

光大保德信量化核心证券投资基金
2023 年年度报告
2023 年 12 月 31 日

基金管理人：光大保德信基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

报告送出日期：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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

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
§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	9
2.4 信息披露方式	9
2.5 其他相关资料	10
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	10
3.1 主要会计数据和财务指标	10
3.2 基金净值表现	12
3.3 过去三年基金的利润分配情况	15
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	22
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	23
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	23
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	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	23
§6 审计报告	23
6.1 审计意见	24
6.2 形成审计意见的基础	24
6.3 其他信息	24
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	24
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	25
§7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表	26
7.2 利润表	27
7.3 净资产变动表	28
7.4 报表附注	30
§8 投资组合报告	65
8.1 期末基金资产组合情况	65
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	65
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	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
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	80
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	80
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	80
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	80
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	81
8.11 本基金投资股指期货的投资政策	81
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
8.13 投资组合报告附注	81
§9 基金份额持有人信息	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
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	82
§10 开放式基金份额变动	83
§11 重大事件揭示	83
11.1 基金份额持有人大会决议	83
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	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
11.4 基金投资策略的改变	83
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	83
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	84
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.9 其他重大事件	87
12 影响投资者决策的其他重要信息	89
§13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录	89
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	光大保德信量化核心证券投资基金	
基金简称	光大保德信量化股票	
基金主代码	360001	
交易代码	360001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 8 月 27 日	
基金管理人	光大保德信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,887,202,515.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
下属分级基金的交易代码	360001	007479
报告期末下属分级基金的份额总额	1,641,249,646.23 份	245,952,868.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求长期持续稳定超出业绩比较基准的投资回报。
投资策略	<p>本基金借鉴了外方股东保德信投资的量化投资管理理念和长期经验，结合中国市场现行特点加以改进，形成光大保德信独特的量化投资策略；正常市场情况下不作主动资产配置，采用自下而上与自上而下相结合的方式选择股票；并通过投资组合优化器构建并动态优化投资组合，确保投资组合风险收益特征符合既定目标。</p> <p>本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85—95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5—15%。</p> <p>本基金建仓时间为 6 个月，基金在合同生效后 6 个月内达到上述比例限制。</p>

针对开放式基金申购/赎回的异常流动性需求，资产配置可不受上述比例限制，但基金管理人将在合理期限内调整投资组合，使基金资产配置比例恢复至正常市场情况下的水平，上述合理期限指 10 个交易日，法律法规另有规定时，从其规定。

本基金通过光大保德信特有的以量化投资为核心的多重优化保障体系构建处于或接近有效边际曲线的投资组合。该体系在构建投资组合时综合考量收益因素及风险因素，一方面通过光大保德信独特的多因素数量模型对所有股票的预期收益率进行估算，个股预期收益率的高低直接决定投资组合是否持有该股票；另一方面投资团队从风险控制的角度出发，重点关注数据以外的信息，通过行业分析和个股分析对多因素数量模型形成有效补充，由此形成的行业评级和个股评级将决定行业及个股权重相对业绩基准的偏离范围；然后由投资组合优化器通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，根据预先设定的风险目标构建投资组合，并对投资组合进行动态持续优化，使投资组合风险收益特征符合既定目标；最后由交易员根据具体投资方案进行交易。

1. 多因素数量模型的运用

本基金借鉴保德信投资的量化投资管理经验，根据中国市场运行特征从股票估值，成长趋势及数据质量三方面选取对 A 股股价波动具有较强解释度的共同指标作为多因素数量模型的参数，通过一定的量化技术估算出共同指标的收益贡献率，并按一定权重加总得出个股预期收益率，作为投资组合构建的重要依据。估值类指标主要判断股票价格是否正确反映了公司基本面状况；趋势类指标说明股票现有估值是否能够持续；质量类指标判断是否存在暗示现行基本面趋势可能逆转的警戒信号。同时数量小组还将根据市场变化趋势定期或不定期地对模型参数及相关系数进行复核，并做相应调整以确保参数的有效性。

2. 行业评级

行业评级首先根据行业特性的不同对行业进行划分，我们将行业划分为周期性行业，防御性行业及增长性行业，并根据行业动向和实际发展状况对行业划分进行动态调整；在此基础上通过行业景气定位图对行业的

周期性变化特征进行分析，并判断每个行业目前所处的景气阶段；然后通过树状集群行业评价体系对行业进行系统性评价；最终确定行业评级及行业权重相对业绩基准的偏离范围，为投资组合优化提供行业层面的决策建议。

3. 个股评级

研究团队采用定量分析与定性分析相结合的股票评估模型对上市公司进行综合评级，为投资组合优化提供个股层面的决策建议。研究团队着重关注上市公司数据可靠性及消息面对股价的潜在影响，从财务评分模型及公司质量评分模型两方面着手对公司基本面进行全面系统的分析和判断，得出股票综合评级，并根据股票评级确定投资组合中单个股票相对业绩基准的偏离范围。

4. 投资组合优化器的运用

投资组合优化器以风险收益配比原则为核心，通过一定的量化技术综合考虑个股预期收益率，行业评级和个股评级等参数，对投资组合进行前瞻性的风险配置，根据预先设定的风险目标构建符合参数设置并处于有效边际曲线上的投资组合，即一定风险水平下收益最高的投资组合。投资组合优化器还通过量化模型预测投资组合整体风险程度，对投资组合进行动态持续优化。如果由于股价波动等因素造成事前跟踪误差超出我们预先设定的风险区域，投资团队将在优化器中根据风险归因分析对边际风险贡献率最大的股票进行调整，以降低事前跟踪误差，使投资组合所承担的风险程度符合既定目标，并使风险尽量集中分布在投资团队对该风险因素的把握具有高置信度的区域。

5. 权证的投资

(1) 权证的投资策略

在控制投资风险和保障基金财产安全的前提下，本公司对权证进行积极主动投资，获取较高的投资组合收益水平。权证投资策略主要包括以下几个方面：

A. 本公司主要采用 Black-Scholes 定价公式和二叉树模型对权证进行定价，并根据市场实际情况，调整权证定价模型及其参数，得到权证的理论价值，作为权证投资的价值基准。

	<p>B. 权证价格的对于决定其风险因素的敏感度,本基金通过风险参数的形式进行衡量。</p> <p>C. 本基金通过权证与证券的组合投资,进行基金财产的止损保护。</p> <p>D. 本基金通过采取现金套利(Cash extraction)策略,兑现投资收益,保留未来获利空间。</p> <p>E. 同时,本基金还将采用二叉树模型对美式权证以及各类复杂型权证进行理论定价。</p> <p>F. 基金经理通过对理论价格和隐含波动率的合理性分析,基于对证券价格的未来表现和预期波动率变化的分析判断,主动投资于价值被市场低估的权证品种。</p> <p>(2) 权证的投资决策流程</p> <p>A. 权证的投资研究过程</p> <p>研究人员对于基础股票进行深入的调研和分析,并将结果通过量化模型,对股票进行估值;数量分析小组负责构建和维护权证定价模型,在股票估值的基础上,对于权证的价值进行分析。投资组合委员会在研究分析的基础上,结合基金的实际情况确定投资策略。风险分析小组则通过独立的系统,对权证的风险进行测算,在各种可能的情景下,对权证进行估价,从而确定权证的投资风险,为投资组合委员会的投资策略确定提供参考。</p> <p>B. 权证的投资决策过程</p> <p>a. 权证投资方案的制定</p> <p>投资组合委员会在研究人员和数量分析人员的工作基础上,结合基金的实际情况确定投资方案。</p> <p>b. 权证投资的授权和审批</p> <p>凡单个品种累计投资额度不超过基金资产净值的 5% (暂定) 的权证投资,可由基金经理自主执行,并向投资总监备案。</p> <p>凡单个品种累计投资额度超过基金资产净值的 5% (暂定) 的权证投资,由投资组合委员会向公司投资决策委员会申请审批。投资方案得到批准后,由基金经理在授权的范围内实施。</p> <p>c. 投资计划调整</p>
--	--

	投资组合委员会根据市场变化、投资计划的实施情况和执行效果、投资分析报告（包括投资表现评估报告、风险分析报告）等，进一步分析判断，并据此进行调整。如果遇有重大变化需要修改投资方案，须按相应程序批准后方可实施。
业绩比较基准	90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。按照风险收益配比原则对投资组合进行严格的风险管理，在风险限制范围内追求收益最大化。

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		光大保德信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	高顺平	石立平
	联系电话	(021) 80262888	010-63639180
	电子邮箱	epfservice@epf.com.cn	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4008-202-888	95595
传真		(021) 80262468	010-63639132
注册地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢，6层	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		上海市黄浦区中山东二路558号外滩金融中心1幢（北区3号楼），6-7层、10层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		200010	100033
法定代表人		刘翔	王江

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.epf.com.cn

基金年度报告备置地点	光大保德信基金管理有限公司、中国光大银行股份有限公司的办公场所。
------------	----------------------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	光大保德信基金管理有限公司	上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 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	
	光大保德信 量化股票 A	光大保德信 量化股票 C	光大保德信 量化股票 A	光大保德信 量化股票 C	光大保德信 量化股票 A	光大保德信量 化股票 C
本期已实现收益	-52,224,506.07	-17,411,919.01	-415,335,171.86	-	379,554,965.86	-
本期利润	14,530,328.80	-12,247,039.35	-452,473,974.14	-	58,677,325.36	-
加权平均基金份额本期利润	0.0101	-0.0941	-0.3277	-	0.0370	-
本期加权平均净值利润率	1.04%	-9.76%	-29.66%	-	2.47%	-

本期基金 份额 净值增 长率	2.54%	-0.12%	-25.27%	-	-0.20%	-
3.1.2 期末	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
数据和指 标	光大保德信量 化股票 A	光大保德信量 化股票 C	光大保德信量 化股票 A	光大保德信量 化股票 C	光大保德信量 化股票 A	光大保德信量 化股票 C
期末可 供分配 利润	819,415,656 .83	-33,266,965 .54	685,111,265.0 8	-	1,237,166,28 6.04	-
期末可 供分配 基金份 额利润	0.4993	-0.1353	0.5205	-	0.9595	-
期末基 金资产 净值	1,559,267,9 99.73	233,585,917 .68	1,219,593,07 4.15	-	1,858,854,68 2.44	-
期末基 金份额 净值	0.9500	0.9497	0.9265	-	1.4417	-
3.1.3 累计	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末指标	光大保德信 量化股票 A	光大保德信 量化股票 C	光大保德信 量化股票 A	光大保德信 量化股票 C	光大保德信 量化股票 A	光大保德信 量化股票 C
基金份 额累计 净值增 长率	390.79%	-0.12%	378.65%	-	540.52%	-

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要

低于所列数字。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 光大保德信量化股票 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.98%	0.80%	-6.30%	0.71%	4.32%	0.09%
过去六个月	-4.20%	0.72%	-9.64%	0.77%	5.44%	-0.05%
过去一年	2.54%	0.72%	-10.20%	0.76%	12.74%	-0.04%
过去三年	-23.53%	1.08%	-31.00%	1.00%	7.47%	0.08%
过去五年	43.44%	1.16%	13.65%	1.09%	29.79%	0.07%
自基金合同生效起至今	390.79%	1.56%	180.40%	1.44%	210.39%	0.12%

2. 光大保德信量化股票 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.07%	0.80%	-6.30%	0.71%	4.23%	0.09%
过去六个月	-4.38%	0.72%	-9.64%	0.77%	5.26%	-0.05%
自基金合同生效起至今	-0.12%	0.72%	-13.46%	0.76%	13.34%	-0.04%

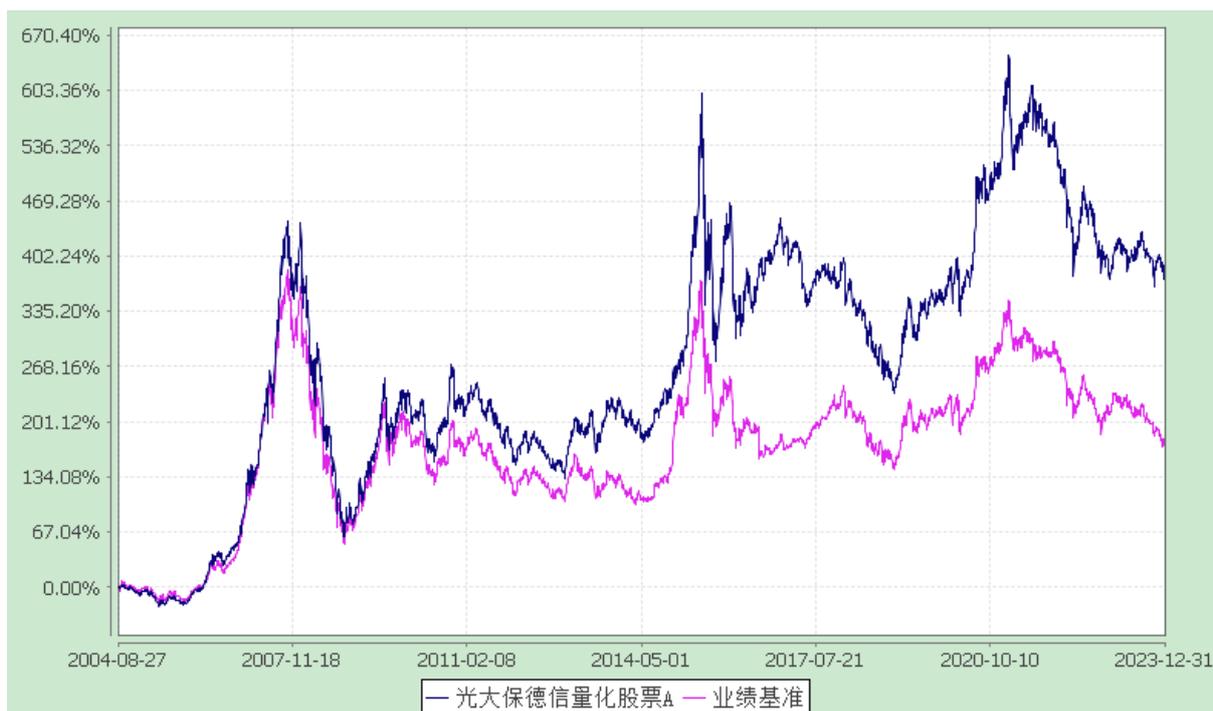
注：为更好地反映债券市场整体运行情况和本基金管理人旗下相关基金投资组合的运作情况，经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致，自 2014 年 4 月 1 日起，将本基金的业绩比较基准由原“90%×富时中国 A200 指数+10%×同业存款利率”变更为“90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率”，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

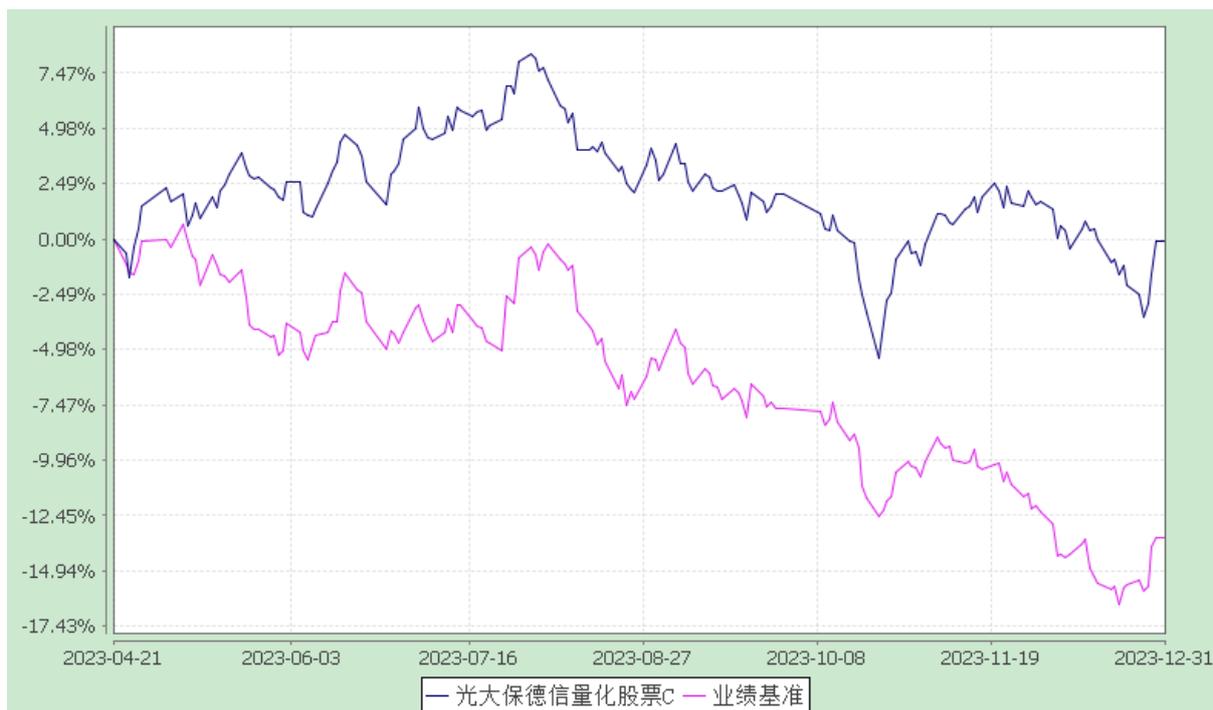
光大保德信量化核心证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2004 年 8 月 27 日至 2023 年 12 月 31 日)

1、光大保德信量化股票 A



2、光大保德信量化股票 C



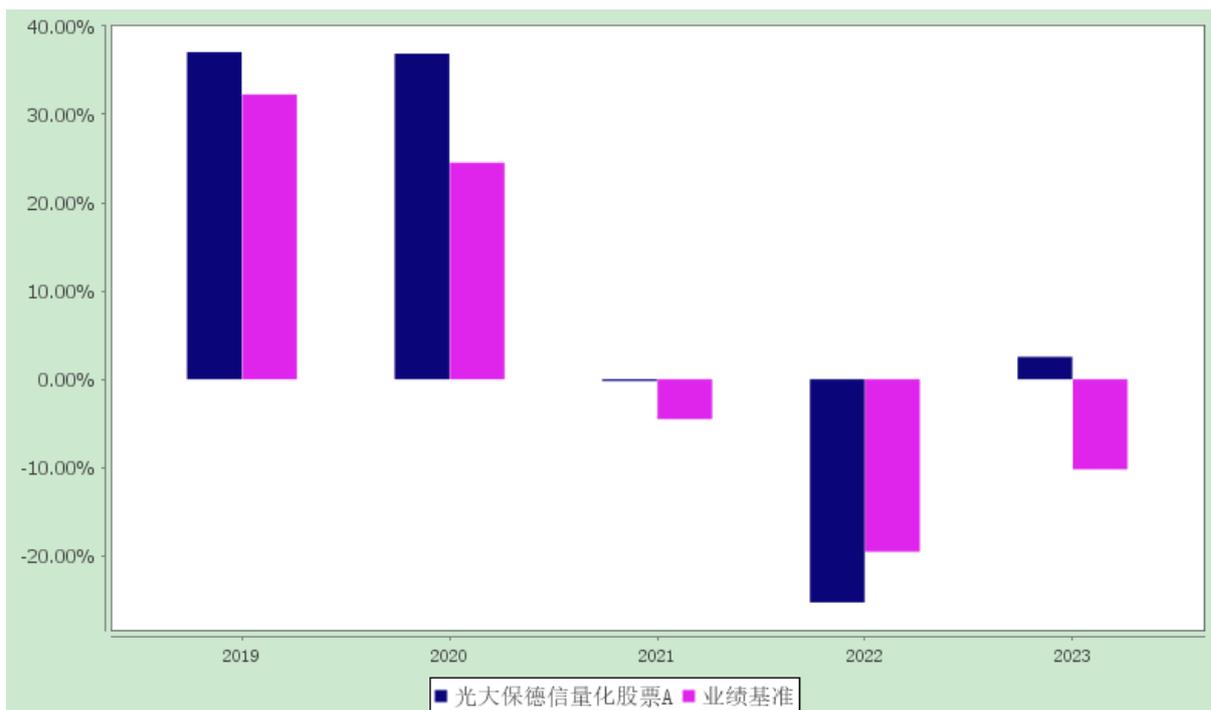
注：本基金 C 类份额设立于 2023 年 4 月 21 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

光大保德信量化核心证券投资基金

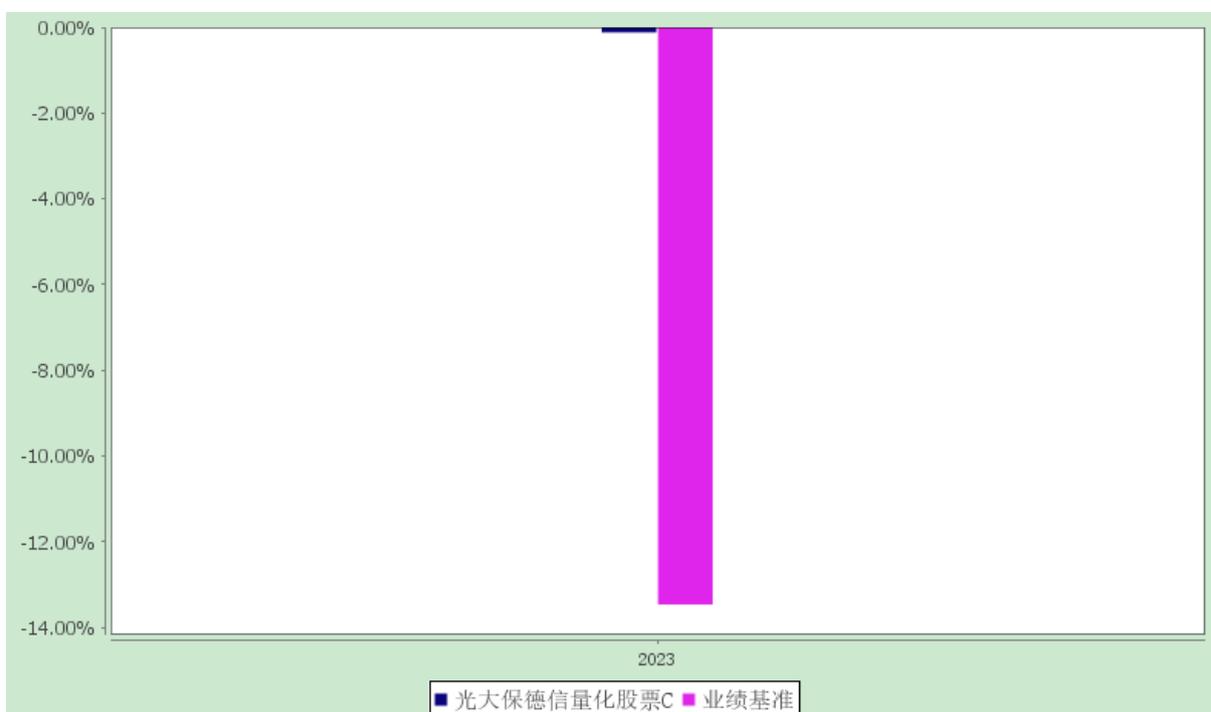
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、光大保德信量化股票 A



注：本基金基金合同于 2004 年 8 月 27 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

2、光大保德信量化股票 C



注：本基金基金合同于 2023 年 4 月 21 日生效，合同生效当年净值收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、光大保德信量化股票 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
2022	1.565	136,837,609.88	107,756,082.15	244,593,692.03	-
合计	1.565	136,837,609.88	107,756,082.15	244,593,692.03	-

2、光大保德信量化股票 C：

本基金 C 类份额过去三年未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

光大保德信基金管理有限公司（以下简称“光大保德信”）成立于 2004 年 4 月，由中国光大集团控股的光大证券股份有限公司和美国保德信金融集团旗下的保德信投资管理有限公司共同创建，公司总部设在上海，注册资本为人民币 1.6 亿元人民币，两家股东分别持有 55% 和 45% 的股份。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务（涉及行政许可的凭许可证经营），今后，将在法律法规允许的范围内为各类投资者提供更多资产管理服务。

截至 2023 年 12 月 31 日，光大保德信旗下管理着 69 只开放式基金，即光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信货币市场基金、光大保德信红利混合型证券投资基金、光大保德信新增长混合型证券投资基金、光大保德信优势配置混合型证券投资基金、光大保德信增利收益债券型证券投资基金、光大保德信均衡精选混合型证券投资基金、光大保德信动态优选灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中小盘混合型证券投资基金、光大保德信信用添益债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动混合型证券投资基金、光大保德信添天盈五年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、光大保德信银发商机主题混合型证券投资基金、光大保德信国企改革主题股票型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金、光大保德信耀钱包货币市场基金、光大保德信欣鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信中国制造 2025 灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信产业新动力灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信永鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信恒利纯债债券型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信安和债券型证券投资基金、光大保德信安祺债券型证券投资基金、光大保

德信永利纯债债券型证券投资基金、光大保德信安诚债券型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信尊盈半年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中高等级债券型证券投资基金、光大保德信先进服务业灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信多策略精选 18 个月定期开放灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信超短债债券型证券投资基金、光大保德信晟利债券型证券投资基金、光大保德信安泽债券型证券投资基金、光大保德信尊丰纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信景气先锋混合型证券投资基金、光大保德信尊泰三年定期开放债券型证券投资基金、光大保德信研究精选混合型证券投资基金、光大保德信消费主题股票型证券投资基金、光大保德信瑞和混合型证券投资基金、光大保德信尊合 87 个月定期开放债券型证券投资基金、光大保德信尊裕纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、光大保德信安瑞一年持有期债券型证券投资基金、光大保德信智能汽车主题股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金、光大保德信新机遇混合型证券投资基金、光大保德信安阳一年持有期混合型证券投资基金、光大保德信品质生活混合型证券投资基金、光大保德信健康优加混合型证券投资基金、光大保德信睿盈混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创新生活混合型证券投资基金、光大保德信纯债债券型证券投资基金、光大保德信恒鑫混合型证券投资基金、光大保德信核心资产混合型证券投资基金、光大保德信尊利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信汇佳混合型证券投资基金、光大保德信尊颐纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、光大保德信高端装备混合型证券投资基金、光大保德信中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、光大保德信荣利纯债债券型证券投资基金、光大保德信专精特新混合型证券投资基金、光大保德信睿阳纯债债券型证券投资基金、光大保德信数字经济主题混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
王卫林	基金经理	2023-08-22	-	7 年	王卫林先生，北京大学软件工程专业硕士。2016 年 7 月至 2018 年 1 月在南方基金管理有限公司任职量化研究员；2018 年 1 月至 2023 年 2 月在长城基金管理有限公司任职量化与指数投资部研究

					员、基金经理助理、基金经理；2023 年 2 月加入光大保德信基金管理有限公司，现任权益管理总部量化投资团队基金经理，2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金的基金经理。
韩羽辰	基金经理	2023-08-03	-	6 年	韩羽辰先生，纽约大学金融工程专业硕士。2017 年 8 月加入光大保德信基金管理有限公司，历任研究助理、量化研究员，2020 年 9 月至 2023 年 7 月历任权益管理总部专户权益投资团队投资经理，现任权益管理总部量化投资团队基金经理，2023 年 8 月至今担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理，2023 年 12 月至今担任光大保德信一带一路战略主题混合型证券投资基金的基金经理。
赵大年	权益管理总部 量化投资团队 团队长、基金 经理	2021-11-20	2023-08-22	16 年	赵大年先生，2004 年毕业于中国科学技术大学统计与金融系，2007 年获得中国科学院数学与系统科学研究院统计学专业的硕士学位。2007 年 6 月至 2007 年 10 月在申万巴黎基金管理有限公司任职产品设计经理；2007 年 10 月至 2009 年 4 月在钧锋投资咨询有限公司任职投资经理；2009 年 4 月加入光大保德信基金管理有限公司，先后担任风险管理部风险控制专员、风险控制高级经理、副总监、总监，2014 年 8 月至 2018 年 3 月担任量化投资部总监。2016 年 2 月至 2018 年 6 月担任光大保

				<p>德信风格轮动混合型证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月至 2018 年 3 月担任光大保德信量化核心证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 6 月及 2023 年 1 月至 2023 年 8 月担任光大保德信事件驱动灵活配置混合型证券投资基金（已清盘）的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 1 月担任光大保德信安祺债券型证券投资基金的基金经理，2018 年 2 月至 2018 年 6 月担任光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金的基金经理，2018 年 6 月起至 2021 年 11 月历任风险管理部副总监、总监，随后任职权益管理总部量化投资团队团队长，2021 年 11 月至 2023 年 8 月担任光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信锦弘混合型证券投资基金的基金经理，2021 年 12 月至 2023 年 8 月担任光大保德信多策略智选 18 个月定期开放混合型证券投资基金的基金经理，2023 年 1 月至 2023 年 7 月担任光大保德信睿鑫灵活配置混合型证券投资基金（已清盘）的基金经理，2023 年 1 月至 2023 年 8 月担任光大保德信风格轮动混合型证券投资基金、光大保德信中证 500 指数增强型证券投资基金、光大保德信创业板量化优选股票型证券投资基金、光大保德信诚鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--

注：对基金的非首任基金经理，其任职日期和离任日期分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无

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《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《光大保德信基金管理有限公司公平交易制度》，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时通过实时监控、分析评估、监察稽核和信息披露确保公平交易过程和结果的有效监督。

分析评估方面，公司采集连续四个季度，不同时间窗口（1 日内、3 日内、5 日内）的同向交易样本，在假设同向交易价差为零及 95% 的置信水平下，对同向交易价差进行 T 分布假设检验并对检验结果进行跟踪分析。通过对涉及公平性交易的投资行为进行事后分析评估，分析对象涵盖公司旗下全部投资组合，并重点分析同类组合间、不同产品间以及同一基金经理管理不同组合间的交易行为。若出现异常交易行为，则及时进行核查并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，各项公平交易制度流程均得到良好地贯彻执行。在同向交易价差分析中，个别投资组合之间出现溢价率统计显著主要原因是市场交易价格波动较大且不同基金经理交易时机的选择不同，本基金管理人旗下所有投资组合从投资信息的获取、投资决策到交易执行的各个环节均按照公平交易制度的要求进行，未发现存在违反公平交易原则的现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金与本公司其他投资组合参与交易所公开竞

价同日反向交易且成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况有 6 次，由投资组合策略不同导致，未发现利益输送或异常交易的问题。

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

纵观 2023 年全年，宏观经济在曲折中稳步复苏，一季度前期积压的需求集中释放带来开门红，二季度房地产和出口形势的边际变化导致经济增速放缓，三季度在货币政策和财政政策的强力支持下经济恢复动能进一步加强，四季度受总需求以及消费数据影响，经济增速再度小幅放缓。此外，以“三新”为代表的新兴经济在 GDP 中占比持续提升，为经济发展提供源源不断的新动能。

股票市场方面，受海外持续高通胀环境以及外部因素的影响，全球市场避险情绪持续处于高位，大量资金涌入低风险资产，为 2023 年 A 股整体带来一定程度的压力。市场风格方面呈现出哑铃型的结构性行情：一方面以小盘风格为代表的高弹性资产，另一方面是以高股息、高稳定性为特征的红利资产。行业主题方面，全年以 AI 概念为主线，带动资金持续流入 TMT 及相关行业，此外中特估、出海链等主题出现阶段性行情。

本基金以基本面和技术面量化模型为基础，通过持续研究积极迭代模型，保持相对均衡的行业配置，并根据模型综合打分精选个股。在市场资金面存量博弈的大环境以及赛道投资出现调整的影响下，本基金秉承均衡配置和分散化的量化投资理念，在 2023 年整体展现出了良好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内光大量化 A 份额净值增长率为 2.54%，业绩比较基准收益率为-10.20%；光大量化 C 份额净值增长率为-0.12%，业绩比较基准收益率为-13.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年宏观经济有望持续向上修复，政府稳增长政策的力度有望进一步加强，经济边际企稳的现象持续增加，同时积极推进经济结构转型，新兴产业整体景气度或将持续回升。当前 A 股市场各主要宽基指数的估值仍处于合理偏低的区间，同时随着内外部市场环境逐渐改善，市场整体净利润水平或将有所回升，此外国内宽松的货币政策格局或将延续，内部增量资金有望逐步流入，随着美联储进入降息周期，外资也有望回流，从而为股票市场提供更有力的支撑。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人在开展内部监察稽核工作时本着合规运作、防范风险、保障基金份额

持有人利益的宗旨，由独立于各业务部门的督察长和监察稽核部、风险管理部对公司的经营管理、基金的投资运作、基金的销售等公司所有业务及员工行为规范等方面进行定期和不定期检查，及时发现问题并督促相关部门进行整改，并定期制作监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

督察长和监察稽核部督促、协助各业务部门按照法律法规和监管机构规定对相关制度的合法性、规范性和时效性完善各项内部管理制度和业务流程，明确风险控制职责并具体落实相应措施，提高全体员工的风险意识，有效保障基金份额持有人的利益。

督察长和监察稽核部、风险管理部针对各部门具体业务建立了相应的检查指标及检查重点，通过现场检查、电脑监控、人员询问、重点抽查等一系列方法，定期对公司和基金日常运作的各项业务进行合法合规检查，并对基金投资交易行为过程实施实时监控，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具合规风控工作情况报告报送董事会和公司管理层。

根据中国证监会的规定，督察长和监察稽核部及时准确地向监管机关报送各项报告，并对公司所有对外信息，包括基金法定信息披露、基金产品宣传推介材料等的合法合规情况进行事前审阅，确保其内容真实、准确、完整并符合中国证监会的相关规定。督察长和监察稽核部组织、协调各相关部门及时完成信息披露，确保公司的信息披露工作严格按照中国证监会规定的时间和方式进行。

在全公司范围内开展持续的学习和培训。督察长和监察稽核部先后组织了新员工入司培训，对相关人员进行了法律法规的专项培训和年度监察培训，并组织员工开展学习、讨论，提高和加深了公司员工对基金法律法规的认识和理解，明确风险控制职责，树立全员内控意识。

根据董事会和管理层的要求，以及法规要求和公司业务发展的需要，督察长和监察稽核部以风险为导向，年内计划并实施了数个内部专项审计项目，及时发现潜在的问题和风险，对公司重要业务环节剔除流程改进建议，促使公司规范运作。

通过上述工作，在本报告期内，本基金管理人对本基金的管理始均按照法律法规、基金合同、招募说明书和公司制度进行，充分维护和保障了基金持有人的合法权益。本基金管理人将一如既往地本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用资金资产，以风险控制为核心，进一步提高内部监察

稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》及监管机关有关规定和《光大保德信基金管理有限公司基金估值委员会工作制度》进行。日常估值由基金管理人和本基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计的财务核对同时进行。

报告期内，公司设立由负责运营的高管、运营部代表（包括基金会计）、投研部门代表、监察稽核部代表、IT 部代表、金融工程部门代表人员组成的估值委员会。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，选择基金估值模型及估值模型假设，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。基金估值政策的议定和修改采用集体决策机制，对需采用特别估值程序的证券，基金管理人及时启动特别估值程序，由公司估值委员会讨论议定特别估值方案并与托管行、审计师沟通后形成建议，经公司管理层批准后由运营部具体执行。估值委员会向公司管理层提交推荐建议前，应审慎平衡托管行、审计师和基金同业的意见，并必须获得估值委员会二分之一以上成员同意。

公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和长期相关工作经历，并具有广泛的代表性。

委员会对各相关部门和代表人员的分工如下：投资研究部和运营部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；运营部根据估值的专业技术对需要进行估值政策调整的品种提出初步意见提交估值委员会讨论，负责执行基金估值政策进行日常估值业务，负责与托管行、审计师、基金同业、监管机关沟通估值调整事项；监察稽核部就估值程序的合法合规发表意见；金融工程负责估值政策调整对投资绩效的评估；IT 部就估值政策调整的技术实现进行评估。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；截止报告期末未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、基金合同以及基金实际运作情况，本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在光大保德信量化核心证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 审计报告

安永华明（2024）审字第 70072552_B03 号

光大保德信量化核心证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了光大保德信量化核心证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的光大保德信量化核心证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了光大保德信量化核心证券投资基金 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，我们独立于光大保德信量化核心证券投资基金，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

光大保德信量化核心证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估光大保德信量化核心证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督光大保德信量化核心证券投资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) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对光大保德信量化核心证券投资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光大保德信量化核心证券投资基金不能持续经营。

(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。

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
师宇轩 李乐

上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2024 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	128,870,362.51	136,391,203.68
结算备付金		9,484,264.84	4,526,965.32
存出保证金		599,618.18	304,034.81
交易性金融资产	7.4.7.2	1,592,087,400.04	1,085,311,478.53
其中：股票投资		1,592,087,400.04	1,085,311,478.53
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	-9,052.04	-
应收清算款		80,188,953.76	-
应收股利		-	-
应收申购款		78,024.37	18,899.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		1,811,299,571.66	1,226,552,581.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		612,739.64	172,730.92
应付管理人报酬		1,805,763.90	1,598,061.81
应付托管费		300,960.66	266,343.63
应付销售服务费		74,827.22	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		885.87	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	15,650,476.96	4,922,371.00
负债合计		18,445,654.25	6,959,507.36
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	846,548,490.03	481,690,610.96
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	946,305,427.38	737,902,463.19
净资产合计		1,792,853,917.41	1,219,593,074.15
负债和净资产总计		1,811,299,571.66	1,226,552,581.51

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9500 元，基金份额总额 1,887,202,515.22 份。其中 A 类基金份额净值 0.9500 元，份额总额 1,641,249,646.23 份；C 类基金份额净值 0.9497 元，份额总额 245,952,868.99 份。

7.2 利润表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

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 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
一、营业总收入		26,628,120.83	-425,449,237.75
1.利息收入		1,300,258.93	1,243,117.91
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,165,409.78	1,243,117.91
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		134,849.15	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-46,607,436.79	-390,031,026.08
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-69,486,876.73	-411,347,603.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
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	-	-
股利收益	7.4.7.15	22,879,439.94	21,316,577.71
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	71,919,714.53	-37,138,802.28

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	15,584.16	477,472.70
减：二、营业总支出		24,344,831.38	27,024,736.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2	20,381,512.19	22,974,782.52
2. 托管费	7.4.10.2	3,396,918.66	3,829,130.35
3. 销售服务费	7.4.10.2	345,090.95	-
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		485.47	-
8. 其他费用	7.4.7.19	220,824.11	220,823.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,283,289.45	-452,473,974.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,283,289.45	-452,473,974.14
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,283,289.45	-452,473,974.14

7.3 净资产变动表

会计主体：光大保德信量化核心证券投资基金

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	481,690,610.96	737,902,463.19	1,219,593,074.15
二、本期期初净资产	481,690,610.96	737,902,463.19	1,219,593,074.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	364,857,879.07	208,402,964.19	573,260,843.26
（一）、综合收益总额	-	2,283,289.45	2,283,289.45
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”	364,857,879.07	206,119,674.74	570,977,553.81

号填列)			
其中：1. 基金申购款	402,923,374.02	252,547,288.30	655,470,662.32
2. 基金赎回款	-38,065,494.95	-46,427,613.56	-84,493,108.51
(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	846,548,490.03	946,305,427.38	1,792,853,917.41
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	471,836,524.76	1,387,018,157.68	1,858,854,682.44
二、本期期初净资产	471,836,524.76	1,387,018,157.68	1,858,854,682.44
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,854,086.20	-649,115,694.49	-639,261,608.29
(一)、综合收益总额	-	-452,473,974.14	-452,473,974.14
(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)	9,854,086.20	47,951,971.68	57,806,057.88
其中：1. 基金申购款	169,093,817.81	374,618,492.50	543,712,310.31
2. 基金赎回款	-159,239,731.61	-326,666,520.82	-485,906,252.43
(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)	-	-244,593,692.03	-244,593,692.03
四、本期期末净资产	481,690,610.96	737,902,463.19	1,219,593,074.15

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 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：刘翔，主管会计工作负责人：贺敬哲，会计机构负责人：王永万

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

光大保德信量化核心证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2004]85 号文《关于同意光大保德信量化核心证券投资基金设立的批复》的核准，由基金管理人光大保德信基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2004 年 8 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 2,544,287,215.94 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为光大保德信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。根据基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2023 年 4 月 20 日发布的《关于光大保德信量化核心证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2023 年 4 月 21 日起，本基金增加 C 类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括在国内依法公开发行上市的股票、存托凭证、法律法规及证监会允许基金投资的其它金融工具。其中股票投资对象重点为基本面良好且具有持续增长潜力，股价处于合理区间的优质股票。本基金在正常市场情况下不作主动资产配置，股票及存托凭证资产的基准比例为基金资产净值的 90%，浮动范围为 85-95%；现金的基准比例为基金资产净值的 10%，浮动范围为 5-15%。

本基金的业绩比较基准为：90%×沪深 300 指数+10%×同业存款利率。

2007 年 5 月 8 日，本基金管理人光大保德信基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.3618 元。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，

采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

税费后的净额入账；

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

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配的比例按有关规定制定；

(2) 本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，本基金默认的收益分配方式是现金分红。投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额进行再投资；

(3) 在符合基金分配条件的前提下，基金收益分配每年至少一次，但若基金合同生效不满 3 个月，收益可不分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

(4) 基金当年收益须先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(5) 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(6) 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费用由基金份额持有人自行承担。当基金份额持有人的现金红利不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的该类基金份额净值自动转为同一类别的基金份额。自动再投资的计算方法，依照《光大保德信基金管理有限公司开放式基金注册登记业务规则》及相关制度的有关规定执行；

(7) 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；

(8) 由于本基金 C 类基金份额收取销售服务费，而 A 类基金份额不收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(9) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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	128,870,362.51	136,391,203.68
等于：本金	128,831,596.04	136,364,081.02
加：应计利息	38,766.47	27,122.66
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	128,870,362.51	136,391,203.68

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	1,563,211,689.88	-	1,592,087,400.04	28,875,710.16
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	1,563,211,689.88	-	1,592,087,400.04	28,875,710.16
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	1,128,355,482.90	-	1,085,311,478.53	-43,044,004.37
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	1,128,355,482.90	-	1,085,311,478.53	-43,044,004.37

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-9,052.04	-
银行间市场	-	-
合计	-9,052.04	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

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	397.32	52.18
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	15,430,079.64	4,582,318.82
其中：交易所市场	15,430,079.64	4,582,318.82
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	100,000.00	100,000.00
预提信息披露费	120,000.00	240,000.00
合计	15,650,476.96	4,922,371.00

7.4.7.7 实收基金

光大保德信量化股票 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	账面金额
上年度末	1,316,317,459.35	481,690,610.96
本期申购	401,940,638.11	147,085,454.47
本期赎回（以“-”号填列）	-77,008,451.23	-28,180,444.39
本期末	1,641,249,646.23	600,595,621.04

光大保德信量化股票 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	账面金额
本期申购	255,837,919.55	255,837,919.55
本期赎回（以“-”号填列）	-9,885,050.56	-9,885,050.56
本期末	245,952,868.99	245,952,868.99

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

（2）根据基金管理人光大保德信基金管理有限公司于 2023 年 4 月 20 日发布的《关于光大保德信量化核心证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2023 年 4 月 21 日起，本基金增设 C 类基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

光大保德信量化股票 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	685,111,265.08	52,791,198.11	737,902,463.19
本期期初	685,111,265.08	52,791,198.11	737,902,463.19
本期利润	-52,224,506.07	66,754,834.87	14,530,328.80
本期基金份额交易产生的变动数	186,528,897.82	19,710,688.88	206,239,586.70
其中：基金申购款	228,841,759.51	24,532,126.73	253,373,886.24
基金赎回款	-42,312,861.69	-4,821,437.85	-47,134,299.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	819,415,656.83	139,256,721.86	958,672,378.69

光大保德信量化股票 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
本期期初	-	-	-
本期利润	-17,411,919.01	5,164,879.66	-12,247,039.35
本期基金份额交易产生的变动数	-15,855,046.53	15,735,134.57	-119,911.96
其中：基金申购款	-16,988,919.09	16,162,321.15	-826,597.94
基金赎回款	1,133,872.56	-427,186.58	706,685.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-33,266,965.54	20,900,014.23	-12,366,951.31

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	1,043,539.39	1,158,636.47
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	115,696.81	79,445.10
其他	6,173.58	5,036.34
合计	1,165,409.78	1,243,117.91

7.4.7.10 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	11,614,331,253.26	7,820,401,282.39
减：卖出股票成本总额	11,652,272,837.01	8,209,301,660.16
减：交易费用	31,545,292.98	22,447,226.02

买卖股票差价收入	-69,486,876.73	-411,347,603.79
----------	----------------	-----------------

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

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	22,879,439.94	21,316,577.71
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	22,879,439.94	21,316,577.71

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	71,919,714.53	-37,138,802.28
——股票投资	71,919,714.53	-37,138,802.28
——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	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	71,919,714.53	-37,138,802.28

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	15,437.35	476,924.58
转换费收入	146.81	548.12
合计	15,584.16	477,472.70

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

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	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费	824.11	823.52
合计	220,824.11	220,823.52

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

关联方名称	与本基金的关系
光大保德信基金管理有限公司（“光大保德信”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构
光大证券股份有限公司（“光大证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
保德信投资管理有限公司	基金管理人的股东
光大保德信资产管理有限公司	基金管理人控制的子公司

注：以下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
光大证券	12,073,822,424.90	50.99%	5,835,448,009.41	37.81%

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

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交易。

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
光大证券	11,264,864.71	52.64%	8,199,705.18	53.14%
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
光大证券	5,395,490.64	40.82%	1,680,620.84	36.68%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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	20,381,512.19
其中：支付销售机构的客户维护费	5,678,737.12	6,541,374.83
应支付基金管理人的净管理费	14,702,775.07	16,433,407.69

注：2023年8月28日前，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提；自2023年8月28日起，基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%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	3,396,918.66	3,829,130.35

注：2023 年 8 月 28 日前，基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；自 2023 年 8 月 28 日起，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		
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C	合计
光大保德信	-	345,100.71	345,100.71
合计	-	345,100.71	345,100.71
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		
	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C	合计
合计	-	-	-

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金份额分为不同的类别，适用不同的销售服务费率。自 2023 年 4 月 21 日起，本基金增加收取销售服务费的 C 类份额。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值的 0.40% 年费率计提。本基金 C 类基金份额销售服务费计提的计算方法如下：

$H=E \times C$ 类基金销售服务费年费率/当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

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

份额单位：份

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	
	光大保德信量化股票A	光大保德信量化股票C	光大保德信量化股票A	光大保德信量化股票C
期初持有的基金份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	10,028.66	-	-
期间因拆分变动份额	-	0.00	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	0.00	-	-

期末持有的基金份额	-	10,028.66	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%	-	-

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 基金管理人投资本基金的费率标准与其他同条件的投资者适用的费率标准相一致。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

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
中国光大银行	128,870,362.51	1,043,539.39	136,391,203.68	1,158,636.47

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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

688347	华虹公司	2023-07-27	6 个月	新股锁定期内	52.00	42.06	34,530.00	1,795,560.00	1,452,331.80	-
688717	艾罗能源	2023-12-26	1 个月以内	新股未上市	55.66	55.66	4,844.00	269,617.04	269,617.04	-
688717	艾罗能源	2023-12-26	6 个月	新股锁定期内	55.66	55.66	11,303.00	629,124.98	629,124.98	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股锁定期内	9.87	12.75	4,048.00	39,953.76	51,612.00	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新股锁定期内	2.66	4.45	9,723.00	25,863.18	43,267.35	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新股锁定期内	80.80	77.75	550.00	44,440.00	42,762.50	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	新股锁定期内	5.18	8.09	4,294.00	22,242.92	34,738.46	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股锁定期内	42.66	48.18	549.00	23,420.34	26,450.82	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股锁定期内	24.22	18.24	1,315.00	31,849.30	23,985.60	-
301511	德福科技	2023-08-08	6 个月	新股锁定期内	28.00	22.67	982.00	27,496.00	22,261.94	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股锁定期内	31.95	52.25	416.00	13,291.20	21,736.00	-
301468	博盈特焊	2023-07-12	6 个月	新股锁定期内	47.58	30.22	598.00	28,452.84	18,071.56	-
301509	金凯生科	2023-07-26	6 个月	新股锁定期内	56.56	62.23	266.00	15,044.96	16,553.18	-
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股锁定期内	47.29	37.97	422.00	19,956.38	16,023.34	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新股锁定	1.70	4.06	3,918.00	6,660.60	15,907.08	-

				期内							
301393	昊帆生物	2023-07-05	6 个月	新股锁定期内	67.68	59.37	260.00	17,596.80	15,436.20	-	
688610	埃科光电	2023-07-10	6 个月	新股锁定期内	73.33	51.00	275.00	20,165.75	14,025.00	-	
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新股锁定期内	11.25	11.07	1,263.00	14,208.75	13,981.41	-	
301510	固高科技	2023-08-04	6 个月	新股锁定期内	12.00	35.01	396.00	4,752.00	13,863.96	-	
301507	民生健康	2023-08-24	6 个月	新股锁定期内	10.00	15.85	851.00	8,510.00	13,488.35	-	
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新股锁定期内	57.88	45.48	281.00	16,264.28	12,779.88	-	
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股锁定期内	8.90	22.14	576.00	5,126.40	12,752.64	-	
301456	盘古智能	2023-07-06	6 个月	新股锁定期内	37.96	30.39	407.00	15,449.72	12,368.73	-	
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股锁定期内	8.66	11.06	1,066.00	9,231.56	11,789.96	-	
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新股锁定期内	37.56	43.57	260.00	9,765.60	11,328.20	-	
301508	中机认检	2023-11-23	6 个月	新股锁定期内	16.82	26.68	419.00	7,047.58	11,178.92	-	
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新股锁定期内	55.00	74.14	140.00	7,700.00	10,379.60	-	
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股锁定期内	10.50	15.99	648.00	6,804.00	10,361.52	-	
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新股锁定期内	71.80	68.91	148.00	10,626.40	10,198.68	-	
30132	信音	2023-0	6 个月	新股	21.00	22.23	458.00	9,618.	10,181	-	

9	电子	7-05		锁定期内				00	.34	
301372	科净源	2023-08-03	6 个月	新股锁定期内	45.00	43.59	231.00	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新股锁定期内	36.90	50.85	198.00	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股锁定期内	25.82	31.80	306.00	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新股锁定期内	26.68	18.69	520.00	13,873.60	9,718.80	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股锁定期内	29.66	36.39	267.00	7,919.22	9,716.13	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6 个月	新股锁定期内	23.97	20.89	455.00	10,906.35	9,504.95	-
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新股锁定期内	6.87	15.51	604.00	4,149.48	9,368.04	-
301518	长华化学	2023-07-26	6 个月	新股锁定期内	25.75	23.01	385.00	9,913.75	8,858.85	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股锁定期内	23.23	35.58	246.00	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新股锁定期内	67.88	52.74	160.00	10,860.80	8,438.40	-
688638	誉辰智能	2023-07-04	6 个月	新股锁定期内	83.90	59.68	141.00	11,829.90	8,414.88	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6 个月	新股锁定期内	31.90	39.84	208.00	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6 个月	新股锁定期内	28.03	49.84	165.00	4,624.95	8,223.60	-
301489	思泉新材	2023-10-16	6 个月	新股锁定期内	41.66	64.11	128.00	5,332.48	8,206.08	-

301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	新股锁定期内	26.87	43.69	185.00	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股锁定期内	48.94	68.32	118.00	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新股锁定期内	66.80	58.99	136.00	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股锁定期内	103.40	78.23	101.00	10,443.40	7,901.23	-
688693	锆威特	2023-08-10	6 个月	新股锁定期内	40.83	43.41	178.00	7,267.74	7,726.98	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新股锁定期内	29.50	33.16	225.00	6,637.50	7,461.00	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股锁定期内	58.08	57.81	126.00	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新股锁定期内	22.88	32.44	224.00	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6 个月	新股锁定期内	26.35	35.81	194.00	5,111.90	6,947.14	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	新股锁定期内	31.16	28.27	230.00	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股锁定期内	15.18	21.43	303.00	4,599.54	6,493.29	-
001378	德冠新材	2023-10-23	6 个月	新股锁定期内	31.68	31.27	205.00	6,494.40	6,410.35	-
603004	鼎龙科技	2023-12-20	6 个月	新股锁定期内	16.80	31.19	195.00	3,276.00	6,082.05	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	新股锁定期内	14.23	18.19	292.00	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	新股锁定	17.38	16.66	303.00	5,266.14	5,047.98	-

				期内						
001306	夏厦精密	2023-11-09	6 个月	新股锁定期内	53.63	75.36	64.00	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023-11-01	6 个月	新股锁定期内	41.18	48.64	99.00	4,076.82	4,815.36	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股锁定期内	23.10	23.31	182.00	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6 个月	新股锁定期内	41.00	44.16	87.00	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6 个月	新股锁定期内	12.05	19.92	189.00	2,277.45	3,764.88	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新股锁定期内	9.50	18.97	178.00	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股锁定期内	25.73	24.88	134.00	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新股锁定期内	19.10	34.75	88.00	1,680.80	3,058.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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金融资产款余额。

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金融资产款余额。

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了内部管理制度和流程来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理体系包括三个层次：第一层次是基于自我评估和管理的业务/职能部门；第二层次是公司经营层的风险管理工作委员会；第三层次是董事会下设的风险管理委员会。

各业务/职能部门是公司风险管理工作最直接的实施者，负责根据公司风险管理政策和制度，制订本部门的风险管理计划、工作流程及相关管理责任，并报请风险管理工作委员会审议批准；对本部门的主要风险指标，以及相关的测量、管理方法提出建议，并及时更新，报请风险管理工作委员会审议批准；实施本部门的风险管理日常工作，定期进行自我评估，并向风险管理工作委员会报告评估情况。

风险管理工作委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权力机构，根据公司董事会和风险管理工作委员会制订的风险管理政策和授权，负责公司日常的风险管理工作。

风险管理委员会是公司风险管理的最高权力机构，其机构组成、运行方式和相应职责应由董事会规定。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 12 月 31 日, 本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日: 0.00%)。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险, 本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求, 保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款, 约定在非常情况下赎回申请的处理方式, 控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险, 有效保障基金持有人利益。

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入

短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为结算备付金、存出保证金及银行存款等。本基金通过监控组合的久期来评估基金面临的利率风险。

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	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
--------------------	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

31 日							
资产							
货币资金	128,870,36 2.51	-	-	-	-	-	128,870,36 2.51
结算备付金	9,484,264.8 4	-	-	-	-	-	9,484,264.8 4
存出保证金	599,618.18	-	-	-	-	-	599,618.18
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,592,087,4 00.04	1,592,087,4 00.04
买入返售金融资产	-9,052.04	-	-	-	-	-	-9,052.04
应收清算款	-	-	-	-	-	80,188,953. 76	80,188,953. 76
应收申购款	-	-	-	-	-	78,024.37	78,024.37
资产总计	138,945,19 3.49	-	-	-	-	1,672,354,3 78.17	1,811,299,5 71.66
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	612,739.64	612,739.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,805,763.9 0	1,805,763.9 0
应付托管费	-	-	-	-	-	300,960.66	300,960.66
应付销售服务费	-	-	-	-	-	74,827.22	74,827.22
应交税费	-	-	-	-	-	885.87	885.87
其他负债	-	-	-	-	-	15,650,476. 96	15,650,476. 96
负债总计	-	-	-	-	-	18,445,654. 25	18,445,654. 25
利率敏感度缺口	138,945,19 3.49	-	-	-	-	1,653,908,7 23.92	1,792,853,9 17.41
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							
货币资金	136,391,20 3.68	-	-	-	-	-	136,391,20 3.68

结算备付金	4,526,965.3 2	-	-	-	-	-	4,526,965.3 2
存出保证金	304,034.81	-	-	-	-	-	304,034.81
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,085,311.4 78.53	1,085,311.4 78.53
应收申购款	-	-	-	-	-	18,899.17	18,899.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	141,222,20 3.81	-	-	-	-	1,085,330,3 77.70	1,226,552,5 81.51
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	172,730.92	172,730.92
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,598,061.8 1	1,598,061.8 1
应付托管费	-	-	-	-	-	266,343.63	266,343.63
其他负债	-	-	-	-	-	4,922,371.0 0	4,922,371.0 0
负债总计	-	-	-	-	-	6,959,507.3 6	6,959,507.3 6
利率敏感度缺口	141,222,20 3.81	-	-	-	-	1,078,370,8 70.34	1,219,593,0 74.15

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末持有的交易性固定收益类投资比例较低，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投

资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的基金管理人每日对投资组合的行业和个券的集中度进行监控，并定期分析其相对业绩比较基准的偏离度。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，通过压力测试来评估本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,592,087,400.04	88.80	1,085,311,478.53	88.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	1,592,087,400.04	88.80	1,085,311,478.53	88.99

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金未来业绩表现相对业绩基准的波动性与其过去一年的整体水平保持一致。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 1%	增加约 12,627,949.14	增加约 11,215,877.90
	业绩比较基准下降 1%	减少约 12,627,949.14	减少约 11,215,877.90

注：上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,588,955,627.01	1,082,376,779.82
第二层次	898,742.02	385,863.40
第三层次	2,233,031.01	2,548,835.31
合计	1,592,087,400.04	1,085,311,478.53

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

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	-	2,548,835.31	2,548,835.31
当期购买	-	3,628,167.34	3,628,167.34
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出	-	4,123,633.75	4,123,633.75

第三层次			
当期利得或损失总额	-	179,662.11	179,662.11
其中：计入损益的利得或损失	-	179,662.11	179,662.11
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	2,233,031.01	2,233,031.01
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	-	-258,499.60	-258,499.60
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	-	2,526,179.09	2,526,179.09
当期购买	-	2,161,755.87	2,161,755.87
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	2,427,833.62	2,427,833.62
当期利得或损失总额	-	288,733.97	288,733.97
其中：计入损益	-	288,733.97	288,733.97

的利得或 损失			
计入其他 综合收益 的利得或 损失（若 有）	-	-	-
期末 余额	-	2,548,835.31	2,548,835.31
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	-	387,079.44	387,079.44

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

单位：人民币元

项目	本期末公允 价值	采用的估值技 术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平 均值	与公允价 值之间的 关系
限售股 票	2,233,031.01	平均价格亚式 期权模型	股票在剩余限售期内的股 价的预期年化波动率	0.0000-2.1988	负相关
项目	上年度末公 允价值	采用的估值技 术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平 均值	与公允价 值之间的 关系
限售股 票	2,548,835.31	平均价格亚式 期权模型	股票在剩余限售期内的股 价的预期年化波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§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	1,592,087,400.04	87.90
	其中：股票	1,592,087,400.04	87.90
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-9,052.04	0.00
	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	138,354,627.35	7.64
8	其他各项资产	80,866,596.31	4.46
9	合计	1,811,299,571.66	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	7,934,422.00	0.44
B	采矿业	13,591,013.00	0.76
C	制造业	1,093,564,914.05	61.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	44,249,293.35	2.47
E	建筑业	26,028,837.18	1.45
F	批发和零售业	77,753,594.83	4.34
G	交通运输、仓储和邮政业	39,652,378.55	2.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	154,951,166.51	8.64
J	金融业	9,970,166.50	0.56
K	房地产业	23,818,029.84	1.33
L	租赁和商务服务业	136,340.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	33,428,378.60	1.86
N	水利、环境和公共设施管理业	22,880,806.42	1.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,607,848.00	0.37
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	29,371,117.05	1.64
S	综合	8,149,094.16	0.45
	合计	1,592,087,400.04	88.80

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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

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	002817	黄山胶囊	1,867,600	16,360,176.00	0.91
2	002381	双箭股份	2,137,200	16,199,976.00	0.90
3	002492	恒基达鑫	2,591,000	15,520,090.00	0.87
4	300440	运达科技	1,881,700	14,018,665.00	0.78
5	000590	启迪药业	1,443,700	12,935,552.00	0.72
6	002873	新天药业	987,866	12,308,810.36	0.69
7	002743	富煌钢构	1,958,700	11,713,026.00	0.65
8	603579	荣泰健康	547,400	11,402,342.00	0.64
9	300543	朗科智能	1,020,000	11,138,400.00	0.62
10	300243	瑞丰高材	1,079,310	10,544,858.70	0.59
11	300717	华信新材	600,500	10,082,395.00	0.56
12	300987	川网传媒	567,430	10,054,859.60	0.56
13	605058	澳弘电子	424,700	9,729,877.00	0.54
14	603937	丽岛新材	753,400	9,545,578.00	0.53
15	002296	辉煌科技	1,092,400	9,012,300.00	0.50
16	300701	森霸传感	782,925	8,987,979.00	0.50
17	002412	汉森制药	1,288,800	8,738,064.00	0.49
18	300642	透景生命	492,000	8,683,800.00	0.48
19	002730	电光科技	905,200	8,581,296.00	0.48
20	688080	映翰通	210,300	8,533,974.00	0.48
21	002949	华阳国际	610,400	8,527,288.00	0.48
22	603328	依顿电子	1,037,700	8,457,255.00	0.47
23	000823	超声电子	883,500	8,455,095.00	0.47
24	002091	江苏国泰	1,069,600	8,374,968.00	0.47
25	603881	数据港	421,600	8,356,112.00	0.47
26	300193	佳士科技	1,074,400	8,348,088.00	0.47
27	300154	瑞凌股份	1,126,400	8,335,360.00	0.46
28	002140	东华科技	977,660	8,310,110.00	0.46
29	002396	星网锐捷	459,700	8,306,779.00	0.46
30	000788	北大医药	1,237,219	8,301,739.49	0.46
31	002753	永东股份	1,006,000	8,299,500.00	0.46
32	002978	安宁股份	262,000	8,294,920.00	0.46
33	300230	永利股份	2,055,900	8,285,277.00	0.46
34	605388	均瑶健康	660,100	8,277,654.00	0.46
35	300407	凯发电气	876,595	8,275,056.80	0.46
36	600850	电科数字	380,400	8,273,700.00	0.46
37	002171	楚江新材	1,102,900	8,249,692.00	0.46
38	000062	深圳华强	731,507	8,244,083.89	0.46
39	002880	卫光生物	234,500	8,237,985.00	0.46
40	603590	康辰药业	216,300	8,236,704.00	0.46
41	002283	天润工业	1,407,000	8,230,950.00	0.46
42	603096	新经典	417,200	8,210,496.00	0.46
43	688655	迅捷兴	543,500	8,206,850.00	0.46
44	002393	力生制药	314,300	8,203,230.00	0.46

45	300843	胜蓝股份	356,500	8,192,370.00	0.46
46	000990	诚志股份	995,900	8,176,339.00	0.46
47	603989	艾华集团	379,300	8,162,536.00	0.46
48	002449	国星光电	861,000	8,153,670.00	0.45
49	688616	西力科技	597,653	8,151,986.92	0.45
50	000551	创元科技	778,328	8,149,094.16	0.45
51	600894	广日股份	1,105,300	8,123,955.00	0.45
52	002479	富春环保	1,700,500	8,111,385.00	0.45
53	688078	龙软科技	201,100	8,108,352.00	0.45
54	300040	九洲集团	1,443,500	8,083,600.00	0.45
55	300932	三友联众	496,300	8,079,764.00	0.45
56	605287	德才股份	476,050	8,078,568.50	0.45
57	300076	GQY 视讯	1,479,441	8,077,747.86	0.45
58	688613	奥精医疗	362,000	8,058,120.00	0.45
59	301181	标榜股份	285,330	8,054,865.90	0.45
60	603966	法兰泰克	983,720	8,046,829.60	0.45
61	300622	博士眼镜	405,378	8,038,645.74	0.45
62	300789	唐源电气	356,400	8,033,256.00	0.45
63	300907	康平科技	361,600	8,023,904.00	0.45
64	688682	霍莱沃	168,148	8,022,341.08	0.45
65	300515	三德科技	695,100	8,021,454.00	0.45
66	002774	快意电梯	965,400	8,012,820.00	0.45
67	600768	宁波富邦	675,700	8,007,045.00	0.45
68	300150	世纪瑞尔	1,650,200	8,003,470.00	0.45
69	603041	美思德	594,100	7,996,586.00	0.45
70	688273	麦澜德	239,871	7,990,103.01	0.45
71	300889	爱克股份	475,500	7,988,400.00	0.45
72	688013	天臣医疗	378,400	7,984,240.00	0.45
73	301003	江苏博云	319,800	7,982,208.00	0.45
74	688557	兰剑智能	216,700	7,981,061.00	0.45
75	603113	金能科技	988,400	7,976,388.00	0.44
76	300743	天地数码	574,550	7,974,754.00	0.44
77	301189	奥尼电子	275,200	7,956,032.00	0.44
78	603109	神驰机电	484,200	7,950,564.00	0.44
79	300970	华绿生物	459,700	7,934,422.00	0.44
80	603136	天目湖	431,900	7,934,003.00	0.44
81	605155	西大门	512,500	7,933,500.00	0.44
82	002809	红墙股份	728,600	7,927,168.00	0.44
83	300906	日月明	313,300	7,923,357.00	0.44
84	300689	澄天伟业	408,800	7,918,456.00	0.44
85	300897	山科智能	231,313	7,910,904.60	0.44
86	301258	富士莱	244,842	7,903,499.76	0.44
87	300652	雷迪克	285,168	7,884,895.20	0.44
88	000586	汇源通信	625,800	7,872,564.00	0.44

89	605177	东亚药业	297,300	7,872,504.00	0.44
90	603519	立霸股份	603,300	7,867,032.00	0.44
91	300335	迪森股份	1,404,200	7,863,520.00	0.44
92	600483	福能股份	949,300	7,850,711.00	0.44
93	002357	富临运业	1,039,400	7,847,470.00	0.44
94	000088	盐田港	1,607,240	7,843,331.20	0.44
95	300810	中科海讯	384,399	7,841,739.60	0.44
96	002998	优彩资源	986,300	7,841,085.00	0.44
97	301160	翔楼新材	185,636	7,839,408.28	0.44
98	301290	东星医疗	284,130	7,839,146.70	0.44
99	603080	新疆火炬	469,450	7,821,037.00	0.44
100	300994	久祺股份	532,000	7,820,400.00	0.44
101	688089	嘉必优	436,490	7,813,171.00	0.44
102	600628	新世界	1,113,400	7,804,934.00	0.44
103	301178	天亿马	240,050	7,784,821.50	0.43
104	688393	安必平	311,400	7,775,658.00	0.43
105	001696	宗申动力	1,170,700	7,761,741.00	0.43
106	603900	莱绅通灵	1,161,300	7,757,484.00	0.43
107	300425	中建环能	1,657,300	7,756,164.00	0.43
108	688227	品高股份	406,000	7,742,420.00	0.43
109	603183	建研院	1,650,090	7,705,920.30	0.43
110	603214	爱婴室	468,900	7,671,204.00	0.43
111	600051	宁波联合	1,062,300	7,669,806.00	0.43
112	688329	艾隆科技	308,300	7,664,338.00	0.43
113	605158	华达新材	1,008,120	7,661,712.00	0.43
114	600082	海泰发展	2,219,176	7,656,157.20	0.43
115	600883	博闻科技	900,100	7,650,850.00	0.43
116	301130	西点药业	274,300	7,647,484.00	0.43
117	603269	海鸥股份	565,720	7,620,248.40	0.43
118	301052	果麦文化	173,900	7,613,342.00	0.42
119	603506	南都物业	700,200	7,611,174.00	0.42
120	300891	惠云钛业	780,000	7,566,000.00	0.42
121	600007	中国国贸	388,700	7,533,006.00	0.42
122	002295	精艺股份	921,700	7,530,289.00	0.42
123	300295	三六五网	609,100	7,510,203.00	0.42
124	300695	兆丰股份	140,700	7,451,472.00	0.42
125	002461	珠江啤酒	941,200	7,435,480.00	0.41
126	603102	百合股份	190,500	7,387,590.00	0.41
127	002048	宁波华翔	562,100	7,312,921.00	0.41
128	002627	三峡旅游	1,361,500	7,270,410.00	0.41
129	002085	万丰奥威	1,442,100	7,123,974.00	0.40
130	300384	三联虹普	444,100	7,087,836.00	0.40
131	603739	蔚蓝生物	449,700	6,844,434.00	0.38
132	603331	百达精工	503,000	6,589,300.00	0.37

133	002163	海南发展	706,200	6,412,296.00	0.36
134	600356	恒丰纸业	798,800	6,374,424.00	0.36
135	000809	铁岭新城	2,068,200	6,287,328.00	0.35
136	603733	仙鹤股份	382,700	6,176,778.00	0.34
137	000601	韶能股份	1,426,200	6,104,136.00	0.34
138	000951	中国重汽	445,500	5,951,880.00	0.33
139	605166	聚合顺	595,500	5,907,360.00	0.33
140	000059	华锦股份	1,073,100	5,891,319.00	0.33
141	002148	北纬科技	970,740	5,863,269.60	0.33
142	688181	八亿时空	215,200	5,810,400.00	0.32
143	002242	九阳股份	450,300	5,723,313.00	0.32
144	002534	杭锅股份	448,200	5,598,018.00	0.31
145	300739	明阳电路	362,900	5,555,999.00	0.31
146	688586	江航装备	498,199	5,525,026.91	0.31
147	605189	富春染织	335,400	5,433,480.00	0.30
148	300388	节能国祯	826,200	5,312,466.00	0.30
149	002558	巨人网络	471,500	5,252,510.00	0.29
150	688098	申联生物	693,656	5,188,546.88	0.29
151	300645	正元智慧	283,900	5,164,141.00	0.29
152	300153	科泰电源	641,700	5,120,766.00	0.29
153	600379	宝光股份	507,800	5,103,390.00	0.28
154	300732	设研院	576,300	5,088,729.00	0.28
155	600229	城市传媒	672,100	5,074,355.00	0.28
156	300768	迪普科技	342,600	5,063,628.00	0.28
157	603866	桃李面包	655,378	5,020,195.48	0.28
158	002788	鹭燕医药	557,800	5,014,622.00	0.28
159	300286	安科瑞	190,400	4,937,072.00	0.28
160	000910	大亚圣象	596,601	4,772,808.00	0.27
161	002815	崇达技术	491,600	4,709,528.00	0.26
162	002649	博彦科技	362,700	4,450,329.00	0.25
163	603577	汇金通	427,200	4,442,880.00	0.25
164	603365	水星家纺	305,100	4,387,338.00	0.24
165	002677	浙江美大	414,800	4,193,628.00	0.23
166	600510	黑牡丹	704,700	3,981,555.00	0.22
167	603377	东方时尚	936,800	3,943,928.00	0.22
168	603602	纵横通信	260,600	3,841,244.00	0.21
169	600397	安源煤业	1,267,600	3,840,828.00	0.21
170	603238	诺邦股份	278,650	3,831,437.50	0.21
171	600965	福成股份	605,900	3,823,229.00	0.21
172	300453	三鑫医疗	491,100	3,747,093.00	0.21
173	603518	锦泓集团	372,600	3,733,452.00	0.21
174	603680	今创集团	390,200	3,687,390.00	0.21
175	300377	赢时胜	470,000	3,647,200.00	0.20
176	002946	新乳业	316,200	3,629,976.00	0.20

177	001207	联科科技	212,600	3,624,830.00	0.20
178	601609	金田股份	533,000	3,608,410.00	0.20
179	600184	光电股份	314,900	3,599,307.00	0.20
180	003011	海象新材	168,800	3,583,624.00	0.20
181	300877	金春股份	205,000	3,548,550.00	0.20
182	002016	世荣兆业	546,200	3,435,598.00	0.19
183	000811	冰轮环境	253,100	3,434,567.00	0.19
184	002390	信邦制药	757,600	3,363,744.00	0.19
185	000597	东北制药	626,100	3,349,635.00	0.19
186	600927	永安期货	209,900	3,297,529.00	0.18
187	600469	风神股份	529,500	3,267,015.00	0.18
188	300872	天阳科技	234,800	3,212,064.00	0.18
189	603012	创力集团	540,600	3,194,946.00	0.18
190	002088	鲁阳节能	222,900	3,176,325.00	0.18
191	600538	国发股份	678,500	3,148,240.00	0.18
192	600857	宁波中百	332,600	3,136,418.00	0.17
193	603609	禾丰股份	365,600	3,129,536.00	0.17
194	603928	兴业股份	229,300	3,065,741.00	0.17
195	301162	国能日新	58,400	3,029,792.00	0.17
196	603530	神马电力	143,000	2,965,820.00	0.17
197	600757	长江传媒	390,001	2,905,507.45	0.16
198	600507	方大特钢	627,612	2,893,291.32	0.16
199	300119	瑞普生物	175,154	2,870,774.06	0.16
200	603067	振华股份	267,400	2,724,806.00	0.15
201	688231	隆达股份	123,400	2,716,034.00	0.15
202	688208	道通科技	114,000	2,707,500.00	0.15
203	002724	海洋王	328,900	2,703,558.00	0.15
204	600455	博通股份	107,200	2,663,920.00	0.15
205	002206	海利得	530,400	2,662,608.00	0.15
206	000531	穗恒运 A	395,700	2,647,233.00	0.15
207	603580	艾艾精工	176,900	2,634,041.00	0.15
208	000931	中关村	444,300	2,608,041.00	0.15
209	600300	维维股份	823,700	2,561,707.00	0.14
210	603936	博敏电子	244,226	2,549,719.44	0.14
211	000561	烽火电子	299,100	2,512,440.00	0.14
212	688163	赛伦生物	124,144	2,481,638.56	0.14
213	603976	正川股份	124,200	2,447,982.00	0.14
214	600055	万东医疗	138,000	2,357,040.00	0.13
215	002111	威海广泰	257,340	2,331,500.40	0.13
216	600551	时代出版	211,600	2,304,324.00	0.13
217	603115	海星股份	156,900	2,297,016.00	0.13
218	301235	华康医疗	87,700	2,247,751.00	0.13
219	603045	福达合金	142,000	2,242,180.00	0.13
220	603823	百合花	217,840	2,143,545.60	0.12

221	603192	汇得科技	108,600	2,133,990.00	0.12
222	300412	迦南科技	374,200	2,129,198.00	0.12
223	601952	苏垦农发	206,380	2,113,331.20	0.12
224	002130	沃尔核材	273,300	2,063,415.00	0.12
225	002879	长缆科技	128,000	2,050,560.00	0.11
226	300550	和仁科技	136,600	2,047,634.00	0.11
227	601200	上海环境	220,087	1,978,582.13	0.11
228	000567	海德股份	186,000	1,977,180.00	0.11
229	603351	威尔药业	74,400	1,961,928.00	0.11
230	688100	威胜信息	67,600	1,954,992.00	0.11
231	000915	华特达因	67,100	1,943,216.00	0.11
232	300424	航新科技	146,900	1,924,390.00	0.11
233	600594	益佰制药	338,200	1,924,358.00	0.11
234	002062	宏润建设	432,600	1,916,418.00	0.11
235	603897	长城科技	92,900	1,902,592.00	0.11
236	603500	祥和实业	155,000	1,898,750.00	0.11
237	688711	宏微科技	44,000	1,825,560.00	0.10
238	000715	中兴商业	248,800	1,818,728.00	0.10
239	603010	万盛股份	168,000	1,812,720.00	0.10
240	002039	黔源电力	131,000	1,806,490.00	0.10
241	000504	南华生物	155,600	1,804,960.00	0.10
242	002144	宏达高科	153,010	1,777,976.20	0.10
243	601801	皖新传媒	253,700	1,763,215.00	0.10
244	600643	爱建集团	340,300	1,735,530.00	0.10
245	300378	鼎捷软件	81,200	1,730,372.00	0.10
246	688418	震有科技	91,300	1,721,918.00	0.10
247	603520	司太立	120,700	1,699,456.00	0.09
248	002139	拓邦股份	174,100	1,699,216.00	0.09
249	300497	富祥药业	181,400	1,697,904.00	0.09
250	688597	煜邦电力	178,847	1,627,507.70	0.09
251	300971	博亚精工	63,800	1,588,620.00	0.09
252	002537	海联金汇	236,900	1,577,754.00	0.09
253	603339	四方科技	132,000	1,569,480.00	0.09
254	300281	金明精机	259,600	1,555,004.00	0.09
255	605066	天正电气	167,520	1,537,833.60	0.09
256	000791	甘肃能源	274,840	1,530,858.80	0.09
257	002566	益盛药业	164,100	1,462,131.00	0.08
258	688347	华虹公司	34,530	1,452,331.80	0.08
259	603367	辰欣药业	96,700	1,415,688.00	0.08
260	002923	润都股份	114,200	1,409,228.00	0.08
261	688198	佰仁医疗	11,200	1,394,736.00	0.08
262	300513	恒实科技	114,600	1,361,448.00	0.08
263	603588	高能环境	207,700	1,358,358.00	0.08
264	603132	金徽股份	96,600	1,321,488.00	0.07

265	002637	赞宇科技	122,800	1,317,644.00	0.07
266	000952	广济药业	159,200	1,272,008.00	0.07
267	600727	鲁北化工	193,300	1,271,914.00	0.07
268	002051	中工国际	155,989	1,266,630.68	0.07
269	002644	佛慈制药	129,000	1,257,750.00	0.07
270	002133	广宇集团	359,900	1,256,051.00	0.07
271	002484	江海股份	76,300	1,225,378.00	0.07
272	600420	国药现代	125,100	1,224,729.00	0.07
273	688505	复旦张江	131,900	1,217,437.00	0.07
274	301095	广立微	16,100	1,203,153.00	0.07
275	603508	思维列控	74,000	1,161,800.00	0.06
276	603360	百傲化学	109,800	1,160,586.00	0.06
277	688607	康众医疗	56,900	1,159,622.00	0.06
278	603967	中创物流	111,830	1,156,322.20	0.06
279	688511	天微电子	36,100	1,136,067.00	0.06
280	300102	乾照光电	153,200	1,126,020.00	0.06
281	301316	慧博云通	46,400	1,078,336.00	0.06
282	000650	仁和药业	161,400	1,070,082.00	0.06
283	600618	氯碱化工	116,300	1,058,330.00	0.06
284	000681	视觉中国	71,500	1,051,050.00	0.06
285	688439	振华风光	11,500	1,024,765.00	0.06
286	300747	锐科激光	43,500	1,023,555.00	0.06
287	603258	电魂网络	44,200	1,015,716.00	0.06
288	002401	中远海科	54,700	991,164.00	0.06
289	002443	金洲管道	144,100	987,085.00	0.06
290	603071	物产环能	64,900	986,480.00	0.06
291	603321	梅轮电梯	107,800	920,612.00	0.05
292	688299	长阳科技	64,800	903,960.00	0.05
293	688717	艾罗能源	16,147	898,742.02	0.05
294	301283	聚胶股份	27,200	894,336.00	0.05
295	002014	永新股份	105,660	882,261.00	0.05
296	002961	瑞达期货	57,100	850,790.00	0.05
297	603033	三维股份	53,600	847,416.00	0.05
298	002947	恒铭达	26,300	846,334.00	0.05
299	600488	津药药业	159,500	781,550.00	0.04
300	300900	广联航空	30,600	755,208.00	0.04
301	002282	博深股份	92,502	749,266.20	0.04
302	300183	东软载波	47,501	716,790.09	0.04
303	002225	濮耐股份	181,100	684,558.00	0.04
304	300289	利德曼	105,200	646,980.00	0.04
305	300636	同和药业	61,000	642,940.00	0.04
306	688135	利扬芯片	27,900	622,449.00	0.03
307	002436	兴森科技	41,200	606,876.00	0.03
308	603730	岱美股份	41,700	604,233.00	0.03

309	600602	云赛智联	51,700	598,169.00	0.03
310	600201	生物股份	55,000	592,350.00	0.03
311	301047	义翘神州	6,800	560,320.00	0.03
312	002106	莱宝高科	51,400	546,896.00	0.03
313	002522	浙江众成	111,500	536,315.00	0.03
314	002376	新北洋	68,700	523,494.00	0.03
315	300319	麦捷科技	53,500	515,740.00	0.03
316	600917	重庆燃气	79,700	513,268.00	0.03
317	688205	德科立	10,000	494,800.00	0.03
318	601700	风范股份	98,100	491,481.00	0.03
319	603333	尚纬股份	84,700	483,637.00	0.03
320	601500	通用股份	111,800	462,852.00	0.03
321	300451	创业慧康	70,500	461,775.00	0.03
322	600262	北方股份	23,400	450,450.00	0.03
323	605060	联德股份	23,400	437,580.00	0.02
324	601811	新华文轩	31,800	434,388.00	0.02
325	605288	凯迪股份	9,200	433,504.00	0.02
326	000026	飞亚达	39,400	431,824.00	0.02
327	603533	掌阅科技	20,400	405,552.00	0.02
328	300564	筑博设计	28,100	378,226.00	0.02
329	600621	华鑫股份	21,400	301,098.00	0.02
330	601375	中原证券	68,700	263,121.00	0.01
331	603093	南华期货	21,900	262,800.00	0.01
332	000627	天茂集团	92,300	262,132.00	0.01
333	600864	哈投股份	45,600	259,464.00	0.01
334	601099	太平洋	70,000	259,000.00	0.01
335	001236	弘业期货	22,900	256,022.00	0.01
336	000712	锦龙股份	16,700	244,989.00	0.01
337	300741	华宝股份	8,945	191,512.45	0.01
338	603317	天味食品	11,840	157,353.60	0.01
339	002695	煌上煌	14,400	150,768.00	0.01
340	601969	海南矿业	20,300	133,777.00	0.01
341	000061	农产品	20,600	133,282.00	0.01
342	603025	大豪科技	9,420	124,909.20	0.01
343	300009	安科生物	12,200	124,684.00	0.01
344	600380	健康元	9,500	118,085.00	0.01
345	300452	山河药辅	7,100	101,104.00	0.01
346	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
347	601068	中铝国际	9,700	44,814.00	0.00
348	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
349	603296	华勤技术	550	42,762.50	0.00
350	002635	安洁科技	2,400	39,192.00	0.00
351	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
352	688111	金山办公	100	31,620.00	0.00

353	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
354	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
355	003041	真爱美家	1,400	23,310.00	0.00
356	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
357	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
358	600623	华谊集团	3,200	20,608.00	0.00
359	601956	东贝集团	3,100	18,507.00	0.00
360	301468	博盈特焊	598	18,071.56	0.00
361	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
362	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
363	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
364	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
365	688012	中微公司	100	15,360.00	0.00
366	601098	中南传媒	1,400	14,238.00	0.00
367	301456	盘古智能	461	14,031.93	0.00
368	688610	埃科光电	275	14,025.00	0.00
369	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
370	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
371	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
372	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
373	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
374	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
375	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
376	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
377	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
378	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
379	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
380	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
381	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
382	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
383	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
384	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
385	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
386	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
387	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
388	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
389	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
390	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
391	688638	誉辰智能	141	8,414.88	0.00
392	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
393	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
394	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
395	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
396	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00

397	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
398	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
399	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
400	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
401	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
402	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
403	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
404	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
405	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
406	001378	德冠新材	205	6,410.35	0.00
407	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
408	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
409	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
410	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
411	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
412	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
413	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
414	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
415	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
416	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
417	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00
418	600276	恒瑞医药	60	2,713.80	0.00
419	300357	我武生物	84	2,436.00	0.00
420	603288	海天味业	39	1,480.05	0.00
421	605339	南侨食品	54	1,016.82	0.00
422	600636	国新文化	91	959.14	0.00
423	002293	罗莱生活	99	919.71	0.00
424	603909	建发合诚	69	783.84	0.00
425	603228	景旺电子	33	744.48	0.00
426	601139	深圳燃气	95	654.55	0.00
427	300623	捷捷微电	41	650.67	0.00
428	001914	招商积余	54	645.84	0.00
429	300590	移为通信	50	600.50	0.00
430	002507	涪陵榨菜	40	571.60	0.00
431	300628	亿联网络	19	561.45	0.00
432	603535	嘉诚国际	30	540.00	0.00
433	000541	佛山照明	80	532.00	0.00
434	601577	长沙银行	75	511.50	0.00
435	603527	众源新材	40	432.40	0.00
436	600295	鄂尔多斯	40	388.00	0.00
437	000513	丽珠集团	7	245.07	0.00
438	600548	深高速	26	233.74	0.00
439	300413	芒果超媒	8	201.60	0.00
440	603697	有友食品	20	186.00	0.00

441	301237	和顺科技	5	152.35	0.00
442	603926	铁流股份	10	125.10	0.00
443	603601	再升科技	20	86.00	0.00
444	603308	应流股份	3	42.99	0.00
445	603567	珍宝岛	1	12.16	0.00
446	300002	神州泰岳	1	8.85	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	601998	中信银行	45,350,040.63	3.72
2	600519	贵州茅台	44,042,159.99	3.61
3	601328	交通银行	43,458,573.60	3.56
4	600038	中直股份	40,451,974.50	3.32
5	601318	中国平安	39,852,085.26	3.27
6	603228	景旺电子	39,623,218.76	3.25
7	002461	珠江啤酒	38,435,373.00	3.15
8	603866	桃李面包	38,149,811.03	3.13
9	600886	国投电力	36,948,265.00	3.03
10	301052	果麦文化	36,656,004.00	3.01
11	002788	鹭燕医药	35,315,811.40	2.90
12	600837	海通证券	34,857,162.00	2.86
13	603377	东方时尚	34,708,890.40	2.85
14	603515	欧普照明	34,479,069.17	2.83
15	002014	永新股份	34,191,368.20	2.80
16	600566	济川药业	32,902,682.92	2.70
17	000088	盐田港	32,786,767.76	2.69
18	603238	诺邦股份	32,764,365.10	2.69
19	600000	浦发银行	32,582,695.60	2.67
20	601766	中国中车	31,560,716.00	2.59
21	600690	海尔智家	31,522,024.90	2.58
22	601857	中国石油	31,483,714.00	2.58
23	002110	三钢闽光	30,854,543.88	2.53
24	603680	今创集团	30,809,227.90	2.53
25	600229	城市传媒	30,774,195.95	2.52
26	300789	唐源电气	30,275,790.86	2.48
27	603937	丽岛新材	30,116,051.49	2.47
28	601816	京沪高铁	30,057,632.00	2.46

29	601668	中国建筑	29,870,726.00	2.45
30	603535	嘉诚国际	29,842,478.15	2.45
31	603506	南都物业	29,654,030.00	2.43
32	000333	美的集团	29,505,753.81	2.42
33	603976	正川股份	29,490,034.20	2.42
34	603288	海天味业	29,356,036.31	2.41
35	600168	武汉控股	29,048,187.20	2.38
36	601098	中南传媒	28,811,623.00	2.36
37	603878	武进不锈	28,694,916.20	2.35
38	002479	富春环保	28,177,854.50	2.31
39	603733	仙鹤股份	27,950,349.04	2.29
40	601211	国泰君安	27,913,634.00	2.29
41	300388	节能国祯	27,597,884.40	2.26
42	600007	中国国贸	27,378,081.76	2.24
43	601801	皖新传媒	27,231,819.00	2.23
44	600373	中文传媒	27,168,698.64	2.23
45	603385	惠达卫浴	26,985,762.00	2.21
46	000869	张裕 A	26,695,597.00	2.19
47	001696	宗申动力	26,476,343.00	2.17
48	002880	卫光生物	26,108,632.50	2.14
49	002171	楚江新材	26,038,474.00	2.14
50	601200	上海环境	25,970,680.32	2.13
51	000429	粤高速 A	25,919,504.95	2.13
52	601717	郑煤机	25,842,966.72	2.12
53	002051	中工国际	25,725,309.18	2.11
54	601187	厦门银行	25,530,897.80	2.09
55	600019	宝钢股份	25,417,706.00	2.08
56	601398	工商银行	25,360,872.00	2.08
57	002743	富煌钢构	25,050,252.00	2.05
58	600879	航天电子	24,817,829.00	2.03
59	002815	崇达技术	24,785,652.00	2.03
60	002500	山西证券	24,775,440.40	2.03
61	300695	兆丰股份	24,510,029.00	2.01
62	000598	兴蓉环境	24,498,045.00	2.01
63	600029	南方航空	24,398,599.00	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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

1	600519	贵州茅台	52,722,699.69	4.32
2	601998	中信银行	48,452,783.00	3.97
3	601328	交通银行	48,305,303.76	3.96
4	601318	中国平安	47,643,939.75	3.91
5	600038	中直股份	40,401,808.24	3.31
6	603228	景旺电子	39,423,679.26	3.23
7	600373	中文传媒	36,794,381.12	3.02
8	603377	东方时尚	36,449,594.12	2.99
9	601816	京沪高铁	36,211,197.00	2.97
10	600886	国投电力	35,526,446.00	2.91
11	000429	粤高速 A	34,914,817.80	2.86
12	603288	海天味业	34,125,288.63	2.80
13	600837	海通证券	34,111,166.00	2.80
14	600566	济川药业	33,846,283.00	2.78
15	600690	海尔智家	33,444,272.80	2.74
16	601857	中国石油	33,274,008.00	2.73
17	603515	欧普照明	32,893,308.40	2.70
18	603535	嘉诚国际	31,723,982.60	2.60
19	301052	果麦文化	31,546,066.00	2.59
20	600000	浦发银行	31,370,030.40	2.57
21	600229	城市传媒	30,531,538.24	2.50
22	002014	永新股份	30,406,535.44	2.49
23	002788	鹭燕医药	30,156,150.50	2.47
24	002461	珠江啤酒	30,013,645.30	2.46
25	000333	美的集团	29,831,165.68	2.45
26	002110	三钢闽光	29,664,604.82	2.43
27	601668	中国建筑	29,589,867.00	2.43
28	601766	中国中车	29,364,219.00	2.41
29	600901	江苏租赁	29,249,641.42	2.40
30	603866	桃李面包	29,167,602.73	2.39
31	601098	中南传媒	29,080,554.00	2.38
32	600019	宝钢股份	28,945,341.00	2.37
33	603238	诺邦股份	28,686,708.55	2.35
34	603680	今创集团	28,551,532.10	2.34
35	600104	上汽集团	28,062,365.00	2.30
36	600548	深高速	28,055,434.08	2.30
37	603878	武进不锈	28,036,012.28	2.30
38	600168	武汉控股	27,769,420.90	2.28
39	603385	惠达卫浴	27,166,117.00	2.23
40	601211	国泰君安	27,131,499.00	2.22
41	000922	佳电股份	27,026,687.60	2.22
42	000869	张裕 A	26,972,176.15	2.21
43	603976	正川股份	26,547,256.40	2.18
44	002500	山西证券	26,182,908.00	2.15

45	601801	皖新传媒	26,179,460.00	2.15
46	601717	郑煤机	25,820,122.40	2.12
47	603926	铁流股份	25,552,470.08	2.10
48	601512	中新集团	25,285,561.80	2.07
49	605158	华达新材	25,279,798.40	2.07
50	603369	今世缘	25,254,610.80	2.07
51	000651	格力电器	24,915,574.00	2.04
52	601187	厦门银行	24,912,102.00	2.04
53	603527	众源新材	24,771,870.73	2.03
54	603551	奥普家居	24,766,760.00	2.03
55	000088	盐田港	24,640,719.08	2.02
56	600879	航天电子	24,486,773.00	2.01
57	601166	兴业银行	24,440,495.42	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	12,087,129,043.99
卖出股票的收入（成交）总额	11,614,331,253.26

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 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投资贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.12.1 本期国债期货投资政策**

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

8.12.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 本基金本报告期末投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的情况。

8.13.2 本基金未投资超出基金合同规定的备选股票库。

8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	599,618.18
2	应收清算款	80,188,953.76
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	78,024.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	80,866,596.31
---	----	---------------

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
光大保德信量化股票 A	76,774	21,377.68	575,447,344.33	35.06%	1,065,802,301.90	64.94%
光大保德信量化股票 C	7	35,136,124.14	245,951,612.99	100.00%	1,256.00	0.00%
合计	76,781	24,579.03	821,398,957.32	43.52%	1,065,803,557.90	56.48%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	光大保德信量化股票 A	421,600.66	0.03%
	光大保德信量化股票 C	100.93	0.00%
	合计	421,701.59	0.02%

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	光大保德信量化股票 A	10~50
	光大保德信量化股票 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	光大保德信量化股票 A	0~10
	光大保德信量化股票 C	-
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	光大保德信量化股票 A	光大保德信量化股票 C
基金合同生效日（2004 年 8 月 27 日）基金份额总额	2,544,287,215.94	-
本报告期期初基金份额总额	1,316,317,459.35	-
本报告期基金总申购份额	401,940,638.11	255,837,919.55
减：本报告期基金总赎回份额	77,008,451.23	9,885,050.56
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,641,249,646.23	245,952,868.99

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

本报告期内，基金管理人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金在本报告期内的投资策略未发生改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未发生改聘为其审计的会计师事务所情况。报告年度应支付给聘任安永华明会计师事务所的报酬为 10 万元，目前该审计机构已提供审计服务的连续年限为 19 年。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

11.7.2 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。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	3	12,073,822,424.90	50.99%	11,264,864.71	52.64%	-
中泰证券股份有限公司	1	3,268,066,626.40	13.80%	3,065,169.12	14.32%	-
恒泰证券	1	1,807,497,133.68	7.63%	1,321,293.93	6.17%	-
信达证券	1	1,415,882,383.46	5.98%	1,030,109.82	4.81%	-
长江证券股份有限公司	1	1,375,719,686.58	5.81%	1,291,893.94	6.04%	-
兴业证券	1	1,324,828,264.56	5.60%	1,258,938.47	5.88%	-
海通证券	1	1,168,935,779.19	4.94%	1,082,882.88	5.06%	-
广发证券股份有限公司	1	507,979,563.16	2.15%	471,443.33	2.20%	-
申万宏源证券有限公司	2	408,994,078.47	1.73%	381,046.98	1.78%	-
中信建投证券股份有限公司	3	179,299,654.88	0.76%	96,088.64	0.45%	-
安信证券股份有限公司	1	146,803,249.90	0.62%	137,938.00	0.64%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
国信证券股份	1	-	-	-	-	-

有限公司						
东兴证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中银国际证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：（1）报告期内租用证券公司交易单元变更情况

本基金本报告期无新增或退租的交易单元。

（2）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人选择证券经营机构，并选用其交易单元供本基金买卖证券专用，应本着安全、高效、低成本，能够为本基金提供高质量增值研究服务的原则，对该证券经营机构的经营情况、治理情况、研究实力等进行综合考量。

基本选择标准如下：

实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

经营行为规范，近两年未发生重大违规行为而受到证监会处罚；

内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务；

研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务；

对于某一领域的研究实力超群，或是能够提供全方面，高质量的服务。

（3）选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

投资研究团队按照（2）中列出的有关经营情况、治理情况的选择标准，对备选的证券经营机构进行初步筛选；

对通过初选的各证券经营机构，投资研究团队各成员在其分管行业或领域的范围内，对该机构

所提供的研究报告和信息资讯进行评分。

根据各成员评分，得出各证券经营机构的综合评分。

投资研究团队根据各机构的得分排名，拟定要选用其专用交易单元的证券经营机构。

董事会已做出决议，授权总经理依照公司对各券商的评价结果全权处理并决定公司旗下基金租用专用交易席位的事宜。

11.8.2 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
光大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	50,000,000.00	13.16%	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	120,000,000.00	31.58%	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	210,000,000.00	55.26%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2022 年 12 月 31 日基金份额净值及累计净值公告	基金管理人公司网站、中国证监会基金电子披露网站及本基金选定的信息披露报纸	2023-01-03
2	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	同上	2023-01-20
3	光大保德信量化核心证券投资基金基金产品资料概要更新	同上	2023-03-27
4	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2023-03-27
5	光大保德信量化核心证券投资基金 2022 年年度报告	同上	2023-03-31
6	关于光大保德信量化核心证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告	同上	2023-04-20
7	光大保德信基金管理有限公司关于光大保德信量化核心证券投资基金基金合同的提示性公告	同上	2023-04-20
8	光大保德信量化核心证券投资基金基金合同	同上	2023-04-20
9	光大保德信量化核心证券投资基金托管协议	同上	2023-04-20
10	光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	同上	2023-04-21
11	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 A）基金产品资料概要更新	同上	2023-04-26
12	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 C）基金产品资料概要更新	同上	2023-04-26
13	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明	同上	2023-04-26

	书（更新）		
14	光大保德信基金管理有限公司旗下基金 2023 年 6 月 30 日基金份额净值及累计净值公告	同上	2023-07-03
15	光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	同上	2023-07-21
16	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告	同上	2023-08-03
17	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 A）基金产品资料概要更新	同上	2023-08-07
18	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 C）基金产品资料概要更新	同上	2023-08-07
19	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2023-08-07
20	光大保德信量化核心证券投资基金基金经理变更公告	同上	2023-08-22
21	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 A）基金产品资料概要更新	同上	2023-08-24
22	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 C）基金产品资料概要更新	同上	2023-08-24
23	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2023-08-24
24	光大保德信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	同上	2023-08-26
25	光大保德信量化核心证券投资基金基金合同	同上	2023-08-26
26	光大保德信量化核心证券投资基金托管协议	同上	2023-08-26
27	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 A）基金产品资料概要更新	同上	2023-08-30
28	光大保德信量化核心证券投资基金（光大保德信量化股票 C）基金产品资料概要更新	同上	2023-08-30
29	光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书（更新）	同上	2023-08-30
30	光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年中期报告	同上	2023-08-31
31	光大保德信量化核心证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	同上	2023-10-25
32	光大保德信基金管理有限公司关于暂停官网、网上交易、微信交易、APP、客服热线、在线客服等相关服务的公告	同上	2023-11-13
33	光大保德信基金管理有限公司关于暂停官网、网上交易、APP、微信交易、客服热线、在线客服等系统服务相关公告	同上	2023-11-23
34	光大保德信基金管理有限公司关于暂停关于暂停网上交易、APP、微信交易系统服务相关公告	同上	2023-11-29

35	光大保德信基金管理有限公司关于暂停网上交易、APP、微信交易系统服务相关公告	同上	2023-12-12
36	光大保德信基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	同上	2023-12-30

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230728-20231231	0.00	605,591,101.51	9,884,945.78	595,706,155.73	31.57%
产品特有风险							
<p>本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情形，可能面临单一投资者集中赎回的情况，从而：</p> <p>(1) 对基金的流动性造成冲击，存在对剩余投资者的赎回办理造成影响的风险。</p> <p>(2) 基金管理人因基金赎回的流动性要求致使部分投资受到限制，或因赎回费归入基金资产等原因，而导致基金资产净值波动的风险，影响基金的投资运作和收益水平。</p> <p>(3) 因基金资产规模过小，而导致部分投资不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略，或导致基金不能满足存续条件的风险。</p> <p>本管理人将审慎评估大额申购对基金持有集中度的影响，在运作中保持合适的流动性水平，保护持有人利益。</p>							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1. 根据 2023 年 4 月 20 日《关于光大保德信量化核心证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，基金管理人决定于 2023 年 4 月 21 日起对旗下光大保德信量化核心证券投资基金增设收取销售服务费的 C 类基金份额并更新基金管理人和基金托管人信息，同时对《光大保德信量化核心证券投资基金基金合同》作相应修改。详情请见公告。

2. 根据 2023 年 8 月 26 日《光大保德信基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，光大保德信基金管理有限公司决定自 2023 年 8 月 28 日起，调低本基金的管理费率及托管费率并对基金合同有关条款进行修订。详情请见公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准光大保德信量化核心证券投资基金设立的文件

- 2、光大保德信量化核心证券投资基金基金合同
- 3、光大保德信量化核心证券投资基金招募说明书
- 4、光大保德信量化核心证券投资基金托管协议
- 5、光大保德信量化核心证券投资基金法律意见书
- 6、报告期内光大保德信量化核心证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告
- 7、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 8、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 9、中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

上海市黄浦区中山东二路 558 号外滩金融中心 1 幢（北区 3 号楼），6-7 层、10 层本基金管理人办公地址。

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。客户服务中心电话：4008-202-888，021-80262888。公司网址：www.epf.com.cn。

光大保德信基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日