

# 申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年三月二十九日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 27 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	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况	11
§4	管理人报告	11
4.1	基金管理人及基金经理情况	12
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
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	15
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
§5	托管人报告	18
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6	审计报告	18
6.1	审计意见	18
6.2	形成审计意见的基础	19
6.3	其他信息	19
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任	20
§7	年度财务报表	21
7.1	资产负债表	21
7.2	利润表	23
7.3	净资产变动表	24
7.4	报表附注	26
§8	投资组合报告	63
8.1	期末基金资产组合情况	63
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	64
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	65
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	82

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	87
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 .....	88
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 .....	88
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 .....	88
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 .....	88
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	88
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	88
8.12	投资组合报告附注 .....	88
§9	基金份额持有人信息 .....	89
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	89
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	90
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的情况 .....	90
§10	开放式基金份额变动 .....	90
§11	重大事件揭示 .....	91
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	91
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 .....	91
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	91
11.4	基金投资策略的改变 .....	91
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	91
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 .....	91
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	92
§12	备查文件目录 .....	93
12.1	备查文件目录 .....	94
12.2	存放地点 .....	94
12.3	查阅方式 .....	94

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	申万菱信中证 500 指数增强	
基金主代码	002510	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 4 月 21 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	357,518,558.20 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	002510	007795
报告期末下属分级基金的份额总额	319,948,322.36 份	37,570,235.84 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 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	申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	王菲萍	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		陈晓升	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.swsmu.com
基金年度报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 26 楼
注册登记机构	申万菱信基金管理有限公司	上海市中山南路 100 号 10、11 层

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2023 年		2022 年		2021 年	
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C

本期已实现收益	-29,365,189.46	-4,609,127.52	-68,398,121.22	-19,718,456.20	54,313,273.30	13,334,531.13
本期利润	-24,263,741.21	-4,107,085.25	-91,456,533.07	-25,223,922.19	57,089,560.60	16,672,617.12
加权平均基金份额本期利润	-0.0923	-0.0848	-0.3653	-0.4169	0.2084	0.2403
本期加权平均净值利润率	-6.16%	-5.29%	-23.40%	-25.06%	12.20%	13.15%
本期基金份额净值增长率	-5.76%	-6.05%	-19.05%	-19.29%	13.10%	12.76%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
期末可供分配利润	113,585,773.38	13,535,114.61	117,169,856.64	25,833,531.29	195,316,517.93	51,505,869.71
期末可供分配基金份额利润	0.3550	0.3603	0.4527	0.4687	0.7279	0.7672
期末基金资产	442,006,895.92	55,069,733.85	379,468,405.93	85,993,626.10	485,950,435.53	129,779,240.17

净值						
期末基金份额净值	1.3815	1.4658	1.4660	1.5602	1.8110	1.9332
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	38.15%	46.58%	46.60%	56.03%	81.10%	93.33%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润为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

##### 申万菱信中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.04%	0.75%	-4.36%	0.82%	-1.68%	-0.07%
过去六个月	-11.45%	0.73%	-9.01%	0.81%	-2.44%	-0.08%
过去一年	-5.76%	0.74%	-7.01%	0.78%	1.25%	-0.04%
过去三年	-13.73%	1.13%	-13.83%	1.03%	0.10%	0.10%
过去五年	79.77%	1.29%	29.29%	1.22%	50.48%	0.07%
自基金合同生效起至今	38.15%	1.24%	-8.59%	1.20%	46.74%	0.04%



## 申万菱信中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.11%	0.75%	-4.36%	0.82%	-1.75%	-0.07%
过去六个月	-11.58%	0.73%	-9.01%	0.81%	-2.57%	-0.08%
过去一年	-6.05%	0.74%	-7.01%	0.78%	0.96%	-0.04%
过去三年	-14.51%	1.13%	-13.83%	1.03%	-0.68%	0.10%
自基金合同生效起至今	46.58%	1.25%	16.96%	1.16%	29.62%	0.09%

1、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。

2、本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。

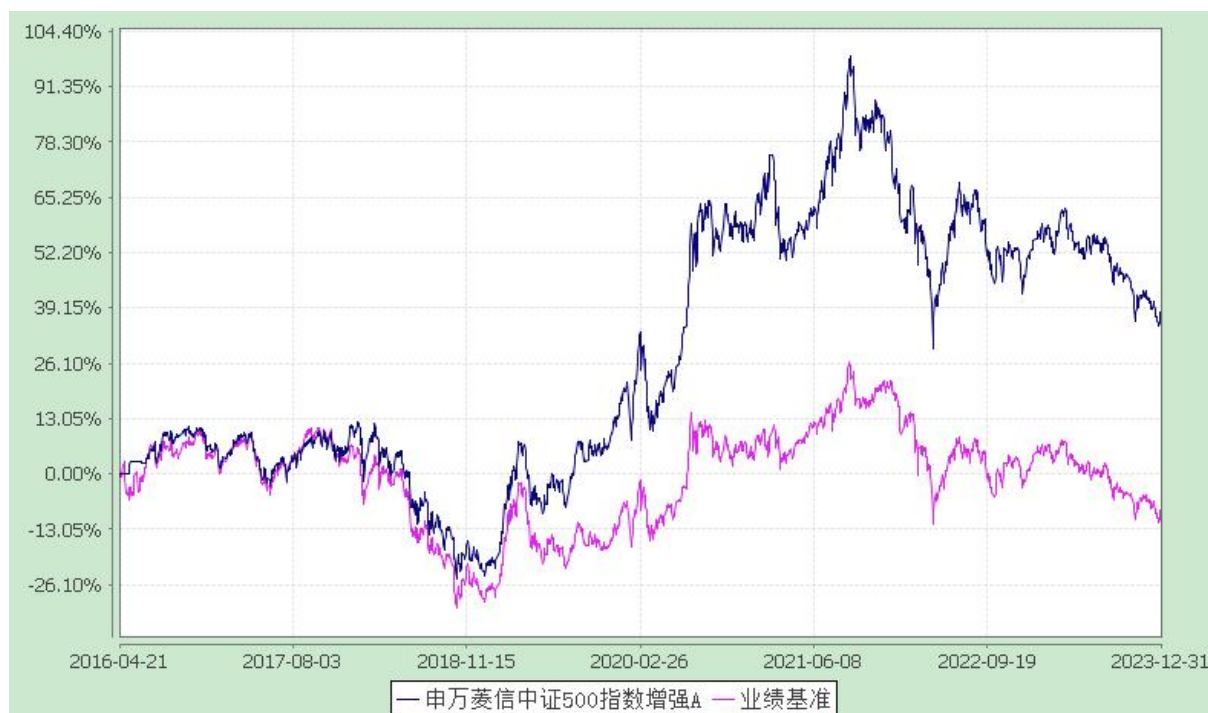
## 3.2.2 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

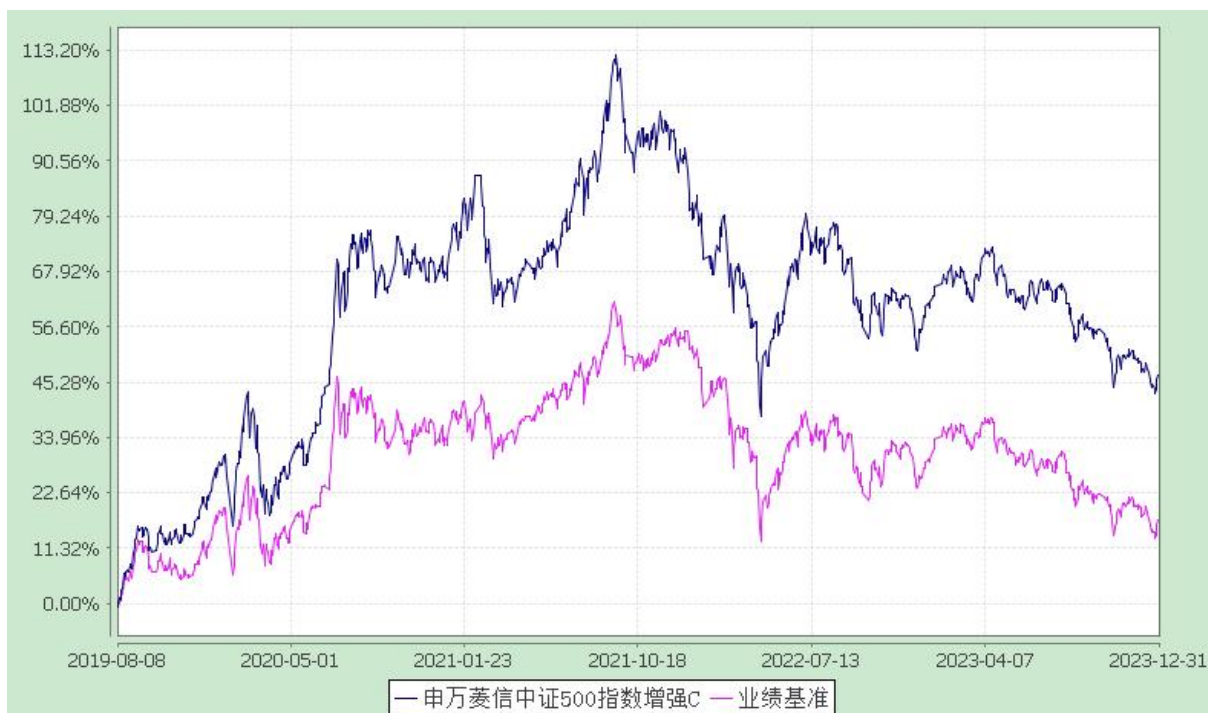
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 4 月 21 日至 2023 年 12 月 31 日)

## 申万菱信中证 500 指数增强 A



## 申万菱信中证 500 指数增强 C

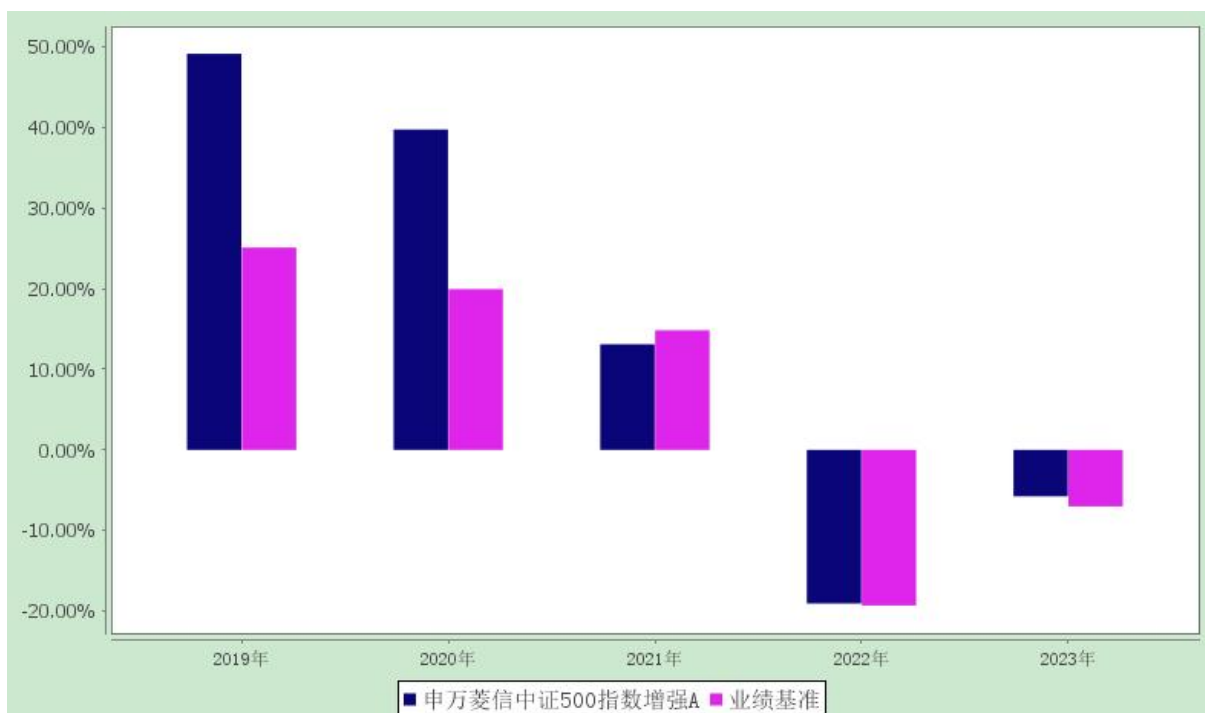


注：本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

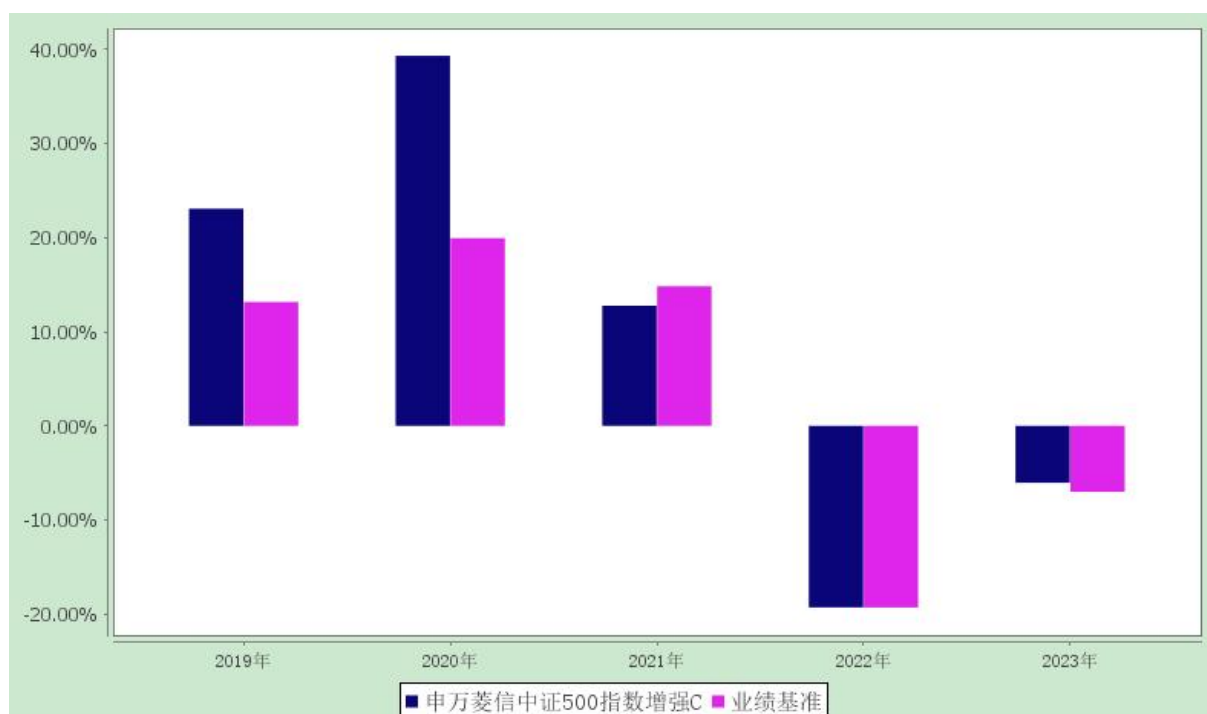
### 3.2.3 基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金  
基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

#### 申万菱信中证 500 指数增强 A



#### 申万菱信中证 500 指数增强 C



注：本基金自 2019 年 08 月 08 日 起增加 C 类基金份额类别，C 类份额自 2019 年 08 月 08 日 起实际存续，故存续起始当年净值增长率按当年实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、申万菱信中证 500 指数增强 A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

#### 2、申万菱信中证 500 指数增强 C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

申万菱信基金自成立以来，始终将持有人的利益放在首位，秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命，遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来，申万菱信基金围绕市场和客户需求，逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划；通过努力打造“美好生活”系列权益产品，不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类，致力于为持有人提供“温暖陪伴”的服务，以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有公募基金 80 只，资产管理规模 1050.57 亿元，公募产品累计分红 206.72 亿元（数据截至 2023 年 12 月 31 日）。

近年来，申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform)，推动“研究数字化”；通过基金经理的风格开发、稳定和优化，推动“投资风格化”；通过风险管理工作的关口前移，加强市场风险管理支持，推动“风控全流程”，从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”，以提升投资业绩。此外，申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系(Excellent Strategy & Product)、卓越品牌与客户服务体系(Excellent Branding & Service)，提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚，中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67% 的股份，日本三菱 UFJ 信托银行持有公司 33% 的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人、基金投资顾问、合格境内有限合伙人(QDLP)等业务资格，并全资设立申万菱信(上海)资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构。

### 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		
俞	本基金基金经理	2016-	-	14 年	俞诚先生，经济学学士、2009 年起从

诚		04-21		<p>事金融相关工作，2009 年 08 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任产品与金融工程总部金融工程师、数量研究员，申万菱信中证申万电子行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万传媒行业投资指数分级证券投资基金、申万菱信中证申万医药生物指数分级证券投资基金、申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、申万菱信价值优享混合型证券投资基金、申万菱信中小板指数证券投资基金（LOF）、申万菱信量化驱动混合型证券投资基金、申万菱信价值优利混合型证券投资基金、申万菱信量化小盘股票型证券投资基金（LOF）基金经理，现任申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金、申万菱信创业板量化精选股票型证券投资基金基金经理。</p>
---	--	-------	--	---

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 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《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易办法》，通过

组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

对于场内同向交易，我们采集了本报告期内本公司旗下两两投资组合在相同时间窗口下（日内、3 日内和 5 日内）同买或者同卖场内同一证券时两者买卖均价存在的差异（即价差率）序列，然后

按两两组合归类计算平均价差率。首先，假设两两组合在本报告期的价差率呈正态分布且平均价差率为 0，我们进行了 95% 的置信度、假设平均价差率为 0 的 T 检验，若通过该假设检验，则认为该两两组合的交易得到了公平的执行；对于未通过假设检验的情况，我们还计算了两两组合价差占优比差、模拟输送比例等指标；若综合以上各项指标，认为仍存在一定的嫌疑，则我们将进一步对该两两组合同向买卖特定场内证券的时点、价格、数量等作分析，来判断是否存在重大利益输送的可能性。经分析本期未发生异常情况。

对于场外同向交易，我们分析了本报告期内不同时间窗口内（日内、3 日内和 5 日内）两两组合同向交易的价差率、对比市场公允价格和交易对手，未发现利益输送的情况。

对于反向交易，我们根据交易价格、交易频率、交易数量等进行了综合分析，未发现异常情况。

综合而言，本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 5 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 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

2023 年全年，沪深 A 股整体震荡下行。报告期内，小盘风格整体占优。尽管指数走势震荡调整，但市场仍然展现了一定的结构性机会，整体呈现几个特征，一是蓝筹及机构重仓股板块跌幅相对较大，说明机构关注度高、高持仓个股表现相对较弱；二是北证 50 自四季度开始逆势拉升，表明小盘、关注度相对较低的个股受到市场重视；三是全年来看，万得微盘股表现较好，表明市场下沉策略受到追捧，与今年量化基金表现优于其他基金相匹配。对于未来，我们认为：其一，市净率已经处于相对低位，且政策友好，对指数形成一定支撑；其二，加权市净率未处于极限位置，市场结构高估与低估并存，市场等待企业盈利端的后续验证。2023 年全年，上证综指下跌-3.70%，深证成份指数下跌-13.54%，沪深 300 指数下跌-11.38%，而中证 500 指数下跌-7.42%，中小板指数下跌-17.98%，创业板指数下跌-19.41%。

本基金采用的量化模型仍然秉持兼具价值创造和价值回归的主要选股逻辑。未来，本基金将力争控制跟踪误差和偏离度在基金合同的允许范围内，努力提升基金风险收益比率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为-5.76%，同期业绩基准表现为-7.01%。

本基金 C 类产品报告期内净值表现为-6.05%，同期业绩基准表现为-7.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年全球库存周期下行、经济增速放缓，美联储加息，发展中国家经济压力加大。中国依托庞大的国内市场，消费韧性支撑经济发展，新兴产业投资、基建投资增长对冲房地产投资下滑，尽管出口明显下滑，但是整体经济还是平稳增长。美元高利率下，A 股受外资流出、风险偏好下降等影响，出现了一定调整，相对稳定的高股息资产受到关注，出现独立行情。

展望 2024 年，全球库存周期有望企稳回升，带动经济增速上行。美国经济或将软着陆，全球风险有望下降。全球从去库存转向补库存，有望带动进出口增速回升，带动经济增长。跨境电商、新能源汽车、AI 等展现出良好发展势头。随着通胀率回落，美联储有望开启降息周期，人民币贬值压力缓解，外资有望转为流入，带动 A 股整体估值回升。A 股投资风格有望从高股息，转向周期复苏和成长板块。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作继续秉承以合规促进发展的理念，着眼于促进合规建设与可持续发展，重点从优化制度流程、完善内部授权体系、推进合规文化建设、强化员工行为监测、深化内审稽核检查、防范合规风险等方面着手，并以合规管理制度建设为抓手，以合规促进业务发展，积极构建全面合规管理体系。

本报告期内，本基金管理人的监察稽核工作重点包括：

1、检视公司制度和业务流程，全面推进建章立制工作。本报告期内，公司根据最新法规政策的要求，结合业务运作情况，秉持规范内控流程、优化管理机制的原则对相关制度进行建设、梳理与修订，以加强对公司各项业务活动的管理，促进公司经营规范化和决策科学化。同时在公司上下进一步传导制度建设文化，明晰各业务间职能分工与责任归属，有效提升合规效能。

2、深入开展合规宣导培训，强化员工行为管控。坚持实时跟踪法律、法规、准则变化和监管动态，通过各种形式加强合规传导，深入推进合规文化建设。持续推进员工行为管理内控体系建设，促进员工依法依规履职，强化员工职业操守和行为规范。

3、以落实廉洁从业规定为契机，促进业务合规发展。建立廉洁从业有效联动机制，积极开展廉



洁从业风险点自查及防控机制建设工作。同时落实“行于矩，坚守底线、敬畏法治”合规管理要求，持续推进公司廉洁从业文化建设。

4、深化各类内审稽核，及时处置与防范合规风险。本报告期内，按年度计划对公司部门/业务条线等开展了常规稽核工作，多方着手加强监督执行；有效开展季度定期合规检查，及时优化内控体系，强化公司制度执行和落实，进一步防范合规风险。

5、强化宣传推介材料合规审核，做好合法合规营销。细化公司宣传推介材料合规口径，加强基金宣传推介材料的流程管理，积极开展合规培训，提高合规意识，保护基金持有人的合法权益。

6、履行信息披露义务，维护基金投资人的知情权。严格按照信息披露相关法规规定，完善信息披露管理工作机制，组织落实各项信息披露工作，维护基金持有人知情权。

7、完善反洗钱制度体系建设，进一步加强洗钱风险管控。本年度，公司坚持“风险为本”的反洗钱政策，落实反洗钱法律法规的规定，不断完善反洗钱制度体系建设，夯实业务部门洗钱风险的基础管理，通过持续的培训、宣传等方式努力营造反洗钱合规文化。

本报告期内，在监察稽核工作的开展过程中本基金管理人未发现投资运作等方面存在与法律法规或基金合同约定相违背的情况。今后本基金管理人将继续坚持基金份额持有人利益优先的原则，以科学的风险管理为基础，积极有效地开展监察稽核工作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值政策及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25%以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

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督察长、分管基金投资的副总经理、分管基金运营的副总经理、基金运营部门负责人、法律合规与审计部门负责人、风险管理部门负责人。以上成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规、基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与最终决策和日常估值的执行。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所债券市场的估值数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §6 审计报告

毕马威华振审字第 2402544 号

申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了后附的申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）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、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行

业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 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。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

该基金管理人申万菱信基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价该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。

(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师

虞京京 梁潇

上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 26 楼

2024 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	57,014,460.98	33,386,872.86
结算备付金		4,338,798.26	5,547,513.08
存出保证金		2,468,631.60	61,269.43
交易性金融资产	7.4.7.2	436,312,188.55	428,548,554.39
其中：股票投资		436,312,188.55	428,548,554.39
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		145,392.46	-
应收股利		-	-
应收申购款		398,774.16	423,499.91
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.5	-	-
<b>资产总计</b>		<b>500,678,246.01</b>	<b>467,967,709.67</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2023 年 12 月 31 日</b>	<b>2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债:</b>			
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		543,141.67	393,764.81
应付管理人报酬		421,642.65	401,158.32
应付托管费		84,328.55	80,231.64
应付销售服务费		58,627.56	62,389.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,493,875.81	1,568,133.21
<b>负债合计</b>		<b>3,601,616.24</b>	<b>2,505,677.64</b>
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	357,518,558.20	313,959,528.16
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	139,558,071.57	151,502,503.87
净资产合计		497,076,629.77	465,462,032.03
负债和净资产总计		500,678,246.01	467,967,709.67

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额总额 357,518,558.20 份。A 类基金份额净值 1.3815 元，份额总额 319,948,322.36 份；C 类基金份额净值 1.4658 元，份额总额 37,570,235.84 份。

## 7.2 利润表

会计主体：申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-21,746,947.38	-109,733,463.12
1.利息收入		219,344.02	204,818.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	219,344.02	204,818.38
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,592,025.90	-81,404,533.76
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-35,123,260.35	-88,354,777.13
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	582.56	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-409,660.09	-374,664.84
股利收益	7.4.7.15	7,940,311.98	7,324,908.21
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	5,603,490.52	-28,563,877.84
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	22,243.98	30,130.10
<b>减：二、营业总支出</b>		6,623,879.08	6,946,992.14
1. 管理人报酬		4,723,527.79	4,916,518.01
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-

2. 托管费		944,705.68	983,303.65
3. 销售服务费		705,736.98	794,470.17
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		349.16	-
8. 其他费用	7.4.7.19	249,559.47	252,700.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-28,370,826.46</b>	<b>-116,680,455.26</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-28,370,826.46</b>	<b>-116,680,455.26</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-28,370,826.46</b>	<b>-116,680,455.26</b>

### 7.3 净资产变动表

会计主体：申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 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	313,959,528.16	151,502,503.87	465,462,032.03
二、本期期初净资产	313,959,528.16	151,502,503.87	465,462,032.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	43,559,030.04	-11,944,432.30	31,614,597.74
（一）、综合收益总额	-	-28,370,826.46	-28,370,826.46
（二）、本期基金	43,559,030.04	16,426,394.16	59,985,424.20



份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	152,646,679.25	77,404,863.98	230,051,543.23
2. 基金赎回款	-109,087,649.21	-60,978,469.82	-170,066,119.03
（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	357,518,558.20	139,558,071.57	497,076,629.77
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 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	335,462,421.91	280,267,253.79	615,729,675.70
二、本期期初净资产	335,462,421.91	280,267,253.79	615,729,675.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,502,893.75	-128,764,749.92	-150,267,643.67
（一）、综合收益总额	-	-116,680,455.26	-116,680,455.26
（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）	-21,502,893.75	-12,084,294.66	-33,587,188.41
其中：1. 基金申购款	126,955,483.03	75,735,101.18	202,690,584.21
2. 基金赎回款	-148,458,376.78	-87,819,395.84	-236,277,772.62
（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	313,959,528.16	151,502,503.87	465,462,032.03
-----------	----------------	----------------	----------------

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：

基金管理人负责人：汪涛，主管会计工作负责人：汪涛，会计机构负责人：徐越

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金（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[2015]第 3120 号《关于准予申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由申万菱信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《申万菱信中证 500 指数增强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 546,833,443.54 元。经向中国证监会备案，《申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2016 年 4 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 546,955,898.05 份基金份额，其中认购资金利息折合 122,454.51 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，本基金自 2019 年 8 月 8 日起增加 C 类份额，并对本基金的基金合同作相应修改。在本基金增加 C 类份额后，原有的基金份额将全部自动转换为本基金 A 类份额。A 类基金份额在投资者申购时收取手续费，不计提销售服务费；C 类基金份额从本类别基金资产中计提销售服务费，不收取手续费。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和最新公布的《申万菱信中证 500 指数增强型证券投资基金更新招募说明书》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的股票（包括主板、中小板、创业板及其他依法发行、上市的股票）、权证、股指期货、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单等固定收益类资产及现金，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的相关规定）。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。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。

本基金资产配置比例为：本基金持有的股票资产占基金资产净值的比例不低于 80%，其中投资于中证 500 指数成份股及备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资股指期货、权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金

融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

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分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间

分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金在初始确认时将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及以摊余成本计量的金融负债。

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

##### - 以摊余成本计量的金融负债

该类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。

#### 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

##### (a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

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

##### (b) 后续计量

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

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

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### i. 预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失

准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### ii. 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### iii. 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易



日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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**

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### **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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

#### **7.4.4.8 损益平准金**

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日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值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入证券出借业务利息收入。

##### 投资收益

股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

##### 公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等按照权责发生制原则，在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入当期损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入当期损益。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

#### **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**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

(d) 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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 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	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	57,014,460.98	33,386,872.86
等于：本金	57,009,280.72	33,383,363.13
加：应计利息	5,180.26	3,509.73
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
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	-	-
合计	57,014,460.98	33,386,872.86

## 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	442,460,976.80	-	436,312,188.55	-6,148,788.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	442,460,976.80	-	436,312,188.55	-6,148,788.25
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	439,844,113.16	-	428,548,554.39	-11,295,558.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	439,844,113.16	-	428,548,554.39	-11,295,558.77

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	17,982,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	17,982,840.00	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义	公允价值		备注

	金额	资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2402	IC2402	17.00	18,439,560.00	456,720.00
合计	-	-	-	456,720.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	456,720.00
净额	-	-	-	-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

#### 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

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.6 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	70.13	91.68
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,300,358.10	1,255,902.93
其中：交易所市场	2,300,358.10	1,255,902.93



银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付指数使用费	20,447.58	19,138.60
预提审计费用	53,000.00	53,000.00
预提信息披露费用	120,000.00	240,000.00
合计	2,493,875.81	1,568,133.21

#### 7.4.7.7 实收基金

申万菱信中证 500 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	258,841,679.52	258,841,679.52
本期申购	127,956,997.31	127,956,997.31
本期赎回（以“-”号填列）	-66,850,354.47	-66,850,354.47
本期末	319,948,322.36	319,948,322.36

申万菱信中证 500 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	55,117,848.64	55,117,848.64
本期申购	24,689,681.94	24,689,681.94
本期赎回（以“-”号填列）	-42,237,294.74	-42,237,294.74
本期末	37,570,235.84	37,570,235.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额

#### 7.4.7.8 未分配利润

申万菱信中证 500 指数增强 A

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	117,169,856.64	3,456,869.77	120,626,726.41

本期期初	117,169,856.64	3,456,869.77	120,626,726.41
本期利润	-29,365,189.46	5,101,448.25	-24,263,741.21
本期基金份额交易产生的变动数	25,781,106.20	-85,517.84	25,695,588.36
其中：基金申购款	57,393,430.29	4,599,736.75	61,993,167.04
基金赎回款	-31,612,324.09	-4,685,254.59	-36,297,578.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	113,585,773.38	8,472,800.18	122,058,573.56

申万菱信中证 500 指数增强 C

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	25,833,531.29	5,042,246.17	30,875,777.46
本期期初	25,833,531.29	5,042,246.17	30,875,777.46
本期利润	-4,609,127.52	502,042.27	-4,107,085.25
本期基金份额交易产生的变动数	-7,689,289.16	-1,579,905.04	-9,269,194.20
其中：基金申购款	11,737,082.26	3,674,614.68	15,411,696.94
基金赎回款	-19,426,371.42	-5,254,519.72	-24,680,891.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,535,114.61	3,964,383.40	17,499,498.01

## 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	121,487.94	132,883.49
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	96,754.74	25,683.37
其他	1,101.34	46,251.52

合计	219,344.02	204,818.38
----	------------	------------

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	3,551,068,821.01	2,381,944,230.63
减：卖出股票成本总额	3,576,359,536.98	2,463,095,952.01
减：交易费用	9,832,544.38	7,203,055.75
买卖股票差价收入	-35,123,260.35	-88,354,777.13

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	823.56	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-241.00	-
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	582.56	-

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1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	2,029,720.28	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,999,581.00	-
减：应计利息总额	30,380.28	-

减：交易费用	-	-
买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	-241.00	-

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-409,660.09	-374,664.84

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	7,940,311.98	7,324,908.21
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,940,311.98	7,324,908.21

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	5,146,770.52	-28,563,877.84
——股票投资	5,146,770.52	-28,563,877.84
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-

2.衍生工具	456,720.00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	456,720.00	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	5,603,490.52	-28,563,877.84

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	22,240.02	29,796.64
基金转换费收入	3.96	333.46
合计	22,243.98	30,130.10

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	53,000.00	53,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	75,576.47	78,664.31
汇划手续费	983.00	1,036.00
合计	249,559.47	252,700.31

### 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 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

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

无。

## 7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司（以下简称“申万菱信”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金销售机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
申万宏源	1,674,691,494.05	23.50%	1,141,156,985.89	24.22%

## 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例

申万宏源	1,999,340.00	50.00%	-	-
------	--------------	--------	---	---

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申万宏源	1,566,351.27	23.54%	372,121.26	16.18%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
申万宏源	1,056,551.86	24.23%	697,103.44	55.51%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,723,527.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,625,234.58	1,510,096.26
应支付基金管理人的净管理费	3,098,293.21	3,406,421.75

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	944,705.68	983,303.65

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C	合计
中国工商银行	20,425.56	673.80	21,099.36
申万菱信	48,305.86	59,383.98	107,689.84
申万宏源	1,003.11	0.00	1,003.11
合计	69,734.53	60,057.78	129,792.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信中证500指数增强 A	申万菱信中证500指数增强C	合计
中国工商银行	18,642.78	0.00	18,642.78
申万菱信	84,151.48	142,181.58	226,333.06
申万宏源	604.57	0.00	604.57
合计	103,398.83	142,181.58	245,580.41

注：（1）本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%，销售服务费按前一日 A 类基金份额的基金资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times A \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 A 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 A 类基金份额前一日的基金资产净值



基金销售服务费每日计提，按月支付。

(2) 本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times C \text{ 类基金销售服务费年费率} / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期和上年度可比期间内，本基金管理人未发生运用自有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方，未发生投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1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
中国工商银行股份有限公司	57,014,460.98	121,487.94	33,386,872.86	132,883.49

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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
001306	夏厦精密	2023-1-09	1-6个月(含)	新股限售	53.63	84.62	64.00	3,432.32	5,415.68	-
001326	联域股份	2023-1-01	1-6个月(含)	新股限售	41.18	51.74	99.00	4,076.82	5,122.26	-
001358	兴欣新材	2023-1-2-14	1-6个月(含)	新股限售	41.00	46.28	87.00	3,567.00	4,026.36	-
001378	德冠新材	2023-1-0-23	1-6个月(含)	新股限售	31.68	36.39	205.00	6,494.40	7,459.95	-
301251	威尔高	2023-0-8-30	1-6个月(含)	新股限售	28.88	34.64	321.00	9,270.48	11,119.44	-
301413	安培龙	2023-1-2-11	1-6个月(含)	新股限售	33.25	70.25	164.00	5,453.00	11,521.00	-
301459	丰茂股份	2023-1-2-06	1-6个月(含)	新股限售	31.90	44.48	208.00	6,635.20	9,251.84	-
301489	思泉新材	2023-1-0-16	1-6个月(含)	新股限售	41.66	67.77	128.00	5,332.48	8,674.56	-
301500	飞南资源	2023-0-9-13	1-6个月(含)	新股限售	23.97	20.89	455.00	10,906.35	9,504.95	-
30150	中机	2023-1-	1-6个	新股	16.82	32.25	419.00	7,047.	13,512	-

8	认检	1-23	月 (含)	限售				58	.75	
301516	中远通	2023-12-01	1-6个月 (含)	新股限售	6.87	20.06	604.00	4,149.48	12,116.24	-
301517	陕西华达	2023-10-09	1-6个月 (含)	新股限售	26.87	51.90	185.00	4,970.95	9,601.50	-
301520	万邦医药	2023-09-18	1-6个月 (含)	新股限售	67.88	52.74	160.00	10,860.80	8,438.40	-
301526	国际复材	2023-12-19	1-6个月 (含)	新股限售	2.66	5.26	8,147.00	21,671.02	42,853.22	-
301548	崇德科技	2023-09-11	1-6个月 (含)	新股限售	66.80	59.03	127.00	8,483.60	7,496.81	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	1-6个月 (含)	新股限售	37.56	43.58	260.00	9,765.60	11,330.80	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	1-6个月 (含)	新股限售	22.88	39.68	224.00	5,125.12	8,888.32	-
301566	达利凯普	2023-12-22	1-6个月 (含)	新股限售	8.90	27.95	576.00	5,126.40	16,099.20	-
301568	思泰克	2023-11-21	1-6个月 (含)	新股限售	23.23	43.26	246.00	5,714.58	10,641.96	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	1-6个月 (含)	新股限售	48.94	74.43	118.00	5,774.92	8,782.74	-
601083	锦江航运	2023-11-28	1-6个月 (含)	新股限售	11.25	11.85	775.00	8,718.75	9,183.75	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	1-6个月 (含)	新股限售	1.70	5.23	3,918.00	6,660.60	20,491.14	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	1-6个月 (含)	新股限售	16.80	34.50	195.00	3,276.00	6,727.50	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	1-6个月 (含)	新股限售	58.08	59.52	90.00	5,227.20	5,356.80	-

603075	热威股份	2023-09-01	1-6 个月(含)	新股限售	23.10	23.32	170.00	3,927.00	3,964.40	-
603107	上海汽配	2023-10-25	1-6 个月(含)	新股限售	14.23	21.96	292.00	4,155.16	6,412.32	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	1-6 个月(含)	新股限售	21.29	22.26	161.00	3,427.69	3,583.86	-
603270	金帝股份	2023-08-25	1-6 个月(含)	新股限售	21.77	29.58	195.00	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023-10-16	1-6 个月(含)	新股限售	9.50	20.45	178.00	1,691.00	3,640.10	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	1-6 个月(含)	新股限售	25.73	24.88	134.00	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	1-6 个月(含)	新股限售	19.10	40.47	88.00	1,680.80	3,561.36	-
688648	中邮科技	2023-11-06	1-6 个月(含)	新股限售	15.18	24.91	303.00	4,599.54	7,547.73	-
688652	京仪装备	2023-11-22	1-6 个月(含)	新股限售	31.95	57.06	416.00	13,291.20	23,736.96	-
688653	康希通信	2023-11-10	1-6 个月(含)	新股限售	10.50	18.86	648.00	6,804.00	12,221.28	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	1-6 个月(含)	新股限售	103.40	79.31	101.00	10,443.40	8,010.31	-
688702	盛科通信	2023-09-06	1-6 个月(含)	新股限售	42.66	48.19	289.00	12,328.74	13,926.91	-
688716	中研股份	2023-09-13	1-6 个月(含)	新股限售	29.66	36.38	267.00	7,919.22	9,713.46	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	1-6 个月(含)	新股限售	69.98	60.10	181.00	12,666.38	10,878.10	-
688720	艾森股份	2023-11-29	1-6 个月	新股限售	28.03	57.51	165.00	4,624.95	9,489.15	-

			(含)							
--	--	--	-----	--	--	--	--	--	--	--

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数增强型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。与这些金融工具有关的风险, 以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数增强型基金, 属于中高风险品种, 在跟踪指数的基础上, 采用了量化增强的策略。本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内, 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度, 并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改, 本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本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, 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。

本基金面临的主要风险包括: 信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是其他价格风险。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占净资产的比例为 0%（上期末：0%）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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主要来源于基金兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影

响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

#### 7.4.13.3.1 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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净资产的 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该比例限制。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过净资产的 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。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。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同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无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为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

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。

于本期末，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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个 月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计 息	合计
资产							
银行存款	57,014,460.98	-	-	-	-	-	57,014,460.98
结算备付金	4,338,798.26	-	-	-	-	-	4,338,798.26
存出保证金	71,488.80	-	-	-	-	2,397,142.80	2,468,631.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	436,312,188.55	436,312,188.55
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	145,392.46	145,392.46
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	398,774.16	398,774.16
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	61,424,748.04	-	-	-	-	439,253,497.97	500,678,246.01
负债							



短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	543,141.67	543,141.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	421,642.65	421,642.65
应付托管费	-	-	-	-	-	84,328.55	84,328.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	58,627.56	58,627.56
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	2,493,875.81	2,493,875.81
负债总计	-	-	-	-	-	3,601,616.24	3,601,616.24
利率敏感度缺口	61,424,748.04	-	-	-	-	435,651,881.73	497,076,629.77
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月 以内	1-3 个 月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计 息	合计
资产							
银行存款	33,386,872.86	-	-	-	-	-	33,386,872.86
结算备付金	5,547,513.08	-	-	-	-	-	5,547,513.08
存出保证金	61,269.43	-	-	-	-	-	61,269.43
交易性金融资产	-	-	-	-	-	428,548,554.39	428,548,554.39
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	423,499.91	423,499.91
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	38,995	-	-	-	-	428,97	467,96

	,655.37					2,054.30	7,709.67
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	393,764.81	393,764.81
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	401,158.32	401,158.32
应付托管费	-	-	-	-	-	80,231.64	80,231.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	62,389.66	62,389.66
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	1,568,133.21	1,568,133.21
负债总计	-	-	-	-	-	2,505,677.64	2,505,677.64
利率敏感度缺口	38,995,655.37	-	-	-	-	426,466,376.66	465,462,032.03

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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

于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占净资产的比例为 0%（上期末：0%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上期末：同）。

#### 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

基金的其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。本基

金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的指数增强型基金，投资于股票资产不低于基金资产净值的 80%，其中，投资于指数成份股、备选成份股的资产占股票资产的比例不低于 80%，所以存在很高的其他价格风险。

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

本基金管理人日常主要运用跟踪误差、标准差、beta 值、VAR 等指标对基金进行风险度量，有效监控基金的投资组合面临的的市场价格风险。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	436,312,188.55	87.78	428,548,554.39	92.07
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	436,312,188.55	87.78	428,548,554.39	92.07

注：其他包含股指期货投资，于本期末，持仓数量为 17 手，合约市值为 18439560 元(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得持仓损益)之间按抵消后的金额为 0。

#### 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（见附注 7.4.1）中的股票指数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

	基准上升 5%	18,010,000.00	20,290,000.00
	基准下降 5%	-18,010,000.00	-20,290,000.00

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 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	435,922,783.42	426,362,410.86
第二层次	-	-
第三层次	389,405.13	2,186,143.53
合计	436,312,188.55	428,548,554.39

###### 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。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

###### 7.4.14.2.3 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 1 月 1 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	-	2,186,143.53	2,186,143.53
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	361,432.78	361,432.78
转出第三层次	-	2,760,618.09	2,760,618.09
当期利得或损失总额	-	602,446.91	602,446.91
其中：计入损益的利得或损失	-	602,446.91	602,446.91
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	389,405.13	389,405.13
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	-	126,412.43	126,412.43
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	7,144,491.09	7,144,491.09

转出第三层次	-	4,529,821.84	4,529,821.84
当期利得或损失总额	-	-428,525.72	-428,525.72
其中：计入损益的利得或损失	-	-428,525.72	-428,525.72
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	2,186,143.53	2,186,143.53
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-72,738.53	-72,738.53

## 7.4.14.2.3.1 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
股票投资	389,405.13	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	22.0799%-153.1612%	预期年化波动率越高，公允价值越低
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	2,186,143.53	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	19.0909%-87.9166%	预期年化波动率越高，公允价值越低

## 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, 本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日: 无)。

#### 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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债, 其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 12 月 31 日, 本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	436,312,188.55	87.14
	其中: 股票	436,312,188.55	87.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	61,353,259.24	12.25
7	其他各项资产	3,012,798.22	0.60
8	合计	500,678,246.01	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	16,038,667.00	3.23
C	制造业	174,276,438.78	35.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,359,896.94	9.33
E	建筑业	2,356,542.00	0.47
F	批发和零售业	7,829,870.00	1.58
G	交通运输、仓储和邮政业	20,089,904.50	4.04
H	住宿和餐饮业	2,113,635.92	0.43
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,223,683.94	2.86
J	金融业	56,726,969.13	11.41
K	房地产业	15,469,503.00	3.11
L	租赁和商务服务业	1,142,202.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,320,660.00	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,839,865.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	361,787,838.21	72.78

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	783,511.00	0.16
B	采矿业	347,528.00	0.07
C	制造业	46,914,077.11	9.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,801,415.00	0.56
E	建筑业	3,714,995.00	0.75
F	批发和零售业	3,653,865.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	1,661,630.75	0.33
H	住宿和餐饮业	105,856.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,256,029.22	0.25
J	金融业	1,555,244.75	0.31
K	房地产业	4,391,886.00	0.88
L	租赁和商务服务业	667,818.36	0.13
M	科学研究和技术服务业	726,319.15	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	5,561,441.00	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	382,734.00	0.08
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	74,524,350.34	14.99

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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

#### 8.3.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	000591	太阳能	1,136,400.00	6,341,112.00	1.28
2	000997	新大陆	322,100.00	6,316,381.00	1.27
3	600642	申能股份	979,902.00	6,290,970.84	1.27
4	000563	陕国投 A	1,990,500.00	6,051,120.00	1.22
5	688169	石头科技	20,902.00	5,914,220.90	1.19
6	600901	江苏金租	1,217,833.00	5,894,311.72	1.19
7	002966	苏州银行	886,000.00	5,723,560.00	1.15
8	688520	神州细胞	105,335.00	5,674,396.45	1.14
9	600535	天士力	329,700.00	5,611,494.00	1.13
10	001872	招商港口	302,200.00	4,823,112.00	0.97
11	688349	三一重能	147,200.00	4,212,864.00	0.85
12	000883	湖北能源	995,300.00	4,210,119.00	0.85
13	600582	天地科技	768,700.00	4,181,728.00	0.84
14	603826	坤彩科技	70,400.00	4,155,712.00	0.84
15	600482	中国动力	229,600.00	4,135,096.00	0.83
16	000027	深圳能源	640,300.00	4,129,935.00	0.83
17	601233	桐昆股份	272,400.00	4,121,412.00	0.83
18	000553	安道麦 A	588,000.00	4,080,720.00	0.82
19	601997	贵阳银行	775,100.00	3,984,014.00	0.80
20	601778	晶科科技	1,136,600.00	3,978,100.00	0.80
21	000598	兴蓉环境	694,400.00	3,951,136.00	0.79
22	600909	华安证券	808,400.00	3,944,992.00	0.79
23	002372	伟星新材	272,600.00	3,944,522.00	0.79
24	600927	永安期货	250,400.00	3,933,784.00	0.79
25	600873	梅花生物	411,300.00	3,927,915.00	0.79
26	600755	厦门国贸	562,500.00	3,920,625.00	0.79
27	600325	华发股份	540,800.00	3,899,168.00	0.78
28	600352	浙江龙盛	464,000.00	3,897,600.00	0.78
29	601016	节能风电	1,297,900.00	3,893,700.00	0.78
30	000778	新兴铸管	1,018,500.00	3,890,670.00	0.78
31	600863	内蒙华电	996,700.00	3,887,130.00	0.78
32	600350	山东高速	559,100.00	3,880,154.00	0.78
33	601139	深圳燃气	558,500.00	3,848,065.00	0.77
34	601077	渝农商行	941,200.00	3,840,096.00	0.77
35	601158	重庆水务	676,800.00	3,837,456.00	0.77
36	000060	中金岭南	887,200.00	3,832,704.00	0.77
37	600655	豫园股份	617,100.00	3,832,191.00	0.77
38	600985	淮北矿业	230,400.00	3,831,552.00	0.77
39	600663	陆家嘴	437,600.00	3,829,000.00	0.77
40	000783	长江证券	711,400.00	3,827,332.00	0.77
41	000987	越秀资本	633,700.00	3,814,874.00	0.77
42	601598	中国外运	727,200.00	3,810,528.00	0.77
43	601128	常熟银行	594,500.00	3,798,855.00	0.76
44	601298	青岛港	612,100.00	3,782,778.00	0.76

45	600848	上海临港	375,200.00	3,770,760.00	0.76
46	601000	唐山港	1,073,887.00	3,758,604.50	0.76
47	600271	航天信息	352,700.00	3,752,728.00	0.75
48	600390	五矿资本	763,840.00	3,574,771.20	0.72
49	000402	金融街	747,000.00	2,711,610.00	0.55
50	601058	赛轮轮胎	217,700.00	2,557,975.00	0.51
51	300724	捷佳伟创	34,500.00	2,553,345.00	0.51
52	002028	思源电气	49,000.00	2,549,960.00	0.51
53	600161	天坛生物	82,080.00	2,539,555.20	0.51
54	300017	网宿科技	314,800.00	2,471,180.00	0.50
55	300568	星源材质	160,200.00	2,470,284.00	0.50
56	002625	光启技术	165,200.00	2,441,656.00	0.49
57	002138	顺络电子	89,700.00	2,422,797.00	0.49
58	002739	万达电影	183,500.00	2,389,170.00	0.48
59	600497	驰宏锌锗	470,600.00	2,376,530.00	0.48
60	002078	太阳纸业	192,400.00	2,341,508.00	0.47
61	300394	天孚通信	25,500.00	2,333,760.00	0.47
62	002025	航天电器	48,292.00	2,318,981.84	0.47
63	300390	天华新能	91,400.00	2,316,990.00	0.47
64	002152	广电运通	187,200.00	2,295,072.00	0.46
65	300866	安克创新	25,900.00	2,294,740.00	0.46
66	600959	江苏有线	707,300.00	2,220,922.00	0.45
67	002223	鱼跃医疗	64,200.00	2,220,036.00	0.45
68	600500	中化国际	500,400.00	2,211,768.00	0.44
69	603688	石英股份	25,171.00	2,186,856.48	0.44
70	688234	天岳先进	33,046.00	2,183,349.22	0.44
71	300776	帝尔激光	36,100.00	2,175,386.00	0.44
72	300073	当升科技	56,891.00	2,173,236.20	0.44
73	600529	山东药玻	84,400.00	2,160,640.00	0.43
74	002683	广东宏大	107,600.00	2,160,608.00	0.43
75	002422	科伦药业	74,300.00	2,158,415.00	0.43
76	002128	电投能源	149,800.00	2,137,646.00	0.43
77	000728	国元证券	312,400.00	2,133,692.00	0.43
78	600737	中粮糖业	258,500.00	2,130,040.00	0.43
79	600258	首旅酒店	135,316.00	2,113,635.92	0.43
80	603317	天味食品	155,800.00	2,070,582.00	0.42
81	000738	航发控制	104,000.00	2,069,600.00	0.42
82	603225	新凤鸣	145,700.00	2,068,940.00	0.42
83	601611	中国核建	297,200.00	2,059,596.00	0.41
84	601665	齐鲁银行	520,995.00	2,037,090.45	0.41
85	000729	燕京啤酒	235,804.00	2,034,988.52	0.41
86	603568	伟明环保	122,900.00	1,966,400.00	0.40
87	002056	横店东磁	145,200.00	1,966,008.00	0.40
88	688002	睿创微纳	44,318.00	1,959,741.96	0.39

89	600968	海油发展	683,000.00	1,946,550.00	0.39
90	002608	江苏国信	291,200.00	1,913,184.00	0.38
91	688188	柏楚电子	7,554.00	1,911,992.94	0.38
92	300001	特锐德	93,700.00	1,883,370.00	0.38
93	603456	九洲药业	74,000.00	1,791,540.00	0.36
94	600066	宇通客车	134,800.00	1,786,100.00	0.36
95	300009	安科生物	174,100.00	1,779,302.00	0.36
96	601168	西部矿业	121,100.00	1,728,097.00	0.35
97	600566	济川药业	54,200.00	1,703,506.00	0.34
98	600060	海信视像	78,700.00	1,644,830.00	0.33
99	600418	江淮汽车	99,600.00	1,608,540.00	0.32
100	603650	彤程新材	47,100.00	1,568,430.00	0.32
101	002595	豪迈科技	51,100.00	1,521,247.00	0.31
102	002429	兆驰股份	271,000.00	1,512,180.00	0.30
103	300118	东方日升	84,200.00	1,486,130.00	0.30
104	000878	云南铜业	134,900.00	1,469,061.00	0.30
105	000423	东阿阿胶	29,600.00	1,459,872.00	0.29
106	300207	欣旺达	95,700.00	1,412,532.00	0.28
107	601958	金铂股份	147,600.00	1,394,820.00	0.28
108	002568	百润股份	55,900.00	1,375,699.00	0.28
109	688208	道通科技	55,216.00	1,311,380.00	0.26
110	601966	玲珑轮胎	67,600.00	1,299,948.00	0.26
111	002557	洽洽食品	37,100.00	1,291,822.00	0.26
112	688029	南微医学	12,781.00	1,237,200.80	0.25
113	600867	通化东宝	114,200.00	1,236,786.00	0.25
114	600096	云天化	70,800.00	1,104,480.00	0.22
115	000785	居然之家	333,700.00	1,101,210.00	0.22
116	603786	科博达	15,300.00	1,091,808.00	0.22
117	688006	杭可科技	46,227.00	1,085,409.96	0.22
118	601187	厦门银行	213,700.00	1,083,459.00	0.22
119	300861	美畅股份	32,200.00	1,071,938.00	0.22
120	600398	海澜之家	139,700.00	1,036,574.00	0.21
121	002791	坚朗五金	25,000.00	1,012,250.00	0.20
122	688772	珠海冠宇	44,115.00	970,971.15	0.20
123	688516	奥特维	10,697.00	968,078.50	0.19
124	001914	招商积余	79,700.00	953,212.00	0.19
125	601231	环旭电子	63,000.00	951,930.00	0.19
126	603816	顾家家居	25,959.00	908,565.00	0.18
127	600906	财达证券	114,900.00	861,750.00	0.17
128	002518	科士达	28,200.00	778,320.00	0.16
129	000959	首钢股份	223,400.00	772,964.00	0.16
130	300487	蓝晓科技	14,100.00	748,146.00	0.15
131	002939	长城证券	74,000.00	592,000.00	0.12
132	002439	启明星辰	21,800.00	588,600.00	0.12

133	002867	周大生	32,550.00	494,109.00	0.10
134	000750	国海证券	139,200.00	492,768.00	0.10
135	300251	光线传媒	55,300.00	450,695.00	0.09
136	600517	国网英大	73,800.00	352,026.00	0.07
137	300296	利亚德	55,000.00	330,000.00	0.07
138	002558	巨人网络	29,200.00	325,288.00	0.07
139	000709	河钢股份	147,400.00	313,962.00	0.06
140	000623	吉林敖东	20,700.00	313,398.00	0.06
141	002266	浙富控股	91,900.00	312,460.00	0.06
142	002153	石基信息	32,000.00	311,680.00	0.06
143	600339	中油工程	102,400.00	310,272.00	0.06
144	600208	新潮中宝	140,900.00	305,753.00	0.06
145	601992	金隅集团	158,400.00	302,544.00	0.06
146	601108	财通证券	38,600.00	299,536.00	0.06
147	600170	上海建工	126,900.00	296,946.00	0.06
148	688297	中无人机	7,200.00	275,976.00	0.06
149	601555	东吴证券	33,800.00	247,078.00	0.05
150	002273	水晶光电	12,600.00	170,604.00	0.03
151	002865	钧达股份	2,200.00	170,456.00	0.03
152	300357	我武生物	5,700.00	165,300.00	0.03
153	601666	平煤股份	13,200.00	152,592.00	0.03
154	002423	中粮资本	6,400.00	42,752.00	0.01
155	000967	盈峰环境	8,800.00	41,800.00	0.01
156	002506	协鑫集成	15,100.00	41,374.00	0.01
157	600549	厦门钨业	2,400.00	41,232.00	0.01
158	600415	小商品城	5,600.00	40,992.00	0.01
159	600315	上海家化	1,900.00	40,242.00	0.01
160	601162	天风证券	12,964.00	40,058.76	0.01
161	600008	首创环保	14,790.00	39,785.10	0.01
162	600177	雅戈尔	6,052.00	39,640.60	0.01
163	603077	和邦生物	16,700.00	39,412.00	0.01
164	300682	朗新集团	2,400.00	39,336.00	0.01
165	600166	福田汽车	14,400.00	39,312.00	0.01
166	002958	青农商行	15,000.00	39,300.00	0.01
167	600928	西安银行	11,800.00	39,294.00	0.01
168	001227	兰州银行	15,100.00	39,260.00	0.01
169	601991	大唐发电	16,200.00	39,204.00	0.01
170	002936	郑州银行	19,500.00	39,195.00	0.01
171	000898	鞍钢股份	15,700.00	39,093.00	0.01
172	600704	物产中大	8,800.00	38,984.00	0.01
173	601106	中国一重	13,500.00	38,880.00	0.01
174	002131	利欧股份	16,800.00	38,304.00	0.01
175	601933	永辉超市	13,500.00	38,070.00	0.01
176	603056	德邦股份	2,400.00	34,728.00	0.01

## 8.3.2 期末积极投资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	600727	鲁北化工	103,900.00	683,662.00	0.14
2	300929	华骐环保	54,300.00	660,831.00	0.13
3	300259	新天科技	181,800.00	659,934.00	0.13
4	300214	日科化学	69,400.00	451,100.00	0.09
5	603530	神马电力	21,600.00	447,984.00	0.09
6	603315	福鞍股份	27,200.00	395,216.00	0.08
7	688127	蓝特光学	16,800.00	391,272.00	0.08
8	002225	濮耐股份	102,600.00	387,828.00	0.08
9	002062	宏润建设	86,900.00	384,967.00	0.08
10	600795	国电电力	90,800.00	377,728.00	0.08
11	300388	节能国祯	58,400.00	375,512.00	0.08
12	300841	康华生物	4,800.00	372,192.00	0.07
13	601700	风范股份	73,600.00	368,736.00	0.07
14	603339	四方科技	30,600.00	363,834.00	0.07
15	603500	祥和实业	29,600.00	362,600.00	0.07
16	300877	金春股份	20,900.00	361,779.00	0.07
17	601002	晋亿实业	74,200.00	359,128.00	0.07
18	600433	冠豪高新	103,600.00	358,456.00	0.07
19	300385	雪浪环境	53,300.00	358,176.00	0.07
20	002360	同德化工	48,800.00	356,240.00	0.07
21	002218	拓日新能	78,400.00	353,584.00	0.07
22	300932	三友联众	21,600.00	351,648.00	0.07
23	301098	金埔园林	29,600.00	349,576.00	0.07
24	603323	苏农银行	84,000.00	349,440.00	0.07
25	603611	诺力股份	18,400.00	348,312.00	0.07
26	600639	浦东金桥	34,400.00	347,784.00	0.07
27	603111	康尼机电	62,400.00	347,568.00	0.07
28	600722	金牛化工	69,600.00	347,304.00	0.07
29	002811	郑中设计	35,200.00	346,720.00	0.07
30	601288	农业银行	95,200.00	346,528.00	0.07
31	000910	大亚圣象	43,200.00	345,600.00	0.07
32	601512	中新集团	44,700.00	344,637.00	0.07
33	603359	东珠生态	44,800.00	344,064.00	0.07
34	600094	大名城	114,400.00	343,200.00	0.07
35	000639	西王食品	77,600.00	342,992.00	0.07
36	002334	英威腾	39,200.00	342,216.00	0.07
37	688669	聚石化学	18,256.00	342,117.44	0.07
38	601200	上海环境	38,000.00	341,620.00	0.07

39	688275	万润新能	5,526.00	340,788.42	0.07
40	601366	利群股份	62,400.00	340,704.00	0.07
41	301216	万凯新材	24,000.00	339,120.00	0.07
42	002158	汉钟精机	15,200.00	338,352.00	0.07
43	603151	邦基科技	22,400.00	338,016.00	0.07
44	001230	劲旅环境	14,400.00	337,824.00	0.07
45	300234	开尔新材	64,800.00	337,608.00	0.07
46	600650	锦江在线	35,200.00	336,864.00	0.07
47	002047	宝鹰股份	116,000.00	335,240.00	0.07
48	600897	厦门空港	26,800.00	334,732.00	0.07
49	000791	甘肃能源	60,000.00	334,200.00	0.07
50	300407	凯发电气	35,300.00	333,232.00	0.07
51	600860	京城股份	24,800.00	332,072.00	0.07
52	600774	汉商集团	33,600.00	331,296.00	0.07
53	688420	美腾科技	12,800.00	330,752.00	0.07
54	002519	银河电子	53,600.00	330,712.00	0.07
55	601827	三峰环境	44,000.00	330,440.00	0.07
56	601718	际华集团	116,000.00	329,440.00	0.07
57	600163	中闽能源	75,200.00	328,624.00	0.07
58	002583	海能达	55,200.00	328,440.00	0.07
59	000727	冠捷科技	122,400.00	328,032.00	0.07
60	002747	埃斯顿	17,600.00	327,184.00	0.07
61	603989	艾华集团	15,200.00	327,104.00	0.07
62	600590	泰豪科技	48,900.00	326,652.00	0.07
63	300899	上海凯鑫	12,000.00	326,160.00	0.07
64	300237	美晨生态	152,400.00	326,136.00	0.07
65	003039	顺控发展	21,500.00	325,940.00	0.07
66	600664	哈药股份	96,800.00	324,280.00	0.07
67	003025	思进智能	24,000.00	324,240.00	0.07
68	603067	振华股份	31,800.00	324,042.00	0.07
69	002379	宏创控股	71,200.00	323,248.00	0.07
70	605277	新亚电子	21,600.00	322,704.00	0.06
71	600477	杭萧钢构	98,050.00	322,584.50	0.06
72	300213	佳讯飞鸿	44,800.00	322,560.00	0.06
73	300004	南风股份	52,000.00	321,360.00	0.06
74	600420	国药现代	32,800.00	321,112.00	0.06
75	603828	柯利达	84,000.00	320,880.00	0.06
76	002681	奋达科技	64,800.00	320,760.00	0.06
77	688257	新锐股份	12,800.00	320,512.00	0.06
78	002689	远大智能	72,000.00	320,400.00	0.06
79	688227	品高股份	16,800.00	320,376.00	0.06
80	000751	锌业股份	98,400.00	319,800.00	0.06
81	601388	怡球资源	121,900.00	319,378.00	0.06
82	300083	创世纪	50,400.00	319,032.00	0.06

83	688571	杭华股份	42,600.00	318,648.00	0.06
84	000862	银星能源	52,300.00	318,507.00	0.06
85	600688	上海石化	111,100.00	317,746.00	0.06
86	600169	太原重工	134,600.00	317,656.00	0.06
87	300185	通裕重工	132,300.00	317,520.00	0.06
88	002909	集泰股份	41,600.00	317,408.00	0.06
89	000159	国际实业	48,900.00	317,361.00	0.06
90	600503	华丽家族	124,400.00	317,220.00	0.06
91	600172	黄河旋风	84,800.00	317,152.00	0.06
92	000592	平潭发展	125,300.00	317,009.00	0.06
93	301088	戎美股份	20,800.00	316,784.00	0.06
94	002361	神剑股份	80,600.00	316,758.00	0.06
95	000069	华侨城 A	101,800.00	316,598.00	0.06
96	600297	广汇汽车	184,000.00	316,480.00	0.06
97	002175	东方智造	113,600.00	315,808.00	0.06
98	002242	九阳股份	24,800.00	315,208.00	0.06
99	002953	日丰股份	24,800.00	314,960.00	0.06
100	600033	福建高速	101,600.00	314,960.00	0.06
101	002630	华西能源	126,900.00	314,712.00	0.06
102	001222	源飞宠物	21,400.00	314,580.00	0.06
103	000538	云南白药	6,400.00	314,560.00	0.06
104	600740	山西焦化	62,400.00	314,496.00	0.06
105	000928	中钢国际	53,900.00	314,237.00	0.06
106	603301	振德医疗	12,800.00	313,600.00	0.06
107	000982	中银绒业	213,000.00	313,110.00	0.06
108	002310	东方园林	162,200.00	313,046.00	0.06
109	002210	飞马国际	174,700.00	312,713.00	0.06
110	002668	奥马电器	47,200.00	311,992.00	0.06
111	601860	紫金银行	123,300.00	311,949.00	0.06
112	301246	宏源药业	12,000.00	311,760.00	0.06
113	601333	广深铁路	120,300.00	311,577.00	0.06
114	000417	合肥百货	62,400.00	311,376.00	0.06
115	603527	众源新材	28,800.00	311,328.00	0.06
116	688184	帕瓦股份	15,993.00	311,223.78	0.06
117	600694	大商股份	18,400.00	310,776.00	0.06
118	002622	皓宸医疗	95,000.00	310,650.00	0.06
119	000882	华联股份	184,800.00	310,464.00	0.06
120	600815	厦工股份	115,200.00	309,888.00	0.06
121	000552	甘肃能化	101,600.00	309,880.00	0.06
122	300353	东土科技	32,000.00	309,760.00	0.06
123	600512	腾达建设	124,900.00	309,752.00	0.06
124	300422	博世科	51,700.00	309,683.00	0.06
125	600527	江南高纤	158,700.00	309,465.00	0.06
126	002663	普邦股份	170,900.00	309,329.00	0.06



127	601005	重庆钢铁	222,500.00	309,275.00	0.06
128	000826	启迪环境	108,100.00	309,166.00	0.06
129	002394	联发股份	37,200.00	309,132.00	0.06
130	600962	国投中鲁	25,600.00	308,480.00	0.06
131	000517	荣安地产	125,600.00	307,720.00	0.06
132	300247	融捷健康	86,400.00	307,584.00	0.06
133	600496	精工钢构	100,800.00	307,440.00	0.06
134	600653	申华控股	166,100.00	307,285.00	0.06
135	002426	胜利精密	131,300.00	307,242.00	0.06
136	600370	三房巷	126,900.00	307,098.00	0.06
137	300647	超频三	47,700.00	306,234.00	0.06
138	600322	津投城开	142,400.00	306,160.00	0.06
139	603195	公牛集团	3,200.00	306,080.00	0.06
140	600307	酒钢宏兴	204,900.00	305,301.00	0.06
141	600120	浙江东方	85,025.00	305,239.75	0.06
142	002219	新里程	100,700.00	305,121.00	0.06
143	300197	节能铁汉	147,400.00	305,118.00	0.06
144	300692	中环环保	49,200.00	305,040.00	0.06
145	000008	神州高铁	129,000.00	304,440.00	0.06
146	002133	广宇集团	87,200.00	304,328.00	0.06
147	000560	我爱我家	135,200.00	304,200.00	0.06
148	600219	南山铝业	103,400.00	303,996.00	0.06
149	600162	香江控股	174,200.00	303,108.00	0.06
150	600628	新世界	43,200.00	302,832.00	0.06
151	000720	新能泰山	72,900.00	301,806.00	0.06
152	002321	华英农业	126,800.00	301,784.00	0.06
153	600751	海航科技	114,700.00	300,514.00	0.06
154	300425	中建环能	64,200.00	300,456.00	0.06
155	002076	星光股份	134,700.00	300,381.00	0.06
156	000897	津滨发展	138,600.00	299,376.00	0.06
157	600400	红豆股份	106,800.00	297,972.00	0.06
158	600567	山鹰国际	153,500.00	297,790.00	0.06
159	002226	江南化工	67,900.00	297,402.00	0.06
160	300910	瑞丰新材	6,400.00	294,016.00	0.06
161	600533	栖霞建设	99,200.00	290,656.00	0.06
162	300266	兴源环境	106,800.00	288,360.00	0.06
163	688226	威腾电气	15,200.00	285,760.00	0.06
164	002165	红宝丽	67,200.00	284,256.00	0.06
165	603053	成都燃气	25,600.00	262,144.00	0.05
166	688485	九州一轨	18,400.00	257,232.00	0.05
167	603458	勘设股份	29,600.00	255,448.00	0.05
168	688017	绿的谐波	1,600.00	245,600.00	0.05
169	300876	蒙泰高新	9,600.00	240,192.00	0.05
170	601218	吉鑫科技	59,000.00	236,000.00	0.05

171	300946	恒而达	7,200.00	232,344.00	0.05
172	002911	佛燃能源	20,000.00	229,200.00	0.05
173	002333	罗普斯金	34,400.00	224,632.00	0.05
174	605058	澳弘电子	9,600.00	219,936.00	0.04
175	300935	盈建科	8,000.00	219,280.00	0.04
176	600262	北方股份	11,200.00	215,600.00	0.04
177	301027	华蓝集团	16,800.00	210,168.00	0.04
178	301206	三元生物	7,200.00	207,936.00	0.04
179	301309	万得凯	7,200.00	201,240.00	0.04
180	605183	确成股份	13,600.00	198,968.00	0.04
181	000819	岳阳兴长	10,400.00	188,032.00	0.04
182	688178	万德斯	10,400.00	188,032.00	0.04
183	002634	棒杰股份	25,600.00	183,296.00	0.04
184	603988	中电电机	16,000.00	181,920.00	0.04
185	300810	中科海讯	8,800.00	179,520.00	0.04
186	603797	联泰环保	31,900.00	176,088.00	0.04
187	688100	威胜信息	5,600.00	161,952.00	0.03
188	688360	德马科技	8,000.00	160,560.00	0.03
189	000782	美达股份	28,000.00	153,720.00	0.03
190	688499	利元亨	4,000.00	152,320.00	0.03
191	301012	扬电科技	7,200.00	145,440.00	0.03
192	300409	道氏技术	12,800.00	142,592.00	0.03
193	002441	众业达	14,700.00	139,209.00	0.03
194	688459	哈铁科技	13,600.00	127,296.00	0.03
195	300943	春晖智控	8,800.00	126,192.00	0.03
196	301223	中荣股份	6,400.00	115,968.00	0.02
197	301037	保立佳	5,600.00	111,608.00	0.02
198	003038	鑫铂股份	3,200.00	109,920.00	0.02
199	301043	绿岛风	3,200.00	104,736.00	0.02
200	301135	瑞德智能	4,000.00	99,280.00	0.02
201	601607	上海医药	5,600.00	93,688.00	0.02
202	603897	长城科技	4,500.00	92,160.00	0.02
203	301226	祥明智能	4,000.00	91,320.00	0.02
204	002798	帝欧家居	13,900.00	91,045.00	0.02
205	600869	远东股份	19,600.00	86,044.00	0.02
206	603901	永创智能	7,200.00	85,680.00	0.02
207	300040	九洲集团	15,300.00	85,680.00	0.02
208	300550	和仁科技	5,700.00	85,443.00	0.02
209	603070	万控智造	5,300.00	85,118.00	0.02
210	605287	德才股份	5,000.00	84,850.00	0.02
211	600379	宝光股份	8,400.00	84,420.00	0.02
212	002498	汉缆股份	21,100.00	84,400.00	0.02
213	002661	克明食品	8,800.00	83,864.00	0.02
214	002084	海鸥住工	21,000.00	83,580.00	0.02

215	002303	美盈森	23,800.00	83,538.00	0.02
216	301196	唯科科技	2,400.00	82,512.00	0.02
217	002116	中国海诚	8,000.00	82,320.00	0.02
218	603818	曲美家居	15,200.00	82,080.00	0.02
219	300839	博汇股份	8,000.00	81,840.00	0.02
220	300187	永清环保	15,200.00	81,776.00	0.02
221	600217	中再资环	18,500.00	81,030.00	0.02
222	688121	卓然股份	4,000.00	80,920.00	0.02
223	000927	中国铁物	30,200.00	80,634.00	0.02
224	301279	金道科技	3,200.00	79,328.00	0.02
225	300848	美瑞新材	4,000.00	76,520.00	0.02
226	688398	赛特新材	2,400.00	75,840.00	0.02
227	001216	华瓷股份	5,800.00	75,690.00	0.02
228	000428	华天酒店	16,800.00	68,544.00	0.01
229	688117	圣诺生物	2,400.00	67,680.00	0.01
230	301290	东星医疗	2,400.00	66,216.00	0.01
231	688139	海尔生物	1,600.00	64,832.00	0.01
232	600116	三峡水利	8,000.00	60,240.00	0.01
233	301388	欣灵电气	2,400.00	58,536.00	0.01
234	000726	鲁泰 A	8,000.00	51,840.00	0.01
235	300141	和顺电气	4,700.00	49,068.00	0.01
236	300278	华昌达	12,800.00	48,896.00	0.01
237	603237	五芳斋	1,600.00	46,880.00	0.01
238	601616	广电电气	12,800.00	46,464.00	0.01
239	603333	尚纬股份	8,100.00	46,251.00	0.01
240	688038	中科通达	3,200.00	46,112.00	0.01
241	688330	宏力达	1,600.00	45,456.00	0.01
242	688057	金达莱	3,200.00	45,312.00	0.01
243	002160	常铝股份	10,800.00	45,252.00	0.01
244	002645	华宏科技	4,000.00	45,200.00	0.01
245	601838	成都银行	4,000.00	45,040.00	0.01
246	300062	中能电气	7,200.00	44,856.00	0.01
247	300411	金盾股份	6,400.00	44,736.00	0.01
248	601369	陕鼓动力	5,600.00	44,688.00	0.01
249	300323	华灿光电	6,100.00	44,652.00	0.01
250	600268	国电南自	6,400.00	44,608.00	0.01
251	688586	江航装备	4,000.00	44,360.00	0.01
252	002088	鲁阳节能	3,100.00	44,175.00	0.01
253	605006	山东玻纤	6,400.00	44,160.00	0.01
254	000803	山高环能	7,600.00	44,156.00	0.01
255	605066	天正电气	4,800.00	44,064.00	0.01
256	300018	中元股份	7,200.00	43,992.00	0.01
257	300670	大烨智能	5,600.00	43,848.00	0.01
258	603217	元利科技	2,400.00	43,776.00	0.01

259	002469	三维化学	7,200.00	43,632.00	0.01
260	688251	井松智能	1,500.00	43,620.00	0.01
261	002163	海南发展	4,800.00	43,584.00	0.01
262	002124	天邦食品	12,000.00	43,560.00	0.01
263	603058	永吉股份	4,800.00	43,536.00	0.01
264	600526	菲达环保	8,800.00	43,472.00	0.01
265	603680	今创集团	4,600.00	43,470.00	0.01
266	301006	迈拓股份	2,400.00	43,464.00	0.01
267	301109	军信股份	2,750.00	43,450.00	0.01
268	605138	盛泰集团	5,600.00	43,400.00	0.01
269	688186	广大特材	2,400.00	43,248.00	0.01
270	002350	北京科锐	6,400.00	43,200.00	0.01
271	600230	沧州大化	3,200.00	43,104.00	0.01
272	688101	三达膜	3,200.00	43,072.00	0.01
273	002743	富煌钢构	7,200.00	43,056.00	0.01
274	000973	佛塑科技	8,800.00	43,032.00	0.01
275	000016	深康佳 A	10,300.00	42,951.00	0.01
276	002637	赞宇科技	4,000.00	42,920.00	0.01
277	600371	万向德农	4,000.00	42,920.00	0.01
278	301526	国际复材	8,147.00	42,853.22	0.01
279	300554	三超新材	1,600.00	42,800.00	0.01
280	300635	中达安	3,400.00	42,772.00	0.01
281	003816	中国广核	13,700.00	42,607.00	0.01
282	003018	金富科技	4,000.00	42,600.00	0.01
283	301359	东南电子	1,600.00	42,576.00	0.01
284	000100	TCL 科技	9,900.00	42,570.00	0.01
285	605158	华达新材	5,600.00	42,560.00	0.01
286	603012	创力集团	7,200.00	42,552.00	0.01
287	600982	宁波能源	10,400.00	42,536.00	0.01
288	002392	北京利尔	11,200.00	42,336.00	0.01
289	600717	天津港	10,300.00	42,333.00	0.01
290	002320	海峡股份	7,200.00	41,976.00	0.01
291	002479	富春环保	8,800.00	41,976.00	0.01
292	002398	垒知集团	8,800.00	41,976.00	0.01
293	300481	濮阳惠成	2,400.00	41,880.00	0.01
294	688098	申联生物	5,588.00	41,798.24	0.01
295	001360	南矿集团	2,400.00	41,736.00	0.01
296	002048	宁波华翔	3,200.00	41,632.00	0.01
297	603577	汇金通	4,000.00	41,600.00	0.01
298	600979	广安爱众	12,000.00	41,520.00	0.01
299	301179	泽宇智能	1,600.00	41,520.00	0.01
300	600308	华泰股份	12,000.00	41,520.00	0.01
301	002431	棕榈股份	16,300.00	41,402.00	0.01
302	600210	紫江企业	8,800.00	41,360.00	0.01

303	301020	密封科技	1,900.00	41,287.00	0.01
304	002255	海陆重工	7,800.00	41,262.00	0.01
305	300667	必创科技	2,400.00	41,184.00	0.01
306	600894	广日股份	5,600.00	41,160.00	0.01
307	002027	分众传媒	6,500.00	41,080.00	0.01
308	002672	东江环保	8,000.00	41,040.00	0.01
309	688597	煜邦电力	4,500.00	40,950.00	0.01
310	000685	中山公用	5,600.00	40,936.00	0.01
311	600502	安徽建工	8,800.00	40,920.00	0.01
312	688511	天微电子	1,300.00	40,911.00	0.01
313	002358	森源电气	9,400.00	40,890.00	0.01
314	603817	海峡环保	6,400.00	40,832.00	0.01
315	002063	远光软件	6,600.00	40,788.00	0.01
316	600152	维科技术	5,600.00	40,768.00	0.01
317	300963	中洲特材	3,100.00	40,672.00	0.01
318	000498	山东路桥	7,200.00	40,608.00	0.01
319	002546	新联电子	8,100.00	40,500.00	0.01
320	000090	天健集团	8,800.00	40,480.00	0.01
321	000036	华联控股	10,400.00	40,456.00	0.01
322	600063	皖维高新	9,400.00	40,420.00	0.01
323	300484	蓝海华腾	3,200.00	40,416.00	0.01
324	300515	三德科技	3,500.00	40,390.00	0.01
325	002763	汇洁股份	4,800.00	40,368.00	0.01
326	688009	中国通号	9,200.00	40,296.00	0.01
327	002641	公元股份	8,000.00	40,240.00	0.01
328	603698	航天工程	2,800.00	40,236.00	0.01
329	300437	清水源	3,200.00	40,224.00	0.01
330	300771	智莱科技	3,700.00	40,219.00	0.01
331	688011	新光光电	1,700.00	40,205.00	0.01
332	002574	明牌珠宝	6,700.00	40,200.00	0.01
333	300231	银信科技	3,900.00	40,131.00	0.01
334	300500	启迪设计	2,800.00	40,124.00	0.01
335	300599	雄塑科技	5,000.00	40,100.00	0.01
336	688403	汇成股份	3,800.00	40,090.00	0.01
337	002014	永新股份	4,800.00	40,080.00	0.01
338	600198	大唐电信	6,100.00	40,077.00	0.01
339	600207	安彩高科	8,400.00	40,068.00	0.01
340	300641	正丹股份	7,100.00	40,044.00	0.01
341	688030	山石网科	2,000.00	40,040.00	0.01
342	603758	秦安股份	3,500.00	40,040.00	0.01
343	000737	北方铜业	6,900.00	40,020.00	0.01
344	601956	东贝集团	6,700.00	39,999.00	0.01
345	601678	滨化股份	9,500.00	39,995.00	0.01
346	300154	瑞凌股份	5,400.00	39,960.00	0.01

347	600874	创业环保	7,200.00	39,960.00	0.01
348	301209	联合化学	1,600.00	39,936.00	0.01
349	000913	钱江摩托	3,200.00	39,904.00	0.01
350	000753	漳州发展	9,500.00	39,900.00	0.01
351	300384	三联虹普	2,500.00	39,900.00	0.01
352	600236	桂冠电力	7,200.00	39,888.00	0.01
353	601375	中原证券	10,400.00	39,832.00	0.01
354	002301	齐心集团	5,600.00	39,816.00	0.01
355	002807	江阴银行	11,200.00	39,760.00	0.01
356	300665	飞鹿股份	4,600.00	39,744.00	0.01
357	600483	福能股份	4,800.00	39,696.00	0.01
358	603980	吉华集团	8,500.00	39,695.00	0.01
359	000545	金浦钛业	13,100.00	39,693.00	0.01
360	688350	富淼科技	2,400.00	39,672.00	0.01
361	002539	云图控股	4,800.00	39,600.00	0.01
362	300370	安控科技	15,900.00	39,591.00	0.01
363	603176	汇通集团	6,400.00	39,552.00	0.01
364	601619	嘉泽新能	11,200.00	39,536.00	0.01
365	002489	浙江永强	13,000.00	39,520.00	0.01
366	300305	裕兴股份	4,000.00	39,520.00	0.01
367	600320	振华重工	11,900.00	39,508.00	0.01
368	301256	华融化学	4,800.00	39,504.00	0.01
369	002434	万里扬	5,300.00	39,485.00	0.01
370	002081	金螳螂	10,500.00	39,480.00	0.01
371	605001	威奥股份	5,900.00	39,471.00	0.01
372	600269	赣粤高速	9,600.00	39,456.00	0.01
373	601766	中国中车	7,500.00	39,450.00	0.01
374	601818	光大银行	13,600.00	39,440.00	0.01
375	600103	青山纸业	16,500.00	39,435.00	0.01
376	000622	恒立实业	9,000.00	39,420.00	0.01
377	600248	陕建股份	9,800.00	39,396.00	0.01
378	300289	利德曼	6,400.00	39,360.00	0.01
379	002524	光正眼科	6,100.00	39,345.00	0.01
380	603227	雪峰科技	5,700.00	39,330.00	0.01
381	601868	中国能建	18,700.00	39,270.00	0.01
382	603214	爱婴室	2,400.00	39,264.00	0.01
383	300110	华仁药业	9,300.00	39,246.00	0.01
384	002478	常宝股份	7,200.00	39,240.00	0.01
385	300284	苏交科	7,200.00	39,240.00	0.01
386	600098	广州发展	7,300.00	39,201.00	0.01
387	600108	亚盛集团	14,100.00	39,198.00	0.01
388	000488	晨鸣纸业	10,100.00	39,188.00	0.01
389	300447	全信股份	2,700.00	39,150.00	0.01
390	300053	航宇微	3,200.00	39,136.00	0.01

391	002871	伟隆股份	3,500.00	39,130.00	0.01
392	002248	华东数控	4,800.00	39,120.00	0.01
393	301332	德尔玛	3,200.00	39,104.00	0.01
394	600606	绿地控股	17,000.00	39,100.00	0.01
395	000949	新乡化纤	12,100.00	39,083.00	0.01
396	002948	青岛银行	12,800.00	39,040.00	0.01
397	600540	新赛股份	8,000.00	39,040.00	0.01
398	002102	冠福股份	14,400.00	39,024.00	0.01
399	002644	佛慈制药	4,000.00	39,000.00	0.01
400	002467	二六三	8,400.00	38,976.00	0.01
401	300328	宜安科技	5,600.00	38,976.00	0.01
402	601963	重庆银行	5,600.00	38,976.00	0.01
403	300882	万胜智能	1,600.00	38,976.00	0.01
404	002715	登云股份	2,400.00	38,952.00	0.01
405	301265	华新环保	3,800.00	38,950.00	0.01
406	002628	成都路桥	11,800.00	38,940.00	0.01
407	300420	五洋停车	12,800.00	38,912.00	0.01
408	600067	冠城大通	15,500.00	38,905.00	0.01
409	300190	维尔利	9,300.00	38,874.00	0.01
410	002109	兴化股份	8,200.00	38,868.00	0.01
411	600718	东软集团	4,200.00	38,850.00	0.01
412	000900	现代投资	9,900.00	38,808.00	0.01
413	600017	日照港	14,100.00	38,775.00	0.01
414	600581	八一钢铁	10,800.00	38,772.00	0.01
415	600007	中国国贸	2,000.00	38,760.00	0.01
416	000852	石化机械	6,300.00	38,745.00	0.01
417	603166	福达股份	5,600.00	38,696.00	0.01
418	002404	嘉欣丝绸	6,400.00	38,656.00	0.01
419	600252	中恒集团	15,400.00	38,654.00	0.01
420	002421	达实智能	12,000.00	38,640.00	0.01
421	000869	张裕 A	1,600.00	38,624.00	0.01
422	002039	黔源电力	2,800.00	38,612.00	0.01
423	000836	富通信息	14,400.00	38,592.00	0.01
424	001338	永顺泰	3,200.00	38,592.00	0.01
425	600261	阳光照明	11,800.00	38,586.00	0.01
426	002264	新华都	7,000.00	38,570.00	0.01
427	300773	拉卡拉	2,400.00	38,496.00	0.01
428	002879	长缆科技	2,400.00	38,448.00	0.01
429	600662	外服控股	8,000.00	38,400.00	0.01
430	601588	北辰实业	20,200.00	38,380.00	0.01
431	000823	超声电子	4,000.00	38,280.00	0.01
432	000797	中国武夷	12,800.00	38,272.00	0.01
433	603929	亚翔集成	1,600.00	38,272.00	0.01
434	300143	盈康生命	3,600.00	38,268.00	0.01

435	688077	大地熊	1,600.00	38,160.00	0.01
436	002669	康达新材	3,200.00	38,144.00	0.01
437	301361	众智科技	1,600.00	38,144.00	0.01
438	600935	华塑股份	11,300.00	38,081.00	0.01
439	300021	大禹节水	8,000.00	38,080.00	0.01
440	600811	东方集团	19,100.00	38,009.00	0.01
441	600835	上海机电	3,200.00	37,984.00	0.01
442	688517	金冠电气	2,400.00	37,896.00	0.01
443	600708	光明地产	17,600.00	37,840.00	0.01
444	600231	凌钢股份	17,600.00	37,840.00	0.01
445	300561	汇金科技	3,200.00	37,760.00	0.01
446	601518	吉林高速	14,800.00	37,740.00	0.01
447	002491	通鼎互联	7,200.00	37,728.00	0.01
448	600758	辽宁能源	10,400.00	37,648.00	0.01
449	600881	亚泰集团	19,300.00	37,635.00	0.01
450	300103	达刚控股	5,900.00	37,465.00	0.01
451	000531	穗恒运 A	5,600.00	37,464.00	0.01
452	600035	楚天高速	9,800.00	37,436.00	0.01
453	002186	全聚德	3,200.00	37,312.00	0.01
454	600622	光大嘉宝	14,400.00	37,152.00	0.01
455	601068	中铝国际	8,000.00	36,960.00	0.01
456	300327	中颖电子	1,600.00	36,480.00	0.01
457	603018	华设集团	4,800.00	36,480.00	0.01
458	603330	天洋新材	4,800.00	36,384.00	0.01
459	600572	康恩贝	7,200.00	36,360.00	0.01
460	301355	南王科技	2,400.00	36,360.00	0.01
461	000885	城发环境	3,200.00	36,288.00	0.01
462	603681	永冠新材	2,400.00	36,240.00	0.01
463	300610	晨化股份	3,200.00	36,064.00	0.01
464	003037	三和管桩	3,200.00	35,776.00	0.01
465	002636	金安国纪	4,000.00	35,640.00	0.01
466	002277	友阿股份	8,800.00	35,464.00	0.01
467	001333	光华股份	1,600.00	35,424.00	0.01
468	600716	凤凰股份	9,600.00	35,328.00	0.01
469	301148	嘉戎技术	1,600.00	35,280.00	0.01
470	300410	正业科技	4,000.00	35,160.00	0.01
471	002973	侨银股份	3,200.00	35,104.00	0.01
472	301336	趣睡科技	800.00	35,032.00	0.01
473	300871	回盛生物	2,400.00	34,704.00	0.01
474	001218	丽臣实业	1,600.00	34,576.00	0.01
475	001313	粤海饲料	4,000.00	34,480.00	0.01
476	688323	瑞华泰	1,600.00	34,352.00	0.01
477	301335	天元宠物	1,600.00	34,240.00	0.01
478	301157	华塑科技	800.00	34,240.00	0.01



479	603360	百傲化学	3,200.00	33,824.00	0.01
480	002789	建艺集团	2,400.00	33,024.00	0.01
481	688069	德林海	1,600.00	31,808.00	0.01
482	300622	博士眼镜	1,600.00	31,728.00	0.01
483	688128	中国电研	1,529.00	31,375.08	0.01
484	688289	圣湘生物	1,600.00	31,280.00	0.01
485	603043	广州酒家	1,600.00	31,248.00	0.01
486	300852	四会富仕	800.00	30,832.00	0.01
487	301399	英特科技	800.00	30,616.00	0.01
488	605377	华旺科技	1,600.00	30,544.00	0.01
489	301200	大族数控	800.00	30,216.00	0.01
490	301156	美农生物	1,600.00	30,176.00	0.01
491	603416	信捷电气	800.00	30,048.00	0.01
492	301323	新莱福	800.00	29,592.00	0.01
493	300075	数字政通	1,600.00	28,160.00	0.01
494	300767	震安科技	1,600.00	27,808.00	0.01
495	301366	一博科技	800.00	26,696.00	0.01
496	001332	锡装股份	800.00	26,280.00	0.01
497	301446	福事特	800.00	25,176.00	0.01
498	300617	安靠智电	800.00	24,288.00	0.00
499	688652	京仪装备	416.00	23,736.96	0.00
500	301138	华研精机	800.00	23,200.00	0.00
501	601096	宏盛华源	3,918.00	20,491.14	0.00
502	301566	达利凯普	576.00	16,099.20	0.00
503	688702	盛科通信	289.00	13,926.91	0.00
504	301508	中机认检	419.00	13,512.75	0.00
505	688653	康希通信	648.00	12,221.28	0.00
506	301516	中远通	604.00	12,116.24	0.00
507	301413	安培龙	164.00	11,521.00	0.00
508	301550	斯菱股份	260.00	11,330.80	0.00
509	301251	威尔高	321.00	11,119.44	0.00
510	688719	爱科赛博	181.00	10,878.10	0.00
511	301568	思泰克	246.00	10,641.96	0.00
512	688716	中研股份	267.00	9,713.46	0.00
513	301517	陕西华达	185.00	9,601.50	0.00
514	301500	飞南资源	455.00	9,504.95	0.00
515	688720	艾森股份	165.00	9,489.15	0.00
516	301459	丰茂股份	208.00	9,251.84	0.00
517	601083	锦江航运	775.00	9,183.75	0.00
518	301555	惠柏新材	224.00	8,888.32	0.00
519	301578	辰奕智能	118.00	8,782.74	0.00
520	301489	思泉新材	128.00	8,674.56	0.00
521	301520	万邦医药	160.00	8,438.40	0.00
522	688657	浩辰软件	101.00	8,010.31	0.00

523	688648	中邮科技	303.00	7,547.73	0.00
524	301548	崇德科技	127.00	7,496.81	0.00
525	001378	德冠新材	205.00	7,459.95	0.00
526	603004	鼎龙科技	195.00	6,727.50	0.00
527	603107	上海汽配	292.00	6,412.32	0.00
528	002108	沧州明珠	1,500.00	6,165.00	0.00
529	603270	金帝股份	195.00	5,768.10	0.00
530	001306	夏厦精密	64.00	5,415.68	0.00
531	603062	麦加芯彩	90.00	5,356.80	0.00
532	001326	联域股份	99.00	5,122.26	0.00
533	001358	兴欣新材	87.00	4,026.36	0.00
534	603075	热威股份	170.00	3,964.40	0.00
535	603273	天元智能	178.00	3,640.10	0.00
536	603231	索宝蛋白	161.00	3,583.86	0.00
537	603373	安邦护卫	88.00	3,561.36	0.00
538	603276	恒兴新材	134.00	3,333.92	0.00
539	603967	中创物流	300.00	3,102.00	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	002867	周大生	23,177,459.50	4.98
2	002028	思源电气	21,815,687.98	4.69
3	601077	渝农商行	20,672,185.00	4.44
4	601298	青岛港	20,617,575.35	4.43
5	000012	南 玻 A	20,315,940.93	4.36
6	600968	海油发展	19,951,498.00	4.29
7	600655	豫园股份	19,372,918.61	4.16
8	000591	太阳能	18,388,679.00	3.95
9	601128	常熟银行	17,857,167.00	3.84
10	688390	固德威	17,774,838.69	3.82
11	603338	浙江鼎力	17,713,586.91	3.81
12	300296	利亚德	17,060,891.00	3.67
13	688777	中控技术	16,951,589.78	3.64
14	002384	东山精密	16,737,341.00	3.60
15	002152	广电运通	16,718,840.00	3.59
16	300390	天华新能	16,483,554.15	3.54
17	600863	内蒙华电	16,354,989.00	3.51
18	300861	美畅股份	16,250,498.20	3.49

19	001872	招商港口	16,182,426.51	3.48
20	600500	中化国际	16,015,973.63	3.44
21	601058	赛轮轮胎	15,714,511.00	3.38
22	000728	国元证券	15,678,216.00	3.37
23	603688	石英股份	15,296,778.13	3.29
24	000783	长江证券	15,282,281.00	3.28
25	300308	中际旭创	15,139,236.00	3.25
26	002595	豪迈科技	15,090,623.22	3.24
27	002563	森马服饰	14,683,444.81	3.15
28	000630	铜陵有色	14,662,399.00	3.15
29	600329	达仁堂	14,588,690.00	3.13
30	600161	天坛生物	14,580,088.11	3.13
31	300568	星源材质	14,497,369.81	3.11
32	300146	汤臣倍健	14,387,083.55	3.09
33	002966	苏州银行	14,216,247.50	3.05
34	600489	中金黄金	14,198,291.00	3.05
35	002025	航天电器	14,089,504.36	3.03
36	002340	格林美	14,035,906.00	3.02
37	601958	金铂股份	13,987,106.59	3.00
38	600377	宁沪高速	13,971,291.26	3.00
39	002223	鱼跃医疗	13,964,901.00	3.00
40	002081	金螳螂	13,877,177.00	2.98
41	688521	芯原股份	13,797,371.44	2.96
42	000997	新大陆	13,778,065.00	2.96
43	601162	天风证券	13,685,485.00	2.94
44	600970	中材国际	13,644,828.00	2.93
45	600985	淮北矿业	13,638,889.91	2.93
46	600517	国网英大	13,564,897.05	2.91
47	000739	普洛药业	13,497,094.21	2.90
48	002372	伟星新材	13,409,438.00	2.88
49	000988	华工科技	13,333,981.00	2.86
50	002683	广东宏大	13,195,884.00	2.84
51	000729	燕京啤酒	13,131,319.72	2.82
52	300866	安克创新	13,002,154.00	2.79
53	000513	丽珠集团	12,851,419.66	2.76
54	000563	陕国投 A	12,834,716.00	2.76
55	601168	西部矿业	12,741,156.00	2.74
56	600642	申能股份	12,643,712.00	2.72
57	600372	中航机载	12,399,660.78	2.66
58	603816	顾家家居	12,391,655.49	2.66
59	002422	科伦药业	12,357,815.00	2.65
60	600315	上海家化	12,348,629.00	2.65
61	601456	国联证券	12,313,825.00	2.65
62	000999	华润三九	12,161,317.00	2.61

63	600566	济川药业	12,071,603.40	2.59
64	600998	九州通	11,906,474.70	2.56
65	000987	越秀资本	11,887,252.67	2.55
66	600008	首创环保	11,845,507.30	2.54
67	601598	中国外运	11,797,886.00	2.53
68	000778	新兴铸管	11,770,324.00	2.53
69	600109	国金证券	11,767,925.77	2.53
70	600755	厦门国贸	11,582,617.00	2.49
71	600380	健康元	11,578,696.00	2.49
72	600271	航天信息	11,534,031.00	2.48
73	300724	捷佳伟创	11,502,196.85	2.47
74	600582	天地科技	11,429,621.00	2.46
75	002203	海亮股份	11,382,158.46	2.45
76	601577	长沙银行	11,266,852.00	2.42
77	600390	五矿资本	11,203,802.40	2.41
78	000932	华菱钢铁	11,143,458.00	2.39
79	688516	奥特维	11,061,507.14	2.38
80	601665	齐鲁银行	11,010,699.52	2.37
81	601016	节能风电	10,924,653.00	2.35
82	000060	中金岭南	10,893,984.00	2.34
83	600765	中航重机	10,602,970.80	2.28
84	000878	云南铜业	10,579,879.00	2.27
85	000598	兴蓉环境	10,388,543.00	2.23
86	600066	宇通客车	10,348,213.00	2.22
87	688169	石头科技	10,316,389.09	2.22
88	601717	郑煤机	10,262,630.00	2.20
89	000898	鞍钢股份	10,249,936.00	2.20
90	002739	万达电影	10,209,178.00	2.19
91	600529	山东药玻	10,125,024.00	2.18
92	002850	科达利	10,074,884.44	2.16
93	600166	福田汽车	10,074,425.00	2.16
94	600487	亨通光电	9,992,307.75	2.15
95	601555	东吴证券	9,808,078.00	2.11
96	600259	广晟有色	9,798,467.00	2.11
97	600901	江苏金租	9,526,586.80	2.05
98	600737	中粮糖业	9,501,160.00	2.04
99	002568	百润股份	9,467,547.00	2.03
100	002600	领益智造	9,432,877.00	2.03
101	002056	横店东磁	9,355,953.93	2.01
102	600497	驰宏锌锗	9,325,667.00	2.00

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	31,745,706.51	6.82
2	000012	南玻A	25,281,857.00	5.43
3	601298	青岛港	22,967,003.02	4.93
4	688777	中控技术	22,413,735.29	4.82
5	002867	周大生	22,339,570.02	4.80
6	002152	广电运通	22,072,993.00	4.74
7	300146	汤臣倍健	21,470,598.93	4.61
8	601128	常熟银行	21,272,646.64	4.57
9	600968	海油发展	20,761,526.00	4.46
10	002422	科伦药业	19,796,345.00	4.25
11	002028	思源电气	19,518,659.00	4.19
12	002384	东山精密	19,128,620.21	4.11
13	300296	利亚德	18,789,006.00	4.04
14	603338	浙江鼎力	18,714,590.00	4.02
15	600008	首创环保	17,848,500.00	3.83
16	601077	渝农商行	17,668,818.00	3.80
17	000988	华工科技	17,372,929.00	3.73
18	000878	云南铜业	16,767,843.94	3.60
19	300861	美畅股份	16,736,426.20	3.60
20	000999	华润三九	16,132,895.77	3.47
21	002966	苏州银行	15,832,928.60	3.40
22	002563	森马服饰	15,665,413.59	3.37
23	688390	固德威	15,598,261.10	3.35
24	300390	天华新能	15,593,597.40	3.35
25	688521	芯原股份	14,785,303.91	3.18
26	600329	达仁堂	14,677,760.00	3.15
27	000630	铜陵有色	14,646,519.00	3.15
28	600998	九州通	14,485,752.40	3.11
29	601162	天风证券	14,404,769.00	3.09
30	600655	豫园股份	14,357,860.85	3.08
31	600820	隧道股份	14,351,276.00	3.08
32	000728	国元证券	14,080,861.13	3.03
33	002595	豪迈科技	14,044,500.00	3.02
34	002372	伟星新材	13,981,149.00	3.00
35	600377	宁沪高速	13,936,875.48	2.99
36	600985	淮北矿业	13,865,062.25	2.98
37	300438	鹏辉能源	13,611,702.00	2.92
38	002831	裕同科技	13,574,641.54	2.92

39	000739	普洛药业	13,400,434.39	2.88
40	002340	格林美	13,225,428.00	2.84
41	600517	国网英大	13,130,009.82	2.82
42	002081	金螳螂	13,036,024.00	2.80
43	002497	雅化集团	12,939,866.98	2.78
44	600500	中化国际	12,930,646.80	2.78
45	600489	中金黄金	12,792,793.00	2.75
46	000513	丽珠集团	12,717,451.76	2.73
47	601058	赛轮轮胎	12,685,349.00	2.73
48	600161	天坛生物	12,675,722.14	2.72
49	000932	华菱钢铁	12,514,789.00	2.69
50	300136	信维通信	12,447,568.00	2.67
51	601456	国联证券	12,425,607.00	2.67
52	603345	安井食品	12,395,138.92	2.66
53	600109	国金证券	12,335,589.00	2.65
54	600970	中材国际	12,266,430.00	2.64
55	600580	卧龙电驱	12,120,281.36	2.60
56	600372	中航机载	12,062,467.61	2.59
57	002223	鱼跃医疗	11,975,100.00	2.57
58	601958	金钼股份	11,899,187.04	2.56
59	600060	海信视像	11,815,438.66	2.54
60	600901	江苏金租	11,810,463.00	2.54
61	601231	环旭电子	11,741,367.00	2.52
62	300866	安克创新	11,732,760.00	2.52
63	000729	燕京啤酒	11,714,234.61	2.52
64	300073	当升科技	11,659,954.00	2.51
65	600863	内蒙华电	11,651,524.00	2.50
66	600315	上海家化	11,615,894.00	2.50
67	300003	乐普医疗	11,579,484.73	2.49
68	002281	光迅科技	11,561,174.06	2.48
69	600160	巨化股份	11,542,466.25	2.48
70	002465	海格通信	11,450,086.68	2.46
71	601577	长沙银行	11,340,249.76	2.44
72	000598	兴蓉环境	11,322,448.40	2.43
73	600380	健康元	11,243,070.60	2.42
74	000591	太阳能	11,238,932.00	2.41
75	601699	潞安环能	11,235,984.52	2.41
76	002203	海亮股份	11,230,670.00	2.41
77	603688	石英股份	11,165,118.07	2.40
78	001872	招商港口	11,108,810.55	2.39
79	002690	美亚光电	11,070,679.00	2.38
80	000783	长江证券	10,966,390.00	2.36
81	600862	中航高科	10,931,872.24	2.35
82	300568	星源材质	10,900,943.70	2.34

83	603939	益丰药房	10,886,850.55	2.34
84	603456	九洲药业	10,871,900.09	2.34
85	002025	航天电器	10,867,876.00	2.33
86	000987	越秀资本	10,783,140.53	2.32
87	002244	滨江集团	10,770,747.18	2.31
88	601598	中国外运	10,715,538.00	2.30
89	603355	莱克电气	10,655,257.80	2.29
90	300832	新产业	10,526,297.90	2.26
91	600566	济川药业	10,368,827.80	2.23
92	603816	顾家家居	10,248,319.00	2.20
93	002625	光启技术	10,024,311.72	2.15
94	601717	郑煤机	9,947,331.46	2.14
95	000970	中科三环	9,902,431.40	2.13
96	002683	广东宏大	9,861,861.00	2.12
97	003035	南网能源	9,820,252.00	2.11
98	601168	西部矿业	9,805,241.98	2.11
99	600066	宇通客车	9,779,660.00	2.10
100	601555	东吴证券	9,756,285.00	2.10
101	000898	鞍钢股份	9,684,178.00	2.08
102	600529	山东药玻	9,679,929.60	2.08
103	600166	福田汽车	9,572,884.90	2.06
104	002463	沪电股份	9,569,475.00	2.06
105	002273	水晶光电	9,538,199.46	2.05
106	688516	奥特维	9,438,251.17	2.03
107	603444	吉比特	9,377,920.00	2.01
108	600259	广晟有色	9,347,153.00	2.01
109	600879	航天电子	9,334,692.00	2.01
110	600487	亨通光电	9,326,664.80	2.00
111	601611	中国核建	9,315,248.00	2.00

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,578,976,400.62
卖出股票收入（成交）总额	3,551,068,821.01

注：买入股票成本总额、卖出股票收入总额均按买卖成交金额（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

本基金本报告期末未持有债券。

**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**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

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。

**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**

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货，并主要投资于流动性好、交易活跃且与基金投资目标匹配的期货合约。本基金的股指期货套保策略主要用于实现两项投资目标：第一、在合适的交易价格上建立股指期货多头套保仓位，力争获得相对于目标指数的超额收益；第二、在基金组合管理中，将股指期货合约作为高效管理权益仓位的投资工具，力争降低权益仓位调整的交易成本。

**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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内收到公开谴责、处罚的投资决策说明**

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有受到监管部门立案调查；在报告编制日前一年内没有受到监管部门公开谴责或/及处罚。

**8.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明**

基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,468,631.60



2	应收清算款	145,392.46
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	398,774.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,012,798.22

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
申万菱信中证 500 指数增强 A	19,833	16,132.12	117,859,312.23	36.84%	202,089,010.13	63.16%

申万菱信中证 500 指数增强 C	10,593	3,546.70	1,650,680.86	4.39%	35,919,554.98	95.61%
合计	30,225	11,828.57	119,509,993.09	33.43%	238,008,565.11	66.57%

注：（1）机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

（2）若同一持有人同时持有多个类别基金份额，会存在持有人户数合计数小于各份额类别持有人户数总和的情形。

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	申万菱信中证 500 指数 增强 A	91,511.74	0.03%
	申万菱信中证 500 指数 增强 C	0.00	0.00%
	合计	91,511.74	0.03%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	申万菱信中证 500 指数 增强 A	-
	申万菱信中证 500 指数 增强 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信中证 500 指数 增强 A	0~10
	申万菱信中证 500 指数 增强 C	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万菱信中证 500 指数增强 A	申万菱信中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2016 年 4 月 21 日）基金份额总额	546,955,898.05	-
本报告期期初基金份额总额	258,841,679.52	55,117,848.64
本报告期基金总申购份额	127,956,997.31	24,689,681.94
减：本报告期基金总赎回份额	66,850,354.47	42,237,294.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	319,948,322.36	37,570,235.84

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、 本报告期内，经基金管理人股东会决议，同意公司董事由姜山先生变更为王慧晶女士。
- 2、 本报告期内，经基金管理人董事会决议，免去王伟先生公司总经理助理职务。
- 3、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人连续 5 年聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。本基金本年度应支付给所聘任的会计师事务所 5.3 万元人民币。

### 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

本报告期内基金管理人及其高级管理人员未受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及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源证券	2	1,674,691,494.05	23.50%	1,566,351.27	23.54%	-
长江证券	1	706,533,068.80	9.92%	662,722.06	9.96%	-
天风证券	2	407,669,509.84	5.72%	382,112.64	5.74%	-
东北证券	2	370,819,113.84	5.20%	344,707.55	5.18%	-
财通证券	2	326,837,196.58	4.59%	307,310.31	4.62%	-
中信建投证券	2	294,085,853.94	4.13%	274,328.04	4.12%	-
西部证券	2	273,757,750.13	3.84%	253,288.29	3.81%	-
东吴证券	1	271,338,060.37	3.81%	252,273.20	3.79%	-
兴业证券	1	250,750,468.97	3.52%	231,521.29	3.48%	-
国信证券	1	248,025,301.30	3.48%	229,331.01	3.45%	-
东方财富证券	2	196,065,634.40	2.75%	182,175.78	2.74%	-
民生证券	1	191,635,710.41	2.69%	178,334.46	2.68%	-
国投证券	1	174,525,610.01	2.45%	163,000.34	2.45%	-
德邦证券	1	170,252,712.86	2.39%	161,041.34	2.42%	新增
东兴证券	1	165,635,041.85	2.32%	155,017.82	2.33%	-
海通证券	2	163,794,768.88	2.30%	153,782.45	2.31%	-
西南证券	2	153,002,008.67	2.15%	143,420.41	2.15%	-
中泰证券	3	140,224,719.79	1.97%	130,576.79	1.96%	-
国金证券	2	100,936,402.43	1.42%	94,277.12	1.42%	-
信达证券	1	94,151,622.33	1.32%	86,813.06	1.30%	-
东方证券	1	93,443,885.66	1.31%	86,193.25	1.30%	-
方正证券	2	89,274,769.43	1.25%	84,448.21	1.27%	-
平安证券	1	89,047,360.18	1.25%	82,382.53	1.24%	-
浙商证券	1	75,966,115.52	1.07%	71,813.19	1.08%	新增
第一创业	1	73,635,165.52	1.03%	69,232.39	1.04%	-
长城证券	3	69,383,133.15	0.97%	65,628.16	0.99%	-
广发证券	1	68,688,415.73	0.96%	63,381.22	0.95%	-
华创证券	1	39,111,867.04	0.55%	36,995.82	0.56%	-
华金证券	2	33,591,140.32	0.47%	31,772.64	0.48%	-
国元证券	1	31,444,980.11	0.44%	29,717.27	0.45%	-

光大证券	1	29,866,177.19	0.42%	27,865.80	0.42%	-
申港证券	1	25,773,815.93	0.36%	24,003.40	0.36%	-
中信证券	3	16,359,667.75	0.23%	15,310.97	0.23%	-
招商证券	2	10,301,015.69	0.14%	9,637.22	0.14%	-
华泰证券	1	4,914,572.00	0.07%	4,536.71	0.07%	-
太平洋证券	1	83,410.74	0.00%	78.90	0.00%	-
华融证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
北京高华	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-

注：（1）交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

（2）本基金本报告期内退租西部证券交易席位1个。

#### 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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
申万宏源证券	1,999,340.00	50.00%	-	-	-	-
西南证券	1,999,581.00	50.00%	-	-	-	-

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

基金合同；  
招募说明书及其更新；  
产品资料概要及其更新；  
发售公告；  
成立公告；  
定期报告；  
其他临时公告。

### 12.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 12.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)。

申万菱信基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日