0.52
36	301046	能辉科技	158,000	4,284,960.00	0.52
37	603041	美思德	318,100	4,281,626.00	0.52

38	688616	西力科技	313,900	4,281,596.00	0.52
39	002917	金奥博	433,500	4,278,645.00	0.52
40	300321	同大股份	221,100	4,278,285.00	0.52
41	300441	鲍斯股份	620,900	4,278,001.00	0.52
42	301008	宏昌科技	141,700	4,277,923.00	0.52
43	301149	隆华新材	345,800	4,277,546.00	0.52
44	600201	生物股份	396,800	4,273,536.00	0.51
45	002991	甘源食品	59,800	4,273,308.00	0.51
46	300625	三雄极光	288,100	4,269,642.00	0.51
47	605222	起帆电缆	221,300	4,266,664.00	0.51
48	002984	森麒麟	147,700	4,261,145.00	0.51
49	603992	松霖科技	234,200	4,248,388.00	0.51
50	605300	佳禾食品	270,999	4,243,844.34	0.51
51	300999	金龙鱼	127,100	4,242,598.00	0.51
52	001207	联科科技	248,700	4,240,335.00	0.51
53	688510	航亚科技	240,600	4,239,372.00	0.51
54	600425	青松建化	1,072,000	4,234,400.00	0.51
55	300829	金丹科技	202,600	4,230,288.00	0.51
56	002753	永东股份	512,400	4,227,300.00	0.51
57	600497	驰宏锌锗	837,000	4,226,850.00	0.51
58	300756	金马游乐	260,740	4,223,988.00	0.51
59	301043	绿岛风	128,700	4,212,351.00	0.51
60	600346	恒力石化	319,800	4,211,766.00	0.51
61	000973	佛塑科技	861,200	4,211,268.00	0.51
62	300898	熊猫乳品	174,300	4,211,088.00	0.51
63	000838	财信发展	1,146,700	4,208,389.00	0.51
64	002969	嘉美包装	1,021,100	4,206,932.00	0.51
65	603167	渤海轮渡	473,400	4,203,792.00	0.51
66	300501	海顺新材	291,300	4,203,459.00	0.51
67	002083	孚日股份	831,900	4,192,776.00	0.51

68	002282	博深股份	517,400	4,190,940.00	0.50
69	603111	康尼机电	751,300	4,184,741.00	0.50
70	300888	稳健医疗	112,300	4,183,175.00	0.50
71	688601	力芯微	79,800	4,180,722.00	0.50
72	300905	宝丽迪	215,200	4,170,576.00	0.50
73	603221	爱丽家居	419,200	4,166,848.00	0.50
74	300978	东箭科技	303,400	4,165,682.00	0.50
75	688028	沃尔德	167,310	4,164,345.90	0.50
76	600023	浙能电力	902,900	4,162,369.00	0.50
77	002381	双箭股份	549,100	4,162,178.00	0.50
78	600288	大恒科技	364,800	4,151,424.00	0.50
79	002032	苏泊尔	78,299	4,150,629.99	0.50
80	000883	湖北能源	981,200	4,150,476.00	0.50
81	605162	新中港	451,600	4,150,204.00	0.50
82	300695	兆丰股份	78,300	4,146,768.00	0.50
83	688208	道通科技	174,438	4,142,902.50	0.50
84	002820	桂发祥	362,700	4,142,034.00	0.50
85	600754	锦江酒店	138,500	4,141,150.00	0.50
86	603112	华翔股份	340,700	4,139,505.00	0.50
87	601956	东贝集团	693,300	4,139,001.00	0.50
88	002899	英派斯	249,900	4,135,845.00	0.50
89	600517	国网英大	866,700	4,134,159.00	0.50
90	000538	云南白药	84,100	4,133,515.00	0.50
91	601163	三角轮胎	286,800	4,132,788.00	0.50
92	301033	迈普医学	94,900	4,131,946.00	0.50
93	600642	申能股份	643,600	4,131,912.00	0.50
94	601333	广深铁路	1,595,200	4,131,568.00	0.50
95	300577	开润股份	281,400	4,128,138.00	0.50
96	688179	阿拉丁	215,400	4,127,064.00	0.50
97	002918	蒙娜丽莎	304,800	4,126,992.00	0.50

98	002035	华帝股份	664,400	4,125,924.00	0.50
99	600644	乐山电力	592,700	4,125,192.00	0.50
100	688219	会通股份	376,000	4,124,720.00	0.50
101	002998	优彩资源	518,800	4,124,460.00	0.50
102	001203	大中矿业	405,300	4,121,901.00	0.50
103	600578	京能电力	1,390,800	4,116,768.00	0.50
104	002296	辉煌科技	499,000	4,116,750.00	0.50
105	000888	峨眉山A	460,600	4,113,158.00	0.50
106	001209	洪兴股份	229,600	4,112,136.00	0.50
107	600749	西藏旅游	349,600	4,111,296.00	0.50
108	600737	中粮糖业	498,900	4,110,936.00	0.50
109	000905	厦门港务	573,300	4,110,561.00	0.50
110	300355	蒙草生态	1,095,800	4,109,250.00	0.49
111	600897	厦门空港	328,480	4,102,715.20	0.49
112	003012	东鹏控股	497,100	4,101,075.00	0.49
113	300819	聚杰微纤	263,700	4,100,535.00	0.49
114	600138	中青旅	386,100	4,100,382.00	0.49
115	002732	燕塘乳业	213,500	4,099,200.00	0.49
116	000025	特力A	257,500	4,096,825.00	0.49
117	600977	中国电影	334,700	4,096,728.00	0.49
118	002007	华兰生物	185,100	4,096,263.00	0.49
119	605338	巴比食品	190,600	4,094,088.00	0.49
120	000690	宝新能源	924,100	4,093,763.00	0.49
121	600116	三峡水利	543,600	4,093,308.00	0.49
122	605169	洪通燃气	361,100	4,091,263.00	0.49
123	605268	王力安防	420,000	4,090,800.00	0.49
124	688276	百克生物	74,600	4,088,826.00	0.49
125	600262	北方股份	212,400	4,088,700.00	0.49
126	300872	天阳科技	298,500	4,083,480.00	0.49
127	300164	通源石油	854,800	4,077,396.00	0.49

128	600623	华谊集团	632,900	4,075,876.00	0.49
129	600054	黄山旅游	374,500	4,074,560.00	0.49
130	000554	泰山石油	706,100	4,074,197.00	0.49
131	300111	向日葵	1,340,000	4,073,600.00	0.49
132	300253	卫宁健康	566,500	4,073,135.00	0.49
133	603326	我乐家居	431,800	4,071,874.00	0.49
134	601991	大唐发电	1,682,300	4,071,166.00	0.49
135	300144	宋城演艺	412,300	4,069,401.00	0.49
136	001213	中铁特货	968,700	4,068,540.00	0.49
137	603680	今创集团	430,000	4,063,500.00	0.49
138	600650	锦江在线	423,500	4,052,895.00	0.49
139	601018	宁波港	1,137,100	4,048,076.00	0.49
140	002393	力生制药	155,000	4,045,500.00	0.49
141	600488	津药药业	824,700	4,041,030.00	0.49
142	000852	石化机械	656,000	4,034,400.00	0.49
143	600789	鲁抗医药	564,900	4,033,386.00	0.49
144	600021	上海电力	476,700	4,032,882.00	0.49
145	603676	卫信康	386,600	4,032,238.00	0.49
146	600572	康恩贝	798,400	4,031,920.00	0.49
147	002608	江苏国信	613,500	4,030,695.00	0.49
148	600292	远达环保	664,000	4,030,480.00	0.49
149	000539	粤电力A	823,400	4,026,426.00	0.48
150	300292	吴通控股	1,081,000	4,021,320.00	0.48
151	600735	新华锦	623,400	4,020,930.00	0.48
152	600493	凤竹纺织	597,900	4,017,888.00	0.48
153	605158	华达新材	528,100	4,013,560.00	0.48
154	600979	广安爱众	1,157,200	4,003,912.00	0.48
155	300145	中金环境	1,324,500	3,999,990.00	0.48
156	002627	三峡旅游	748,300	3,995,922.00	0.48
157	600675	中华企业	1,266,900	3,990,735.00	0.48

158	000061	农产品	616,300	3,987,461.00	0.48
159	002563	森马服饰	691,000	3,987,070.00	0.48
160	600258	首旅酒店	254,600	3,976,852.00	0.48
161	000797	中国武夷	1,328,000	3,970,720.00	0.48
162	603058	永吉股份	432,600	3,923,682.00	0.47
163	300350	华鹏飞	760,800	3,902,904.00	0.47
164	000729	燕京啤酒	451,600	3,897,308.00	0.47
165	002171	楚江新材	487,700	3,647,996.00	0.44
166	002558	巨人网络	288,300	3,211,662.00	0.39
167	300194	福安药业	725,500	3,177,690.00	0.38
168	605580	恒盛能源	272,400	3,165,288.00	0.38
169	600249	两面针	538,800	3,146,592.00	0.38
170	600276	恒瑞医药	40,500	1,831,815.00	0.22
171	300760	迈瑞医疗	5,600	1,627,360.00	0.20
172	603288	海天味业	37,400	1,419,330.00	0.17
173	600309	万华化学	16,900	1,298,258.00	0.16
174	000002	万科A	108,900	1,139,094.00	0.14
175	601888	中国中免	13,300	1,113,077.00	0.13
176	600048	保利发展	109,600	1,085,040.00	0.13
177	300750	宁德时代	6,500	1,061,190.00	0.13
178	601166	兴业银行	62,700	1,016,367.00	0.12
179	601012	隆基绿能	43,200	989,280.00	0.12
180	601138	工业富联	65,000	982,800.00	0.12
181	300274	阳光电源	11,100	972,249.00	0.12
182	601398	工商银行	201,800	964,604.00	0.12
183	002475	立讯精密	28,000	964,600.00	0.12
184	002714	牧原股份	23,200	955,376.00	0.12
185	600050	中国联通	218,000	954,840.00	0.12
186	000858	五粮液	6,800	954,108.00	0.11
187	300015	爱尔眼科	60,300	953,946.00	0.11

188	000725	京东方 A	244,100	951,990.00	0.11
189	600406	国电南瑞	42,500	948,600.00	0.11
189	600028	中国石化	170,000	948,600.00	0.11
191	601601	中国太保	39,700	944,066.00	0.11
192	601318	中国平安	23,400	943,020.00	0.11
193	002142	宁波银行	46,630	937,729.30	0.11
194	002352	顺丰控股	23,200	937,280.00	0.11
195	000001	平安银行	99,800	937,122.00	0.11
196	601899	紫金矿业	75,200	936,992.00	0.11
197	601857	中国石油	132,600	936,156.00	0.11
198	601668	中国建筑	194,400	935,064.00	0.11
199	600030	中信证券	45,900	934,983.00	0.11
200	002304	洋河股份	8,500	934,150.00	0.11
201	002594	比亚迪	4,700	930,600.00	0.11
202	300059	东方财富	66,200	929,448.00	0.11
203	600905	三峡能源	212,500	928,625.00	0.11
204	600036	招商银行	33,300	926,406.00	0.11
205	600000	浦发银行	139,700	924,814.00	0.11
206	601225	陕西煤业	44,200	923,338.00	0.11
207	600809	山西汾酒	4,000	922,920.00	0.11
208	600436	片仔癀	3,800	919,562.00	0.11
209	688111	金山办公	2,900	916,980.00	0.11
210	601288	农业银行	250,800	912,912.00	0.11
211	601088	中国神华	28,800	902,880.00	0.11
212	603259	药明康德	12,400	902,224.00	0.11
213	600519	贵州茅台	500	863,000.00	0.10
214	002027	分众传媒	113,900	719,848.00	0.09
215	000568	泸州老窖	3,900	699,738.00	0.08
216	600900	长江电力	29,300	683,862.00	0.08
217	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.01

218	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
219	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
220	601083	锦江航运	1,116	12,354.12	0.00
221	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
222	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
223	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
224	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
225	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
226	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
227	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
228	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
229	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
230	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300978	东箭科技	11,914,878.02	109.25
2	300898	熊猫乳品	8,297,088.00	76.08
3	688169	石头科技	8,264,856.58	75.78
4	300164	通源石油	8,140,688.00	74.64
5	000027	深圳能源	8,127,389.00	74.52
6	300808	久量股份	8,119,225.00	74.44
7	300881	盛德鑫泰	8,032,325.40	73.65
8	300001	特锐德	7,907,799.00	72.51
9	002782	可立克	7,839,023.00	71.88
10	300111	向日葵	7,827,048.00	71.77
11	002991	甘源食品	7,528,161.00	69.03

12	600288	大恒科技	7,482,935.00	68.61
13	002521	齐峰新材	7,263,839.73	66.60
14	300872	天阳科技	7,237,960.00	66.36
15	000011	深物业A	7,229,442.00	66.29
16	002558	巨人网络	7,222,240.86	66.22
17	300999	金龙鱼	7,064,430.00	64.77
18	002687	乔治白	7,062,041.40	64.75
19	300292	吴通控股	7,050,774.00	64.65
20	605158	华达新材	7,016,210.20	64.33
21	300017	网宿科技	6,426,729.00	58.93
22	000411	英特集团	6,108,209.90	56.01
23	600826	兰生股份	5,981,674.00	54.85
24	600054	黄山旅游	5,980,209.50	54.83
25	000055	方大集团	5,966,953.00	54.71
26	603578	三星新材	5,960,218.60	54.65
27	000852	石化机械	5,901,645.07	54.11
28	002969	嘉美包装	5,840,003.00	53.55
29	300888	稳健医疗	5,785,686.20	53.05
30	002103	广博股份	5,655,973.00	51.86
31	601816	京沪高铁	5,641,916.00	51.73
32	300607	拓斯达	5,641,207.80	51.72
33	600887	伊利股份	5,610,874.00	51.45
34	002381	双箭股份	5,586,614.00	51.22
35	000058	深赛格	5,573,030.00	51.10
36	605288	凯迪股份	5,567,441.20	51.05
37	300583	赛托生物	5,523,326.51	50.64
38	600675	中华企业	5,457,542.00	50.04
39	600642	申能股份	5,440,083.50	49.88
40	300414	中光防雷	5,403,220.92	49.54
41	605300	佳禾食品	5,348,153.60	49.04

42	003011	海象新材	5,331,550.00	48.88
43	688223	晶科能源	5,282,302.87	48.43
44	600497	驰宏锌锗	5,277,346.81	48.39
45	301043	绿岛风	5,162,629.70	47.34
46	003012	东鹏控股	5,144,535.42	47.17
47	603326	我乐家居	5,106,997.00	46.83
48	600650	锦江在线	5,095,793.99	46.72
49	300144	宋城演艺	5,055,986.89	46.36
50	002998	优彩资源	5,038,315.00	46.20
51	003002	壶化股份	4,980,036.00	45.66
52	605268	王力安防	4,971,034.00	45.58
53	600737	中粮糖业	4,956,935.00	45.45
54	600623	华谊集团	4,951,773.00	45.40
55	300756	金马游乐	4,949,344.20	45.38
56	600258	首旅酒店	4,942,667.00	45.32
57	002899	英派斯	4,934,932.00	45.25
58	002732	燕塘乳业	4,918,254.00	45.10
59	600517	国网英大	4,914,710.91	45.06
60	601018	宁波港	4,903,699.90	44.96
61	603676	卫信康	4,886,940.00	44.81
62	688208	道通科技	4,884,811.53	44.79
63	300457	赢合科技	4,880,455.00	44.75
64	603121	华培动力	4,855,827.60	44.52
65	001209	洪兴股份	4,834,249.05	44.33
66	600635	大众公用	4,819,578.00	44.19
67	002984	森麒麟	4,807,592.00	44.08
68	688601	力芯微	4,800,486.77	44.02
69	600897	厦门空港	4,795,317.80	43.97
70	601163	三角轮胎	4,778,926.00	43.82
71	600021	上海电力	4,775,633.14	43.79

72	600572	康恩贝	4,743,126.80	43.49
73	002917	金奥博	4,730,341.00	43.37
74	002918	蒙娜丽莎	4,729,585.81	43.37
75	600903	贵州燃气	4,728,414.98	43.35
76	600977	中国电影	4,727,821.00	43.35
77	300644	南京聚隆	4,726,009.00	43.33
78	601956	东贝集团	4,712,873.40	43.21
79	603507	振江股份	4,694,882.00	43.05
80	603221	爱丽家居	4,694,606.00	43.04
81	601966	玲珑轮胎	4,680,468.00	42.92
82	300355	蒙草生态	4,676,263.00	42.88
83	688179	阿拉丁	4,665,685.49	42.78
84	605338	巴比食品	4,651,800.00	42.65
85	603993	洛阳钼业	4,650,378.00	42.64
86	000538	云南白药	4,646,620.71	42.60
87	688276	百克生物	4,617,369.28	42.34
88	002032	苏泊尔	4,615,866.97	42.32
89	688191	智洋创新	4,606,442.07	42.24
90	600754	锦江酒店	4,605,268.60	42.23
91	688033	天宜上佳	4,594,950.33	42.13
92	688408	中信博	4,591,730.99	42.10
93	002990	盛视科技	4,573,866.59	41.94
94	000777	中核科技	4,565,217.00	41.86
95	002608	江苏国信	4,563,271.00	41.84
96	603225	新凤鸣	4,563,095.00	41.84
97	601991	大唐发电	4,551,718.00	41.73
98	300577	开润股份	4,537,682.00	41.61
99	000539	粤电力A	4,525,571.40	41.49
100	688571	杭华股份	4,520,649.22	41.45
101	001203	大中矿业	4,518,343.00	41.43

102	000025	特力A	4,516,981.40	41.42
103	605167	利柏特	4,514,359.00	41.39
104	002749	国光股份	4,502,977.00	41.29
105	002753	永东股份	4,502,214.00	41.28
106	605222	起帆电缆	4,491,487.08	41.18
107	301008	宏昌科技	4,490,682.00	41.17
108	688226	威腾电气	4,490,509.30	41.17
109	002007	华兰生物	4,487,545.77	41.15
110	301149	隆华新材	4,483,903.00	41.11
111	600425	青松建化	4,483,783.00	41.11
112	001207	联科科技	4,479,077.00	41.07
113	600655	豫园股份	4,463,493.00	40.93
114	002563	森马服饰	4,456,428.00	40.86
115	600346	恒力石化	4,449,152.44	40.79
116	300905	宝丽迪	4,445,320.00	40.76
117	300501	海顺新材	4,431,961.50	40.64
118	688219	会通股份	4,430,971.26	40.63
119	601333	广深铁路	4,423,494.00	40.56
120	000554	泰山石油	4,416,245.00	40.49
121	600023	浙能电力	4,411,943.00	40.45
122	000061	农产品	4,402,640.00	40.37
123	688510	航亚科技	4,397,779.93	40.32
124	600578	京能电力	4,392,324.00	40.27
125	000797	中国武夷	4,386,497.00	40.22
126	300253	卫宁健康	4,374,768.00	40.11
127	300829	金丹科技	4,373,837.00	40.10
128	300839	博汇股份	4,369,333.76	40.06
129	002878	元隆雅图	4,364,966.00	40.02
130	000883	湖北能源	4,355,888.00	39.94
131	600138	中青旅	4,354,975.00	39.93

132	301046	能辉科技	4,354,073.00	39.92
133	603112	华翔股份	4,349,145.00	39.88
134	600621	华鑫股份	4,345,794.78	39.85
135	002098	浔兴股份	4,338,898.00	39.78
136	002823	凯中精密	4,334,299.00	39.74
137	601601	中国太保	4,327,887.00	39.68
138	300851	交大思诺	4,319,556.00	39.61
139	002393	力生制药	4,311,532.00	39.53
140	300860	锋尚文化	4,294,592.00	39.38
141	000905	厦门港务	4,286,169.00	39.30
142	605162	新中港	4,285,208.00	39.29
143	000838	财信发展	4,283,679.00	39.28
144	600749	西藏旅游	4,281,899.00	39.26
145	002820	桂发祥	4,281,818.40	39.26
146	001213	中铁特货	4,281,139.00	39.25
147	000973	佛塑科技	4,275,702.00	39.20
148	002083	孚日股份	4,274,729.00	39.19
149	688616	西力科技	4,274,618.62	39.19
150	688626	翔宇医疗	4,274,212.25	39.19
151	600292	远达环保	4,272,117.00	39.17
152	002282	博深股份	4,271,683.00	39.17
153	600644	乐山电力	4,260,756.00	39.07
154	603041	美思德	4,256,942.00	39.03
155	000888	峨眉山 A	4,252,543.00	38.99
156	300902	国安达	4,250,611.00	38.97
157	600116	三峡水利	4,244,973.00	38.92
158	600735	新华锦	4,244,817.00	38.92
159	000690	宝新能源	4,235,463.00	38.83
160	600488	津药药业	4,230,976.00	38.79
161	605169	洪通燃气	4,224,851.40	38.74

162	603680	今创集团	4,222,656.00	38.72
163	603058	永吉股份	4,222,324.00	38.71
164	300695	兆丰股份	4,219,753.00	38.69
165	002296	辉煌科技	4,218,003.00	38.67
166	600535	天士力	4,213,076.84	38.63
167	300387	富邦股份	4,209,094.00	38.59
168	300819	聚杰微纤	4,206,558.00	38.57
169	000630	铜陵有色	4,206,457.00	38.57
170	601500	通用股份	4,204,190.00	38.55
171	002035	华帝股份	4,192,859.00	38.44
172	000897	津滨发展	4,187,536.00	38.40
173	300068	南都电源	4,184,611.01	38.37
174	002686	亿利达	4,179,958.00	38.33
175	600979	广安爱众	4,176,461.60	38.29
176	300232	洲明科技	4,172,077.00	38.25
177	603315	福鞍股份	4,165,136.00	38.19
178	300441	鲍斯股份	4,164,604.48	38.19
179	300145	中金环境	4,163,137.00	38.17
180	300321	同大股份	4,158,401.00	38.13
181	600493	凤竹纺织	4,154,688.00	38.09
182	002783	凯龙股份	4,150,741.00	38.06
183	000421	南京公用	4,144,863.00	38.00
184	000997	新大陆	4,140,588.03	37.96
185	603111	康尼机电	4,134,888.00	37.91
186	600789	鲁抗医药	4,134,531.00	37.91
187	002627	三峡旅游	4,114,285.00	37.72
188	002171	楚江新材	4,111,718.00	37.70
189	000729	燕京啤酒	4,099,169.00	37.59
190	688080	映翰通	4,098,397.79	37.58
191	301033	迈普医学	4,060,426.00	37.23

192	600201	生物股份	4,031,966.00	36.97
193	600262	北方股份	4,028,567.00	36.94
194	300350	华鹏飞	4,021,374.00	36.87
195	600098	广州发展	4,011,089.00	36.78
196	688028	沃尔德	3,997,027.88	36.65
197	600648	外高桥	3,996,314.00	36.64
198	603365	水星家纺	3,995,288.00	36.63
199	603167	渤海轮渡	3,968,916.00	36.39
200	002352	顺丰控股	3,958,247.00	36.29
201	300625	三雄极光	3,948,858.00	36.21
202	000570	苏常柴A	3,933,533.00	36.07
203	600917	重庆燃气	3,913,525.00	35.88
204	603579	荣泰健康	3,906,762.00	35.82
205	603199	九华旅游	3,905,308.30	35.81
206	002506	协鑫集成	3,899,118.00	35.75
207	300664	鹏鹞环保	3,853,066.00	35.33
208	001202	炬申股份	3,818,103.00	35.01
209	600854	春兰股份	3,810,937.99	34.94
210	688772	珠海冠宇	3,804,688.72	34.89
211	600250	南京商旅	3,731,688.00	34.22
212	300272	开能健康	3,718,256.00	34.09
213	300419	浩丰科技	3,660,032.00	33.56
214	688321	微芯生物	3,659,731.96	33.56
215	603992	松霖科技	3,658,408.36	33.54
216	002752	昇兴股份	3,646,927.00	33.44
217	603960	克来机电	3,589,288.00	32.91
218	002669	康达新材	3,533,981.00	32.40
219	688636	智明达	3,523,705.29	32.31
220	688002	睿创微纳	3,517,930.78	32.26
221	002616	长青集团	3,495,973.00	32.05

222	003010	若羽臣	3,489,412.00	31.99
223	600758	辽宁能源	3,466,758.00	31.79
224	002526	山东矿机	3,461,219.00	31.74
225	600423	柳化股份	3,441,885.00	31.56
226	688386	泛亚微透	3,438,158.01	31.52
227	600858	银座股份	3,422,923.00	31.38
228	603848	好太太	3,417,268.00	31.33
229	002120	韵达股份	3,409,420.00	31.26
230	002746	仙坛股份	3,386,881.00	31.05
231	300973	立高食品	3,380,635.18	31.00
232	603313	梦百合	3,370,206.80	30.90
233	600487	亨通光电	3,363,342.00	30.84
234	601599	浙文影业	3,338,306.00	30.61
235	603089	正裕工业	3,317,290.00	30.42
236	603950	长源东谷	3,306,819.00	30.32
237	688521	芯原股份	3,305,480.36	30.31
238	300066	三川智慧	3,300,128.00	30.26
239	300193	佳士科技	3,285,916.00	30.13
240	002357	富临运业	3,285,517.00	30.12
241	301039	中集车辆	3,282,760.20	30.10
242	600053	九鼎投资	3,282,012.00	30.09
243	000856	冀东装备	3,274,500.00	30.02
244	600429	三元股份	3,273,076.00	30.01
245	603610	麒盛科技	3,265,934.00	29.95
246	601008	连云港	3,252,566.00	29.82
247	600825	新华传媒	3,250,081.00	29.80
248	688106	金宏气体	3,244,470.10	29.75
249	002701	奥瑞金	3,244,391.00	29.75
250	300554	三超新材	3,239,630.00	29.70
251	600208	新湖中宝	3,237,837.00	29.69

252	002044	美年健康	3,232,458.00	29.64
253	000417	合肥百货	3,223,911.00	29.56
254	002981	朝阳科技	3,222,911.00	29.55
255	300523	辰安科技	3,197,926.00	29.32
256	603903	中持股份	3,193,209.00	29.28
257	603587	地素时尚	3,182,437.00	29.18
258	002448	中原内配	3,173,635.00	29.10
259	300943	春晖智控	3,170,139.00	29.07
260	300296	利亚德	3,169,951.00	29.07
261	002243	力合科创	3,165,888.00	29.03
262	605196	华通线缆	3,165,480.00	29.02
263	600249	两面针	3,152,978.00	28.91
264	688718	唯赛勃	3,150,373.21	28.89
265	003028	振邦智能	3,149,865.00	28.88
266	603530	神马电力	3,149,765.00	28.88
267	600284	浦东建设	3,140,002.00	28.79
268	600435	北方导航	3,135,973.50	28.75
269	002287	奇正藏药	3,134,532.00	28.74
270	002161	远望谷	3,129,200.71	28.69
271	603969	银龙股份	3,126,404.25	28.67
272	605488	福莱新材	3,123,880.80	28.64
273	300194	福安药业	3,121,940.00	28.62
274	000593	德龙汇能	3,121,609.00	28.62
275	605580	恒盛能源	3,115,604.00	28.57
276	688557	兰剑智能	3,114,993.34	28.56
277	002792	通宇通讯	3,109,079.00	28.51
278	300694	蠡湖股份	3,104,093.00	28.46
279	002299	圣农发展	3,101,367.99	28.44
280	600168	武汉控股	3,100,922.00	28.43
281	300774	倍杰特	3,092,369.00	28.35

282	300945	曼卡龙	3,082,328.00	28.26
283	603567	珍宝岛	3,081,991.00	28.26
284	688029	南微医学	3,079,117.76	28.23
285	600271	航天信息	3,074,211.00	28.19
286	300485	赛升药业	3,069,610.00	28.15
287	600744	华银电力	3,046,502.00	27.93
288	002662	京威股份	3,039,377.00	27.87
289	688505	复旦张江	3,037,895.19	27.85
290	688311	盟升电子	3,031,879.36	27.80
291	002510	天汽模	3,019,598.00	27.69
292	605599	莱百股份	3,016,925.00	27.66
293	600638	新黄浦	3,009,311.66	27.59
294	300667	必创科技	3,001,058.00	27.52
295	603590	康辰药业	2,988,301.00	27.40
296	300240	飞力达	2,984,700.00	27.37
297	300869	康泰医学	2,972,871.58	27.26
298	002767	先锋电子	2,969,549.00	27.23
299	300601	康泰生物	2,964,111.00	27.18
300	605286	同力日升	2,961,109.00	27.15
301	600516	方大炭素	2,955,368.00	27.10
302	300950	德固特	2,954,849.00	27.09
303	688580	伟思医疗	2,924,021.90	26.81
304	603168	莎普爱思	2,917,903.00	26.75
305	600351	亚宝药业	2,914,062.00	26.72
306	300711	广哈通信	2,886,486.60	26.47
307	300783	三只松鼠	2,861,807.00	26.24
308	300283	温州宏丰	2,860,838.00	26.23
309	600372	中航机载	2,849,607.80	26.13
310	300743	天地数码	2,838,352.00	26.02
311	300731	科创新源	2,834,749.00	25.99

312	600717	天津港	2,830,593.34	25.95
313	605319	无锡振华	2,825,105.00	25.90
314	603156	养元饮品	2,818,253.00	25.84
315	688566	吉贝尔	2,809,354.24	25.76
316	603630	拉芳家化	2,806,963.00	25.74
317	688377	迪威尔	2,805,327.69	25.72
318	688366	昊海生科	2,785,641.03	25.54
319	000605	渤海股份	2,783,183.60	25.52
320	600883	博闻科技	2,756,632.00	25.28
321	688007	光峰科技	2,740,871.37	25.13
322	002483	润邦股份	2,740,404.00	25.13
323	688016	心脉医疗	2,738,937.80	25.11
324	600984	建设机械	2,725,722.00	24.99
325	300690	双一科技	2,716,070.00	24.90
326	000783	长江证券	2,641,054.00	24.22
327	300970	华绿生物	2,624,543.00	24.06
328	603161	科华控股	2,611,235.00	23.94
329	600658	电子城	2,598,072.00	23.82
330	600830	香溢融通	2,595,625.00	23.80
331	002500	山西证券	2,589,909.70	23.75
332	002133	广宇集团	2,564,476.00	23.51
333	603697	有友食品	2,524,078.40	23.14
334	688186	广大特材	2,497,184.55	22.90
335	601686	友发集团	2,401,083.00	22.02
336	601086	国芳集团	2,392,721.00	21.94
337	300304	云意电气	2,387,648.00	21.89
338	300908	仲景食品	2,358,269.29	21.62
339	000651	格力电器	2,257,900.52	20.70
340	002131	利欧股份	2,056,452.00	18.86
341	000623	吉林敖东	2,038,581.70	18.69

342	601336	新华保险	1,937,650.00	17.77
343	600728	佳都科技	1,888,187.00	17.31
344	000517	荣安地产	1,872,937.00	17.17
345	603323	苏农银行	1,623,986.00	14.89
346	002424	贵州百灵	1,608,717.17	14.75
347	600276	恒瑞医药	1,607,332.70	14.74
348	600639	浦东金桥	1,600,527.00	14.68
349	600726	华电能源	1,597,370.00	14.65
350	002423	中粮资本	1,589,612.00	14.58
351	600570	恒生电子	1,579,938.00	14.49
352	603288	海天味业	1,576,894.00	14.46
353	600309	万华化学	1,566,971.00	14.37
354	600583	海油工程	1,559,694.00	14.30
355	600120	浙江东方	1,559,037.00	14.29
356	000333	美的集团	1,554,589.00	14.25
357	605188	国光连锁	1,553,064.00	14.24
358	000002	万科A	1,551,792.96	14.23
359	601888	中国中免	1,549,471.00	14.21
360	002029	七匹狼	1,541,761.00	14.14
361	600048	保利发展	1,534,897.00	14.07
362	603003	龙宇股份	1,533,499.00	14.06
363	600020	中原高速	1,533,297.00	14.06
364	002314	南山控股	1,532,056.00	14.05
365	000735	罗牛山	1,527,109.81	14.00
366	300750	宁德时代	1,518,592.00	13.92
367	688336	三生国健	1,515,877.56	13.90
368	300760	迈瑞医疗	1,512,503.00	13.87
369	002439	启明星辰	1,497,978.00	13.73
370	601107	四川成渝	1,494,801.00	13.71
371	600637	东方明珠	1,474,495.00	13.52

372	002673	西部证券	1,469,220.06	13.47
373	601975	招商南油	1,468,074.00	13.46
374	600109	国金证券	1,463,343.00	13.42
375	002038	双鹭药业	1,450,550.00	13.30
376	605066	天正电气	1,445,580.00	13.25
377	603331	百达精工	1,431,427.00	13.12
378	000728	国元证券	1,426,345.00	13.08
379	601555	东吴证券	1,419,018.00	13.01
380	603833	欧派家居	1,409,663.00	12.93
381	605100	华丰股份	1,406,726.00	12.90
382	600397	安源煤业	1,405,950.00	12.89
383	603586	金麒麟	1,392,357.00	12.77
384	603696	安记食品	1,385,624.00	12.70
385	603861	白云电器	1,365,182.00	12.52
386	603929	亚翔集成	1,302,637.00	11.94
387	600699	均胜电子	1,300,935.00	11.93
388	600066	宇通客车	1,293,377.00	11.86
389	300514	友讯达	1,269,824.00	11.64
390	002489	浙江永强	1,244,520.00	11.41
391	600828	茂业商业	1,235,986.38	11.33
392	603551	奥普家居	1,217,877.00	11.17
393	002027	分众传媒	1,164,760.00	10.68
394	300146	汤臣倍健	1,150,142.00	10.55
395	600900	长江电力	1,137,780.00	10.43
396	002772	众兴菌业	1,131,643.00	10.38
397	000568	泸州老窖	1,123,104.00	10.30
398	002142	宁波银行	1,089,376.00	9.99
399	300467	迅游科技	1,079,205.00	9.90
400	603699	纽威股份	1,053,587.00	9.66
401	000550	江铃汽车	1,011,582.00	9.28

402	600036	招商银行	1,009,145.00	9.25
403	603711	香飘飘	1,001,514.00	9.18
404	688561	奇安信	977,062.00	8.96
405	600050	中国联通	942,243.00	8.64
406	601668	中国建筑	936,714.00	8.59
407	601012	隆基绿能	935,575.00	8.58
408	600905	三峡能源	934,931.00	8.57
409	601318	中国平安	934,186.00	8.57
410	600030	中信证券	932,813.00	8.55
411	601398	工商银行	929,245.00	8.52
412	601857	中国石油	927,905.00	8.51
413	600028	中国石化	926,856.00	8.50
414	601138	工业富联	925,342.00	8.48
415	601166	兴业银行	924,376.00	8.48
416	600406	国电南瑞	923,350.92	8.47
417	600000	浦发银行	919,219.00	8.43
418	601899	紫金矿业	917,895.00	8.42
419	300274	阳光电源	916,718.00	8.41
420	300059	东方财富	915,059.28	8.39
421	688111	金山办公	914,956.00	8.39
422	603259	药明康德	914,655.00	8.39
423	002714	牧原股份	914,267.00	8.38
424	000001	平安银行	913,738.00	8.38
425	000725	京东方A	912,909.00	8.37
426	300015	爱尔眼科	912,827.30	8.37
427	601288	农业银行	912,137.00	8.36
428	000858	五粮液	911,734.00	8.36
429	002475	立讯精密	911,712.00	8.36
430	600436	片仔癀	909,383.00	8.34
431	002304	洋河股份	908,994.00	8.33

432	600809	山西汾酒	908,502.80	8.33
433	002594	比亚迪	899,583.00	8.25
434	601088	中国神华	898,660.00	8.24
435	601225	陕西煤业	892,031.00	8.18
436	600785	新华百货	843,339.00	7.73
437	600519	贵州茅台	835,896.00	7.66
438	300434	金石亚药	818,552.00	7.51
439	300830	金现代	756,823.00	6.94
440	300532	今天国际	753,904.00	6.91
441	003007	直真科技	749,048.00	6.87
442	300910	瑞丰新材	732,416.00	6.72
443	000786	北新建材	725,455.00	6.65
444	000567	海德股份	724,889.00	6.65
445	600211	西藏药业	723,785.00	6.64
446	600325	华发股份	720,357.00	6.60
447	603878	武进不锈	719,540.14	6.60
448	603868	飞科电器	717,812.00	6.58
449	600329	达仁堂	717,493.00	6.58
450	605088	冠盛股份	716,768.00	6.57
451	300815	玉禾田	715,684.00	6.56
452	300415	伊之密	714,658.00	6.55
453	000544	中原环保	713,837.00	6.55
454	300894	火星人	713,732.00	6.54
455	002318	久立特材	713,714.00	6.54
456	600027	华电国际	713,485.00	6.54
457	300009	安科生物	713,312.00	6.54
458	603515	欧普照明	713,303.00	6.54
459	605028	世茂能源	712,420.00	6.53
460	601958	金钼股份	711,860.00	6.53
461	600982	宁波能源	711,327.00	6.52

462	002033	丽江股份	711,139.00	6.52
463	603689	皖天然气	711,058.00	6.52
464	300384	三联虹普	710,910.00	6.52
465	601838	成都银行	710,536.00	6.51
466	002572	索菲亚	710,517.00	6.51
467	600132	重庆啤酒	710,481.00	6.51
468	002478	常宝股份	710,468.00	6.51
469	002555	三七互娱	710,008.00	6.51
470	600926	杭州银行	709,801.00	6.51
471	603303	得邦照明	709,799.00	6.51
472	601139	深圳燃气	709,409.20	6.50
473	601636	旗滨集团	709,164.00	6.50
474	600612	老凤祥	709,093.00	6.50
475	300450	先导智能	708,959.00	6.50
476	600025	华能水电	708,595.00	6.50
477	603355	莱克电气	708,293.00	6.49
478	603233	大参林	707,836.60	6.49
479	603866	桃李面包	707,271.00	6.48
480	605377	华旺科技	706,910.00	6.48
481	603768	常青股份	706,625.00	6.48
482	603757	大元泵业	706,545.00	6.48
483	603393	新天然气	706,513.00	6.48
484	603855	华荣股份	706,042.00	6.47
485	002467	二六三	706,022.00	6.47
486	600753	庚星股份	705,922.00	6.47
487	603886	元祖股份	704,982.00	6.46
488	601882	海天精工	704,639.00	6.46
489	002833	弘亚数控	704,125.00	6.46
490	300718	长盛轴承	703,276.50	6.45
491	002039	黔源电力	701,950.00	6.44

492	000589	贵州轮胎	701,817.00	6.43
493	601128	常熟银行	701,807.00	6.43
494	000850	华茂股份	701,756.00	6.43
495	603088	宁波精达	701,683.00	6.43
496	002091	江苏国泰	701,403.00	6.43
497	605336	帅丰电器	700,568.90	6.42
498	300109	新开源	699,857.00	6.42
499	000598	兴蓉环境	699,028.00	6.41
500	600710	苏美达	698,751.00	6.41
501	600968	海油发展	697,914.00	6.40
502	603195	公牛集团	697,686.00	6.40
503	600481	双良节能	697,668.00	6.40
504	002270	华明装备	697,129.00	6.39
505	603611	诺力股份	697,056.00	6.39
506	002803	吉宏股份	696,981.00	6.39
507	000338	潍柴动力	696,073.00	6.38
508	003000	劲仔食品	695,861.00	6.38
509	603688	石英股份	695,629.00	6.38
510	000014	沙河股份	694,763.00	6.37
511	301004	嘉益股份	694,698.00	6.37
512	000921	海信家电	691,909.00	6.34
513	000404	长虹华意	690,702.00	6.33
514	002158	汉钟精机	689,886.00	6.33
515	002014	永新股份	687,787.00	6.31
516	603444	吉比特	686,245.00	6.29
517	300789	唐源电气	684,857.00	6.28
518	600153	建发股份	680,976.00	6.24
519	002615	哈尔斯	678,548.00	6.22
520	600761	安徽合力	675,944.00	6.20
521	600114	东睦股份	674,259.00	6.18

522	601567	三星医疗	670,873.00	6.15
523	000895	双汇发展	661,983.00	6.07
524	002082	万邦德	660,270.00	6.05
525	688678	福立旺	659,895.28	6.05
526	600833	第一医药	656,074.00	6.02
527	600665	天地源	653,254.00	5.99
528	301015	百洋医药	650,405.00	5.96
529	300407	凯发电气	647,623.00	5.94
530	300100	双林股份	645,116.00	5.92
531	600525	长园集团	644,594.00	5.91
532	000680	山推股份	644,340.00	5.91
533	603718	海利生物	643,476.00	5.90
534	603059	倍加洁	643,006.00	5.90
535	002632	道明光学	640,822.00	5.88
536	300462	华铭智能	640,605.00	5.87
537	300335	迪森股份	633,112.00	5.80
538	600790	轻纺城	630,977.97	5.79
539	688466	金科环境	630,451.94	5.78
540	600664	哈药股份	626,846.00	5.75
541	600649	城投控股	626,693.00	5.75
542	300900	广联航空	626,584.00	5.75
543	600279	重庆港	624,357.00	5.72
544	300024	机器人	623,431.00	5.72
545	605177	东亚药业	623,343.00	5.72
546	300863	卡倍亿	618,560.00	5.67
547	000566	海南海药	617,903.00	5.67
548	300425	中建环能	617,033.00	5.66
549	300110	华仁药业	615,304.00	5.64
550	600676	交运股份	614,507.00	5.63
551	300838	浙江力诺	614,310.00	5.63

552	600198	大唐电信	607,730.00	5.57
553	300270	中威电子	605,010.00	5.55
554	002061	浙江交科	602,258.00	5.52
555	688057	金达莱	600,092.90	5.50
556	300498	温氏股份	596,263.00	5.47
557	300399	天利科技	590,563.00	5.41
558	002093	国脉科技	585,838.00	5.37
559	002611	东方精工	584,690.00	5.36
560	688218	江苏北人	584,487.00	5.36
561	000036	华联控股	579,760.00	5.32
562	688350	富淼科技	576,267.24	5.28
563	002212	天融信	575,010.00	5.27
564	600822	上海物贸	569,662.00	5.22
565	300882	万胜智能	569,013.00	5.22
566	002111	威海广泰	567,971.00	5.21
567	600827	百联股份	567,799.00	5.21
568	600105	永鼎股份	566,143.00	5.19
569	600539	狮头股份	562,281.00	5.16
570	600683	京投发展	561,586.00	5.15
571	002085	万丰奥威	556,975.00	5.11
572	300080	易成新能	555,998.00	5.10
573	300765	新诺威	555,629.00	5.09
574	300265	通光线缆	553,734.00	5.08
575	600352	浙江龙盛	551,862.00	5.06
576	300602	飞荣达	551,423.00	5.06
577	000681	视觉中国	551,075.00	5.05
578	002892	科力尔	549,859.00	5.04
579	603066	音飞储存	549,279.00	5.04
580	601766	中国中车	542,226.00	4.97
581	603909	建发合诚	539,768.00	4.95

582	002546	新联电子	538,707.00	4.94
583	600345	长江通信	537,541.00	4.93
584	000758	中色股份	536,271.00	4.92
585	600137	浪莎股份	533,812.00	4.89
586	002012	凯恩股份	531,909.00	4.88
587	300154	瑞凌股份	531,720.00	4.88
588	002031	巨轮智能	527,709.00	4.84
589	000006	深振业 A	527,379.00	4.84
590	300311	任子行	524,338.00	4.81
591	300230	永利股份	523,735.00	4.80
592	601177	杭齿前进	523,422.00	4.80
593	002628	成都路桥	521,076.00	4.78
594	002322	理工能科	518,912.00	4.76
595	603036	如通股份	518,509.00	4.75
596	603311	金海高科	518,028.00	4.75
597	002910	庄园牧场	511,950.00	4.69
598	300651	金陵体育	509,599.00	4.67
599	300188	国投智能	509,480.00	4.67
600	600815	厦工股份	501,600.00	4.60
601	000886	海南高速	500,212.00	4.59
602	600008	首创环保	481,290.00	4.41
603	300545	联得装备	445,424.00	4.08
604	002056	横店东磁	444,392.00	4.07
605	688379	华光新材	442,185.90	4.05
606	600251	冠农股份	434,089.00	3.98
607	300684	中石科技	403,476.00	3.70
608	300926	博俊科技	378,043.00	3.47
609	600660	福耀玻璃	314,925.00	2.89
610	600548	深高速	289,620.00	2.66
611	300192	科德教育	273,966.00	2.51

612	300516	久之洋	267,888.00	2.46
613	301526	国际复材	258,618.50	2.37
614	603421	鼎信通讯	258,613.00	2.37
615	603336	宏辉果蔬	255,307.00	2.34
616	000726	鲁泰A	250,917.00	2.30
617	600228	返利科技	249,123.00	2.28
618	300359	全通教育	245,147.00	2.25
619	600756	浪潮软件	245,019.00	2.25

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688169	石头科技	8,595,407.81	78.81
2	300978	东箭科技	8,331,003.00	76.39
3	002521	齐峰新材	7,940,842.00	72.81
4	300881	盛德鑫泰	7,809,725.36	71.61
5	002103	广博股份	7,541,594.00	69.15
6	002687	乔治白	7,257,735.05	66.55
7	000011	深物业A	7,119,722.05	65.28
8	300017	网宿科技	6,897,021.00	63.24
9	300607	拓斯达	6,144,281.01	56.34
10	300414	中光防雷	6,072,049.00	55.67
11	000411	英特集团	6,000,663.13	55.02
12	300583	赛托生物	5,949,612.40	54.55
13	000058	深赛格	5,929,170.00	54.36
14	603578	三星新材	5,854,272.72	53.68
15	000055	方大集团	5,819,164.00	53.36

16	000421	南京公用	5,664,223.00	51.94
17	603121	华培动力	5,625,843.96	51.58
18	002878	元隆雅图	5,616,797.23	51.50
19	600826	兰生股份	5,464,052.00	50.10
20	600535	天士力	5,066,726.13	46.46
21	002981	朝阳科技	5,062,413.00	46.42
22	688626	翔宇医疗	5,024,800.63	46.07
23	600621	华鑫股份	4,962,834.56	45.50
24	002990	盛视科技	4,901,748.56	44.94
25	300554	三超新材	4,814,870.00	44.15
26	688191	智洋创新	4,810,534.29	44.11
27	003011	海象新材	4,769,228.00	43.73
28	600903	贵州燃气	4,649,952.28	42.64
29	000997	新大陆	4,648,123.21	42.62
30	300898	熊猫乳品	4,640,860.00	42.55
31	300164	通源石油	4,623,450.00	42.39
32	600635	大众公用	4,574,499.00	41.94
33	603168	莎普爱思	4,449,368.60	40.80
34	000630	铜陵有色	4,431,085.00	40.63
35	002558	巨人网络	4,396,859.00	40.31
36	600288	大恒科技	4,346,863.00	39.86
37	300272	开能健康	4,320,250.00	39.61
38	600655	豫园股份	4,244,941.00	38.92
39	002098	浔兴股份	4,224,923.96	38.74
40	001202	炬申股份	4,098,332.00	37.58
41	000897	津滨发展	4,029,421.00	36.95
42	300001	特锐德	3,962,798.53	36.33
43	300232	洲明科技	3,958,119.25	36.29
44	603365	水星家纺	3,922,049.00	35.96
45	000027	深圳能源	3,897,702.00	35.74

46	300839	博汇股份	3,886,345.60	35.63
47	600854	春兰股份	3,865,076.00	35.44
48	300808	久量股份	3,862,479.00	35.41
49	002752	昇兴股份	3,848,353.00	35.29
50	600423	柳化股份	3,827,672.00	35.10
51	600098	广州发展	3,818,861.00	35.01
52	600917	重庆燃气	3,803,856.42	34.88
53	688321	微芯生物	3,790,459.00	34.75
54	002782	可立克	3,772,738.00	34.59
55	603089	正裕工业	3,748,860.30	34.37
56	603579	荣泰健康	3,742,832.47	34.32
57	600250	南京商旅	3,734,673.00	34.24
58	300664	鹏鹞环保	3,711,353.00	34.03
59	000570	苏常柴A	3,703,526.00	33.96
60	603199	九华旅游	3,694,888.00	33.88
61	600648	外高桥	3,663,392.00	33.59
62	300419	浩丰科技	3,651,617.00	33.48
63	002991	甘源食品	3,647,261.00	33.44
64	002506	协鑫集成	3,643,192.00	33.40
65	603969	银龙股份	3,629,013.00	33.27
66	002767	先锋电子	3,625,366.00	33.24
67	603950	长源东谷	3,539,217.80	32.45
68	603590	康辰药业	3,531,005.00	32.38
69	300111	向日葵	3,524,008.00	32.31
70	688366	昊海生科	3,492,839.96	32.03
71	002510	天汽模	3,485,990.00	31.96
72	688029	南微医学	3,443,135.90	31.57
73	300066	三川智慧	3,425,931.00	31.41
74	002669	康达新材	3,403,432.00	31.21
75	002616	长青集团	3,400,816.00	31.18

76	601601	中国太保	3,389,735.00	31.08
77	688386	泛亚微透	3,358,360.02	30.79
78	688106	金宏气体	3,357,851.62	30.79
79	600758	辽宁能源	3,355,086.00	30.76
80	603530	神马电力	3,354,775.00	30.76
81	000593	德龙汇能	3,350,125.00	30.72
82	603848	好太太	3,339,039.00	30.62
83	300601	康泰生物	3,327,400.00	30.51
84	000856	冀东装备	3,327,382.00	30.51
85	002357	富临运业	3,325,812.00	30.49
86	300731	科创新源	3,308,717.00	30.34
87	688505	复旦张江	3,307,466.41	30.33
88	600351	亚宝药业	3,276,818.00	30.04
89	003010	若羽臣	3,273,322.00	30.01
90	300240	飞力达	3,258,435.00	29.88
91	300711	广哈通信	3,250,977.00	29.81
92	002526	山东矿机	3,245,825.00	29.76
93	300690	双一科技	3,237,770.00	29.69
94	300283	温州宏丰	3,204,376.00	29.38
95	002120	韵达股份	3,200,307.00	29.34
96	002161	远望谷	3,176,955.00	29.13
97	600284	浦东建设	3,163,711.00	29.01
98	688557	兰剑智能	3,154,147.48	28.92
99	002448	中原内配	3,148,196.00	28.87
100	003028	振邦智能	3,145,913.00	28.84
101	605158	华达新材	3,138,759.00	28.78
102	600429	三元股份	3,138,054.00	28.77
103	603903	中持股份	3,124,773.48	28.65
104	002701	奥瑞金	3,120,479.00	28.61
105	688311	盟升电子	3,109,220.79	28.51

106	603610	麒盛科技	3,106,622.00	28.48
107	300872	天阳科技	3,104,522.42	28.47
108	300694	蠡湖股份	3,097,280.00	28.40
109	688718	唯赛勃	3,094,225.73	28.37
110	688007	光峰科技	3,090,279.99	28.33
111	002662	京威股份	3,088,957.00	28.32
112	601008	连云港	3,081,252.00	28.25
113	002352	顺丰控股	3,066,200.00	28.11
114	600858	银座股份	3,058,106.00	28.04
115	002746	仙坛股份	3,055,471.00	28.02
116	688377	迪威尔	3,052,714.24	27.99
117	600208	新湖中宝	3,049,369.00	27.96
118	002287	奇正藏药	3,043,407.80	27.90
119	601599	浙文影业	3,038,459.00	27.86
120	600487	亨通光电	3,037,111.00	27.85
121	300743	天地数码	3,036,886.00	27.85
122	688016	心脉医疗	3,033,771.09	27.82
123	300193	佳士科技	3,032,303.00	27.80
124	600825	新华传媒	3,032,132.00	27.80
125	300945	曼卡龙	3,031,053.00	27.79
126	600168	武汉控股	3,028,285.00	27.77
127	601086	国芳集团	3,026,459.00	27.75
128	300523	辰安科技	3,006,074.00	27.56
129	300296	利亚德	2,997,908.00	27.49
130	603587	地素时尚	2,996,219.00	27.47
131	605599	菜百股份	2,979,655.00	27.32
132	300943	春晖智控	2,976,883.00	27.29
133	688521	芯原股份	2,971,885.93	27.25
134	688566	吉贝尔	2,966,478.15	27.20
135	603960	克来机电	2,964,066.00	27.18

136	688002	睿创微纳	2,960,683.16	27.15
137	605286	同力日升	2,959,681.00	27.14
138	605488	福莱新材	2,955,179.00	27.10
139	603630	拉芳家化	2,954,581.00	27.09
140	603313	梦百合	2,936,749.00	26.93
141	002299	圣农发展	2,932,130.00	26.88
142	002243	力合科创	2,915,489.00	26.73
143	301039	中集车辆	2,906,092.00	26.65
144	300774	倍杰特	2,901,643.00	26.61
145	000417	合肥百货	2,901,244.00	26.60
146	600435	北方导航	2,899,327.38	26.58
147	000605	渤海股份	2,893,859.00	26.53
148	603161	科华控股	2,891,244.00	26.51
149	600271	航天信息	2,883,517.00	26.44
150	002792	通宇通讯	2,882,220.86	26.43
151	600744	华银电力	2,858,610.00	26.21
152	300950	德固特	2,854,657.00	26.17
153	300973	立高食品	2,854,207.00	26.17
154	300485	赛升药业	2,853,066.00	26.16
155	600053	九鼎投资	2,848,046.00	26.11
156	002500	山西证券	2,845,528.00	26.09
157	002483	润邦股份	2,827,142.00	25.92
158	603156	养元饮品	2,818,092.00	25.84
159	600516	方大炭素	2,810,189.00	25.77
160	600883	博闻科技	2,800,396.00	25.68
161	605196	华通线缆	2,780,464.00	25.49
162	300869	康泰医学	2,767,435.32	25.37
163	600984	建设机械	2,763,603.00	25.34
164	600717	天津港	2,763,227.00	25.34
165	600372	中航机载	2,762,030.00	25.32

166	605319	无锡振华	2,740,648.00	25.13
167	600638	新黄浦	2,720,017.20	24.94
168	000783	长江证券	2,704,105.00	24.79
169	600830	香溢融通	2,682,937.00	24.60
170	002133	广宇集团	2,679,120.00	24.56
171	300292	吴通控股	2,677,048.00	24.55
172	300667	必创科技	2,650,341.00	24.30
173	601686	友发集团	2,646,171.00	24.26
174	688580	伟思医疗	2,633,470.00	24.15
175	002044	美年健康	2,624,833.00	24.07
176	603567	珍宝岛	2,615,963.16	23.99
177	300304	云意电气	2,608,764.00	23.92
178	300783	三只松鼠	2,585,426.00	23.71
179	300999	金龙鱼	2,530,703.00	23.20
180	600658	电子城	2,464,003.00	22.59
181	603697	有友食品	2,416,737.00	22.16
182	300970	华绿生物	2,411,726.00	22.11
183	300908	仲景食品	2,235,699.00	20.50
184	601336	新华保险	2,222,476.00	20.38
185	688186	广大特材	2,205,388.63	20.22
186	002131	利欧股份	2,156,749.00	19.78
187	605188	国光连锁	2,151,920.00	19.73
188	000651	格力电器	2,092,784.00	19.19
189	000623	吉林敖东	2,035,894.00	18.67
190	000517	荣安地产	1,915,660.00	17.56
191	600728	佳都科技	1,719,370.00	15.76
192	300514	友讯达	1,684,033.00	15.44
193	002969	嘉美包装	1,673,829.00	15.35
194	600583	海油工程	1,658,902.00	15.21
195	688336	三生国健	1,646,860.58	15.10

196	000852	石化机械	1,640,358.00	15.04
197	002424	贵州百灵	1,624,102.00	14.89
198	002423	中粮资本	1,610,732.00	14.77
199	600699	均胜电子	1,600,358.00	14.67
200	605288	凯迪股份	1,596,579.00	14.64
201	600054	黄山旅游	1,586,422.00	14.55
202	002029	七匹狼	1,584,705.00	14.53
203	002439	启明星辰	1,579,325.00	14.48
204	601107	四川成渝	1,546,508.00	14.18
205	600120	浙江东方	1,546,410.00	14.18
206	603929	亚翔集成	1,537,009.00	14.09
207	603003	龙宇股份	1,530,254.00	14.03
208	600637	东方明珠	1,529,698.00	14.03
209	600020	中原高速	1,520,589.00	13.94
210	603586	金麒麟	1,518,853.00	13.93
211	603861	白云电器	1,515,411.00	13.89
212	002038	双鹭药业	1,511,494.00	13.86
213	603323	苏农银行	1,503,791.00	13.79
214	002314	南山控股	1,502,431.00	13.78
215	600639	浦东金桥	1,501,722.00	13.77
216	605066	天正电气	1,497,646.00	13.73
217	603331	百达精工	1,490,636.00	13.67
218	000333	美的集团	1,489,339.00	13.66
219	601975	招商南油	1,487,282.00	13.64
220	601555	东吴证券	1,478,024.00	13.55
221	600109	国金证券	1,464,041.00	13.42
222	600726	华电能源	1,463,828.00	13.42
223	002673	西部证券	1,456,235.68	13.35
224	600397	安源煤业	1,456,012.00	13.35
225	000735	罗牛山	1,445,741.00	13.26

226	603696	安记食品	1,445,725.48	13.26
227	000728	国元证券	1,441,308.00	13.22
228	605100	华丰股份	1,419,142.00	13.01
229	002381	双箭股份	1,418,619.00	13.01
230	002489	浙江永强	1,344,078.00	12.32
231	600828	茂业商业	1,343,215.00	12.32
232	603551	奥普家居	1,284,397.00	11.78
233	600642	申能股份	1,260,791.00	11.56
234	600066	宇通客车	1,255,800.00	11.51
235	300467	迅游科技	1,255,389.00	11.51
236	300888	稳健医疗	1,255,028.00	11.51
237	603833	欧派家居	1,218,415.00	11.17
238	002772	众兴菌业	1,210,301.00	11.10
239	600570	恒生电子	1,146,129.00	10.51
240	300146	汤臣倍健	1,130,045.00	10.36
241	603699	纽威股份	1,074,078.00	9.85
242	603711	香飘飘	1,040,120.00	9.54
243	600497	驰宏锌锗	996,421.00	9.14
244	002899	英派斯	991,778.00	9.09
245	600650	锦江在线	985,682.00	9.04
246	000550	江铃汽车	982,591.00	9.01
247	601018	宁波港	976,090.00	8.95
248	002998	优彩资源	963,843.00	8.84
249	301043	绿岛风	949,066.00	8.70
250	300434	金石亚药	939,998.00	8.62
251	688561	奇安信	926,576.80	8.50
252	600675	中华企业	919,941.00	8.43
253	301015	百洋医药	916,881.28	8.41
254	600822	上海物贸	909,694.00	8.34
255	001209	洪兴股份	882,679.88	8.09

256	603058	永吉股份	865,272.00	7.93
257	600105	永鼎股份	845,689.00	7.75
258	002803	吉宏股份	841,791.00	7.72
259	603689	皖天然气	828,543.00	7.60
260	300644	南京聚隆	803,383.00	7.37
261	600025	华能水电	797,821.00	7.32
262	300882	万胜智能	797,612.00	7.31
263	300830	金现代	786,815.00	7.21
264	600612	老凤祥	780,912.00	7.16
265	002572	索菲亚	778,797.00	7.14
266	000014	沙河股份	774,884.00	7.10
267	603768	常青股份	771,947.00	7.08
268	003000	劲仔食品	764,797.00	7.01
269	300718	长盛轴承	762,097.06	6.99
270	300100	双林股份	761,810.00	6.99
271	601567	三星医疗	761,800.91	6.98
272	600737	中粮糖业	754,762.00	6.92
273	600785	新华百货	754,602.00	6.92
274	600027	华电国际	751,148.00	6.89
275	600211	西藏药业	738,511.00	6.77
276	300188	国投智能	737,382.00	6.76
277	300407	凯发电气	736,297.00	6.75
278	603233	大参林	735,876.00	6.75
279	601956	东贝集团	735,573.00	6.74
280	002318	久立特材	734,658.00	6.74
281	000886	海南高速	732,477.00	6.72
282	600517	国网英大	732,110.00	6.71
283	002032	苏泊尔	731,344.00	6.71
284	601139	深圳燃气	725,534.00	6.65
285	600132	重庆啤酒	721,503.00	6.62

286	603059	倍加洁	717,414.00	6.58
287	000598	兴蓉环境	716,847.00	6.57
288	002171	楚江新材	714,833.00	6.55
289	002270	华明装备	713,007.50	6.54
290	600982	宁波能源	712,355.00	6.53
291	002555	三七互娱	711,469.00	6.52
292	301526	国际复材	711,391.26	6.52
293	603757	大元泵业	710,765.00	6.52
294	605268	王力安防	709,530.00	6.51
295	300415	伊之密	708,845.00	6.50
296	600683	京投发展	708,043.00	6.49
297	003007	直真科技	705,218.00	6.47
298	603225	新凤鸣	704,381.00	6.46
299	300545	联得装备	703,940.00	6.45
300	300109	新开源	701,880.05	6.44
301	603676	卫信康	701,578.00	6.43
302	000404	长虹华意	700,117.00	6.42
303	300384	三联虹普	699,283.00	6.41
304	002091	江苏国泰	697,539.00	6.40
305	600345	长江通信	696,937.00	6.39
306	600329	达仁堂	695,625.00	6.38
307	600153	建发股份	694,134.00	6.36
308	002039	黔源电力	693,759.00	6.36
309	301004	嘉益股份	692,924.00	6.35
310	300894	火星人	690,840.00	6.33
311	605336	帅丰电器	690,256.40	6.33
312	002478	常宝股份	689,824.00	6.32
313	000338	潍柴动力	689,491.00	6.32
314	601882	海天精工	688,903.00	6.32
315	605088	冠盛股份	688,585.00	6.31

316	300009	安科生物	686,890.00	6.30
317	300815	玉禾田	685,106.56	6.28
318	603195	公牛集团	685,050.00	6.28
319	002467	二六三	684,682.00	6.28
320	000850	华茂股份	683,357.00	6.27
321	603393	新天然气	682,949.00	6.26
322	603303	得邦照明	682,811.00	6.26
323	603088	宁波精达	681,884.00	6.25
324	600968	海油发展	681,717.00	6.25
325	300789	唐源电气	681,458.00	6.25
326	300532	今天国际	678,312.00	6.22
327	300910	瑞丰新材	677,224.00	6.21
328	600761	安徽合力	675,256.00	6.19
329	002833	弘亚数控	674,282.00	6.18
330	300450	先导智能	672,331.80	6.16
331	600710	苏美达	672,011.00	6.16
332	000544	中原环保	671,631.00	6.16
333	300765	新诺威	668,546.00	6.13
334	600833	第一医药	668,223.00	6.13
335	603886	元祖股份	667,284.00	6.12
336	601838	成都银行	666,312.00	6.11
337	600623	华谊集团	666,014.00	6.11
338	000895	双汇发展	665,964.00	6.11
339	603868	飞科电器	665,568.00	6.10
340	002061	浙江交科	665,199.00	6.10
341	603315	福鞍股份	665,050.00	6.10
342	603878	武进不锈	664,658.60	6.09
343	603611	诺力股份	664,095.00	6.09
344	603355	莱克电气	663,799.00	6.09
345	600665	天地源	662,754.00	6.08

346	603326	我乐家居	661,998.00	6.07
347	605028	世茂能源	658,439.00	6.04
348	002158	汉钟精机	653,904.00	6.00
349	002033	丽江股份	653,662.00	5.99
350	300270	中威电子	652,460.00	5.98
351	000566	海南海药	650,780.90	5.97
352	603866	桃李面包	647,088.00	5.93
353	601958	金钼股份	646,568.00	5.93
354	300080	易成新能	644,914.00	5.91
355	688466	金科环境	643,086.21	5.90
356	600926	杭州银行	641,208.00	5.88
357	300024	机器人	639,399.00	5.86
358	002546	新联电子	638,908.00	5.86
359	600664	哈药股份	638,052.00	5.85
360	002014	永新股份	637,665.80	5.85
361	000567	海德股份	637,286.30	5.84
362	600525	长园集团	636,758.00	5.84
363	002611	东方精工	635,325.00	5.83
364	000589	贵州轮胎	634,873.00	5.82
365	002615	哈尔斯	634,285.00	5.82
366	605377	华旺科技	634,281.88	5.82
367	000758	中色股份	632,206.00	5.80
368	002093	国脉科技	630,483.00	5.78
369	601128	常熟银行	627,050.00	5.75
370	000680	山推股份	626,373.00	5.74
371	600008	首创环保	623,347.00	5.72
372	300498	温氏股份	621,936.00	5.70
373	600649	城投控股	620,134.00	5.69
374	300399	天利科技	617,421.00	5.66
375	605177	东亚药业	615,867.00	5.65

376	603688	石英股份	615,277.00	5.64
377	300110	华仁药业	614,705.00	5.64
378	603855	华荣股份	612,567.48	5.62
379	600790	轻纺城	611,458.00	5.61
380	600279	重庆港	610,072.00	5.59
381	300335	迪森股份	608,459.00	5.58
382	603718	海利生物	607,234.00	5.57
383	300602	飞荣达	603,203.00	5.53
384	300154	瑞凌股份	602,295.74	5.52
385	000681	视觉中国	599,386.00	5.50
386	603221	爱丽家居	598,223.00	5.49
387	603515	欧普照明	596,925.00	5.47
388	002085	万丰奥威	596,874.00	5.47
389	300425	中建环能	596,100.00	5.47
390	300462	华铭智能	594,188.00	5.45
391	603311	金海高科	593,944.00	5.45
392	000036	华联控股	592,748.00	5.43
393	603444	吉比特	591,996.00	5.43
394	300838	浙江力诺	587,413.00	5.39
395	002082	万邦德	586,241.00	5.38
396	600114	东睦股份	585,605.00	5.37
397	600753	庚星股份	584,165.00	5.36
398	600325	华发股份	582,053.00	5.34
399	601636	旗滨集团	581,463.00	5.33
400	000786	北新建材	579,143.00	5.31
401	603066	音飞储存	577,473.00	5.29
402	300900	广联航空	576,438.00	5.29
403	300311	任子行	572,394.00	5.25
404	002012	凯恩股份	572,214.00	5.25
405	000921	海信家电	571,728.00	5.24

406	600198	大唐电信	570,449.00	5.23
407	002892	科力尔	570,298.00	5.23
408	300651	金陵体育	568,094.00	5.21
409	300230	永利股份	568,087.00	5.21
410	600676	交运股份	567,632.00	5.20
411	600481	双良节能	567,246.00	5.20
412	600827	百联股份	566,951.00	5.20
413	688057	金达莱	565,518.92	5.19
414	002632	道明光学	564,882.00	5.18
415	600137	浪莎股份	549,607.00	5.04
416	601766	中国中车	548,922.00	5.03
417	688218	江苏北人	546,918.65	5.01
418	002212	天融信	546,484.00	5.01
419	300265	通光线缆	546,077.00	5.01
420	002031	巨轮智能	542,885.34	4.98
421	603909	建发合诚	539,606.00	4.95
422	601177	杭齿前进	533,511.00	4.89
423	002628	成都路桥	531,680.00	4.87
424	300863	卡倍亿	530,254.52	4.86
425	000006	深振业 A	524,323.00	4.81
426	688350	富淼科技	521,378.42	4.78
427	002910	庄园牧场	519,653.00	4.76
428	600352	浙江龙盛	514,981.00	4.72
429	688678	福立旺	514,755.48	4.72
430	600539	狮头股份	511,745.00	4.69
431	603036	如通股份	510,136.00	4.68
432	002111	威海广泰	502,149.00	4.60
433	002753	永东股份	493,838.00	4.53
434	600900	长江电力	489,972.00	4.49
435	002322	理工能科	484,303.00	4.44

436	600815	厦工股份	483,360.00	4.43
437	600228	返利科技	480,965.00	4.41
438	000777	中核科技	472,105.00	4.33
439	601163	三角轮胎	455,804.00	4.18
440	688379	华光新材	454,250.00	4.16
441	300684	中石科技	453,356.00	4.16
442	002056	横店东磁	441,720.00	4.05
443	600887	伊利股份	440,491.00	4.04
444	300516	久之洋	434,105.00	3.98
445	600251	冠农股份	432,077.00	3.96
446	603421	鼎信通讯	425,229.00	3.90
447	600548	深高速	399,124.00	3.66
448	300926	博俊科技	392,688.00	3.60
449	002027	分众传媒	382,647.00	3.51
450	300387	富邦股份	381,270.00	3.50
451	603336	宏辉果蔬	373,943.00	3.43
452	000726	鲁泰A	372,278.00	3.41
453	688219	会通股份	371,983.31	3.41
454	002282	博深股份	368,453.00	3.38
455	000568	泸州老窖	358,093.00	3.28
456	003012	东鹏控股	355,819.00	3.26
457	600789	鲁抗医药	355,536.00	3.26
458	002783	凯龙股份	337,125.24	3.09
459	603167	渤海轮渡	334,406.00	3.07
460	300192	科德教育	329,303.00	3.02
461	000061	农产品	326,395.00	2.99
462	605338	巴比食品	322,235.00	2.95
463	600660	福耀玻璃	313,794.00	2.88
464	002984	森麒麟	309,198.00	2.84
465	600201	生物股份	307,149.00	2.82

466	002749	国光股份	305,786.00	2.80
467	603992	松霖科技	298,200.00	2.73
468	603083	剑桥科技	290,618.00	2.66
469	600895	张江高科	289,022.00	2.65
470	600425	青松建化	288,176.00	2.64
471	002957	科瑞技术	285,200.00	2.61
472	605300	佳禾食品	275,320.00	2.52
473	600897	厦门空港	274,530.00	2.52
474	603993	洛阳钼业	264,793.00	2.43
475	600292	远达环保	263,189.80	2.41
476	002820	桂发祥	261,281.00	2.40
477	300359	全通教育	257,034.00	2.36
478	600488	津药药业	255,265.00	2.34
479	601816	京沪高铁	254,072.00	2.33
480	600572	康恩贝	253,746.00	2.33
481	600756	浪潮软件	252,026.00	2.31
482	300756	金马游乐	247,868.00	2.27
483	000797	中国武夷	247,077.00	2.27
484	000554	泰山石油	245,815.00	2.25
485	600735	新华锦	244,507.00	2.24
486	600258	首旅酒店	242,955.00	2.23
487	002627	三峡旅游	240,467.00	2.20
488	301149	隆华新材	234,700.00	2.15
489	300625	三雄极光	233,505.00	2.14
490	600262	北方股份	232,223.00	2.13
491	000883	湖北能源	231,591.00	2.12
492	600979	广安爱众	231,092.00	2.12
493	000423	东阿阿胶	231,046.00	2.12
494	000905	厦门港务	230,350.00	2.11
495	002393	力生制药	226,202.00	2.07

496	002035	华帝股份	225,808.00	2.07
497	601333	广深铁路	224,499.00	2.06
498	600749	西藏旅游	223,612.00	2.05
499	600493	凤竹纺织	220,995.00	2.03
500	002296	辉煌科技	220,070.00	2.02
501	002083	孚日股份	219,196.00	2.01
502	002563	森马服饰	219,062.00	2.01

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,664,425,977.45
卖出股票收入（成交）总额	935,149,948.72

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	1,272,087.89	0.15
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,272,087.89	0.15

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127045	牧原转债	600	68,053.18	0.01
2	111010	立昂转债	600	63,949.56	0.01
3	113549	白电转债	500	63,002.71	0.01
4	110085	通22转债	500	54,211.33	0.01
5	127049	希望转2	500	52,212.60	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，湖北凯龙化工集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局的处罚；江苏振江系能源装备股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方证监局的处罚；江苏利伯特股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到生态环境局的处罚；牧原食品股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到市场监管总局的处罚；杭州立昂薇电子股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上交所的处罚；新希望六和股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深交所的处罚；厦门松霖科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到税务局的处罚；苏州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监督管理局地方监管局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 报告期内本基金不存在投资超出基金合同规定的备选股票库之外的股票的情形。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	253,774.08
2	应收清算款	4,907,903.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,849,215.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,010,893.68

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127045	牧原转债	68,053.18	0.01
2	111010	立昂转债	63,949.56	0.01
3	113549	白电转债	63,002.71	0.01
4	110085	通22转债	54,211.33	0.01
5	127049	希望转2	52,212.60	0.01
6	113651	松霖转债	51,172.33	0.01
7	113060	浙22转债	50,042.49	0.01
8	118011	银微转债	47,867.21	0.01

9	113563	柳药转债	47,076.27	0.01
10	127032	苏行转债	46,483.45	0.01
11	110093	神马转债	46,159.02	0.01
12	127040	国泰转债	45,765.63	0.01
13	113632	鹤21转债	45,415.45	0.01
14	128119	龙大转债	45,370.19	0.01
15	123146	中环转2	44,078.25	0.01
16	111009	盛泰转债	42,664.11	0.01
17	110092	三房转债	41,682.68	0.01
18	113065	齐鲁转债	40,135.57	0.00
19	128087	孚日转债	38,003.75	0.00
20	128066	亚泰转债	37,081.60	0.00
21	123100	朗科转债	35,821.36	0.00
22	127027	能化转债	35,043.70	0.00
23	123149	通裕转债	34,441.11	0.00
24	113045	环旭转债	34,088.54	0.00
25	110064	建工转债	33,289.25	0.00
26	127006	敖东转债	32,768.63	0.00
27	113048	晶科转债	32,752.36	0.00
28	113516	苏农转债	32,569.89	0.00
29	118034	晶能转债	30,885.67	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

数(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
13,791	47,825.32	432,389,378.78	65.56%	227,169,671.44	34.44%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,989,880.36	0.4533%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年02月28日)基金份额总额	202,729,068.62
本报告期期初基金份额总额	10,566,771.22
本报告期基金总申购份额	908,568,060.68
减：本报告期基金总赎回份额	259,575,781.68
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	659,559,050.22

注：报告期期间基金总申购份额含转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

南华基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下南华丰汇混合型证券投资基金于2022年12月12日至2023年1月10日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会表决时间于2023年1月10日17:00截止，会议期间审议了《关于持续运作南华丰汇混合型证券投资基金的议案》。

本次基金份额持有人大会中，基金份额持有人及其代理人所代表的4,759,781.99份有效基金份额参加了此次持有人大会，且其所代表的基金份额占权益登记日基金总份额的57.88%（权益登记日为2022年12月9日，权益登记日本基金总份额8,223,477.46份），符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》的有关持有人大会（通讯方式）的召开条件。

参会的基金份额持有人及其代理人所代表的4,759,781.99份基金份额表示同意，0.00份基金份额表示反对，0.00份基金份额表示弃权。经参加投票表决的基金份额持有人所持表决权的100%同意通过议案。同意本次会议议案的基金份额符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，会议议案有效通过。

此次持有人大会的计票于2023年1月11日在本基金的基金托管人交通银行股份有限公司授权代表的监督下，本基金管理人对本次大会进行了计票，上海源泰律师事务所对计票过程进行了监督，北京市方圆公证处对计票过程及结果进行了公证。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。本次基金份额持有人大会于2023年1月11日表决通过了《关于持续运作南华丰汇混合型证券投资基金的议案》，本次大会决议自该日起生效。

本基金的管理人南华基金管理有限公司将自决议表决通过之日起五日内将表决通过的事项报中国证券监督管理委员会备案。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，朱坚先生于2023年2月28日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的法定代表人，张哲先生于2023年2月28日起担任本基金管理人南华基金管理有限公司的法定代表人；路秀妍女士于2023年8月14日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的督察长，罗丽娟女士于2023年8月14日起担任本基金管理人南华基金管理有限公司的督察长；张哲先生于2023年12月21日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的董事长，朱坚先生于2023年12月21日起担任本基金管理人南华基金管理有限公司的董事长；朱坚先生于2023年12月21日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的总经理；曾媛女士于2023年12月21日起担任本基金管理人南华基金管理有限公司的总经理；曾媛女士于2023年12月21日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的副总经理；张哲先生于2023年12月26日起不再担任本基金管理人南华基金管理有限公司的法定代表人，朱坚先生于2023年12月26日起担任本基金管理人南华基金管理有限公司的法定代表人；前述人事变动已按规定进行备案并公告。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的会计师事务所无变化，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务2年，本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为人民币3万元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人的业务部门及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	73,085,667.84	2.81%	39,901.10	2.14%	-
东方财富	2	238,140,179.59	9.17%	177,633.71	9.54%	-
国联	2	241,774,973.41	9.31%	131,982.83	7.09%	-

证券						
华安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	2,044,447,255.07	78.71%	1,512,639.97	81.23%	-

注：

1、交易单元的选择标准：

- (1) 证券经营机构经营业务全面，资力雄厚，信誉良好且财务状况良好；
- (2) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，建立相关业务利益冲突防范机制，完善隔离墙制度，确保研究、投行服务客观公正，并能满足基金资金投资运作高度保密的要求；
- (3) 研究实力强，有独立的研究部门，能提供宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、推荐模拟组合、债券分析报告、个股分析报告及其他专门报告。

2、证券交易单元选择程序由基金管理人研究部发起立项申请，并联合相关部门根据评分标准对拟选择证券经营机构从不同角度进行评估、打分；研究部汇总评分结果，呈报公司领导审批后，基金管理人与选定证券经营机构签订证券交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	39,637.20	0.66%	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	820,942,000.00	57.67%	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	5,966,233.34	99.34%	602,579,000.00	42.33%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南华基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假APP、网	基金管理人网站、公众号	2023-01-05

	站、二维码、公众号诈骗的风险提示		
2	南华基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	基金管理人网站	2023-01-06
3	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-01-13
4	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2022年第4季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2023-01-20
5	南华丰汇混合型证券投资基金基金2022年第4季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2023-01-20
6	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-02-08
7	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-02-13
8	南华丰汇混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-02-15
9	南华丰汇混合型证券投资基金招募说明书（更新）2023年第1号	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-02-15
10	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增洪泰财富（青岛）基金销售有限责任公司	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、	2023-03-10

	为销售机构并参加其费率优惠的公告	基金管理人网站	
11	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-20
12	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中航证券有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-22
13	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2022年年度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2023-03-30
14	南华丰汇混合型证券投资基金基金2022年年度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-30
15	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增青岛意才基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-03-31
16	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增中山证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-04-04
17	南华基金管理有限公司关于旗下基金新增众惠基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-04-04
18	南华丰汇混合型证券投资基金基金2023年第1季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-04-21
19	南华基金管理有限公司旗下	证券日报、证券时报、中国	2023-04-21

	公开募集证券投资基金2023年第1季度报告提示性公告	证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	
20	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-05-05
21	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-05-08
22	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增平安银行股份有限公司（行E通）为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-05-16
23	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增财通证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-06-09
24	南华丰汇混合型证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-07-21
25	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2023年第2季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2023-07-21
26	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-08-07

	费率优惠的公告		
27	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-08-12
28	南华基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-08-15
29	南华丰汇混合型证券投资基金2023年中期报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-08-30
30	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2023年中期报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2023-08-30
31	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-09-06
32	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增安信证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-09-11
33	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-09-18
34	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增广发证券股份有限公司	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-09-20

	司为销售机构并参加其费率优惠的公告		
35	南华基金管理有限公司关于南华丰汇混合型证券投资基金新增国联证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-10-11
36	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海大智慧基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-10-20
37	南华丰汇混合型证券投资基金2023年第3季度报告	中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-10-24
38	南华基金管理有限公司旗下公开募集证券投资基金2023年第3季度报告提示性公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站、上海证券交易所网站	2023-10-24
39	南华基金管理有限公司关于防范不法分子假冒“南华基金”名义进行非法活动的重要提示	基金管理人网站、公众号	2023-11-22
40	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-11-24
41	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增博时财富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证券日报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-11-24
42	南华基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高证券	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国	2023-12-11

	有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠的公告	证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	
43	南华基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-12-14
44	南华丰汇混合型证券投资基金暂停大额申购、大额转换转入及大额定期定额投资业务的公告	中国证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-12-15
45	关于提醒投资者及时更新已过期身份证明文件、风险承受能力调查问卷、新版营业执照及实际控制人、受益所有人等信息的通知	基金管理人网站、公众号	2023-12-15
46	南华基金管理有限公司2023年行业高级管理人员变更公告	证券日报、证券时报、中国证券报、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站、基金管理人网站	2023-12-23

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023/2/2-2023/2/12	2,099,981.43	0.00	0.00	2,099,981.43	0.32%
个人	1	2023/1/1-2023/2/14	2,459,867.20	171,998.32	0.00	2,631,865.52	0.40%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p>							

(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；
(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予南华丰汇混合型证券投资基金注册的批复文件；
- (2) 《南华丰汇混合型证券投资基金基金合同》；
- (3) 《南华丰汇混合型证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《南华丰汇混合型证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内南华丰汇混合型证券投资基金在指定报刊披露的各项公告原稿。

13.2 存放地点

杭州市上城区横店大厦801室南华基金管理有限公司

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:00-17:30。投资者可免费查询，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：www.nanhuafunds.com

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人南华基金管理有限公司，咨询电话400-810-5599。

南华基金管理有限公司
二〇二四年三月三十日