

诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资
基金
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：诺德基金管理有限公司

基金托管人：中国光大银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 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 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 01 月 01 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	5
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	15
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	15
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	55

8.1 期末基金资产组合情况	55
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	79
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	79
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	79
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	79
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	79
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	79
8.12 投资组合报告附注	79
§ 9 基金份额持有人信息	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	81
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	81
§ 10 开放式基金份额变动	82
§ 11 重大事件揭示	82
11.1 基金份额持有人大会决议	82
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	82
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
11.4 基金投资策略的改变	82
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	82
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	82
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	83
11.8 其他重大事件	85
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	87
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	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§ 13 备查文件目录	87
13.1 备查文件目录	87
13.2 存放地点	87
13.3 查阅方式	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金
基金简称	诺德量化优选
基金主代码	005347
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 27 日
基金管理人	诺德基金管理有限公司
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	263,163,306.55 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，并在严格控制组合风险基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期稳健地增值。
投资策略	本基金通过量化基本面方法，“自上而下”与“自下而上”相结合，对经济情况、公司基本面、估值水平等情况进行深入分析研究，精选投资标的，构建投资组合。同时，对市场情绪、市场交易行为等方面进行分析研究，对市场走势及个股价格走势进行合理预判，动态调整投资组合中个股的仓位，进行积极的组合管理与风险控制，力争实现基金资产的长期增值及稳健的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于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		诺德基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈培阳	石立平
	联系电话	021-68985266	010-63639180
	电子邮箱	peiyang.chen@nuodefund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-888-0009	95595
传真		021-68985121	010-63639132
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号 18 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		中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码		200120	100033
法定代表人		潘福祥	李晓鹏

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nuodefund.com

基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所
------------	---------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	诺德基金管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 18 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
本期已实现收益	-36,039,086.41	-93,247,198.42	220,230,717.39
本期利润	-25,942,480.67	-108,896,773.92	28,254,681.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0931	-0.3472	0.0381
本期加权平均净值利润率	-14.28%	-42.75%	3.49%
本期基金份额净值增长率	-13.13%	-33.02%	-2.18%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-103,526,474.94	-89,001,268.57	13,765,604.85
期末可供分配基金份额利润	-0.3934	-0.3017	0.0425
期末基金资产净值	159,636,831.61	205,989,515.79	337,562,589.60
期末基金份额净值	0.6066	0.6983	1.0425
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值	-39.34%	-30.17%	4.25%

增长率			
-----	--	--	--

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、 期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3、 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。

4、 本基金合同生效日为 2020 年 8 月 27 日。

3.2 基金净值表现

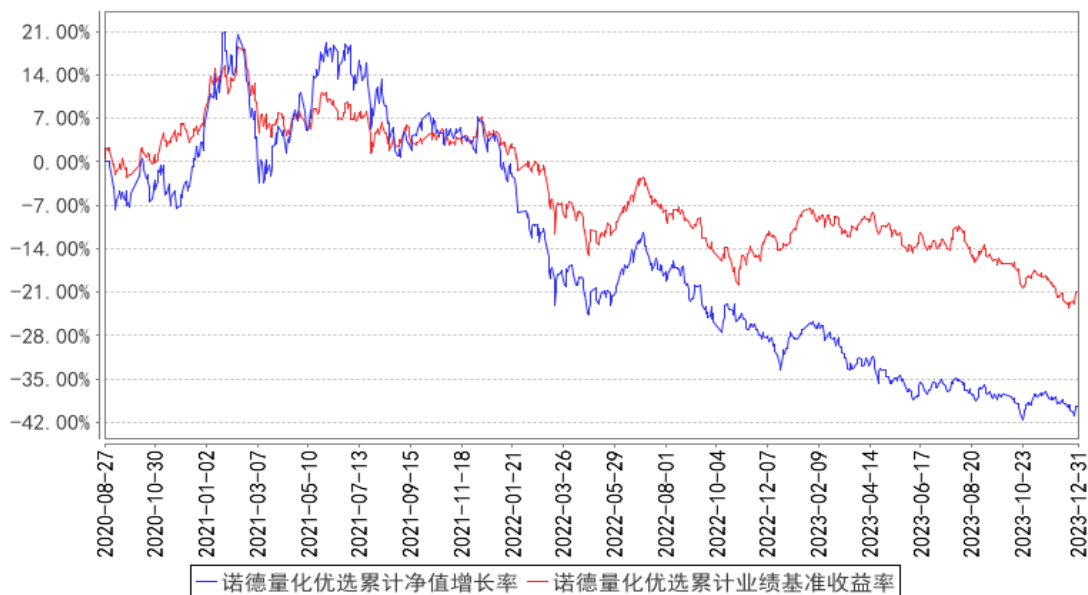
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.10%	0.77%	-5.46%	0.63%	2.36%	0.14%
过去六个月	-5.13%	0.75%	-8.44%	0.68%	3.31%	0.07%
过去一年	-13.13%	0.85%	-8.71%	0.68%	-4.42%	0.17%
过去三年	-43.08%	1.25%	-27.22%	0.89%	-15.86%	0.36%
自基金合同生效起至今	-39.34%	1.26%	-20.93%	0.89%	-18.41%	0.37%

注：本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%。

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

诺德量化优选累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

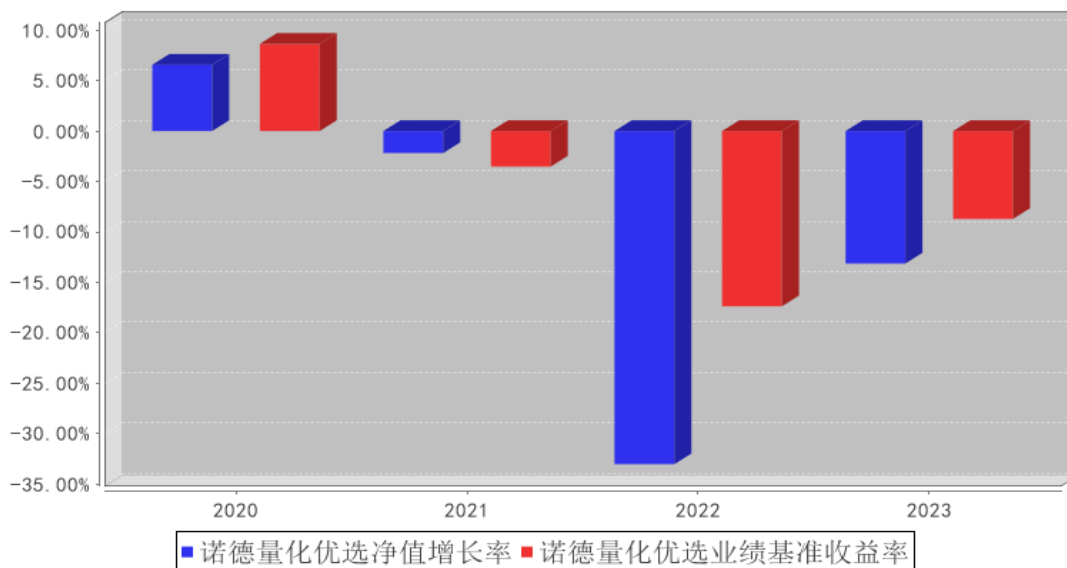


注：本基金成立于 2020 年 8 月 27 日，图示时间段为 2020 年 8 月 27 日至 2023 年 12 月 31 日。

本基金建仓期间自 2020 年 8 月 27 日至 2021 年 2 月 26 日，报告期结束资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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

诺德量化优选基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本图为过去五年/自基金合同生效以来的基金净值增长率与业绩基准收益率比较，基金合同生效当年净值增长率和同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于2020年8月27日，自基金合同生效以来未发生利润分配事项。

§ 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

诺德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2006]88号文批准设立。公司股东为天府清源控股有限公司和北京天朗云创信息技术有限公司，注册地为上海，注册资本为1亿元人民币。截至本报告期末，公司管理了四十只开放式基金：诺德价值优势混合型证券投资基金、诺德主题灵活配置混合型证券投资基金、诺德增强收益债券型证券投资基金、诺德成长优势混合型证券投资基金、诺德中小盘混合型证券投资基金、诺德优选30混合型证券投资基金、诺德周期策略混合型证券投资基金、诺德货币市场基金、诺德成长精选灵活配置混合型证券投资基金、诺德新享灵活配置混合型证券投资基金、诺德新盛灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德新宜灵活配置混合型证券投资基金、诺德新旺灵活配置混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金、诺德消费升级灵活配置混合型证券投资基金、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金、诺德短债债券型证券投资基金、诺德新生活混合型证券投资基金、诺德策略精选混合型证券投资基金、诺德中证研发创新100指数型证券投资基金、诺德大类精选配置三个月定期开放混合型基金中基金（FOF）、诺德汇盈纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、诺德安盈纯债债券型证券投资基金、诺德安瑞39个月定期开放债券型证券投资基金、诺德量化优选6个月持有期混合型证券投资基金、诺德安鸿纯债债券型证券投资基金、诺德品质消费6个月持有期混合型证券投资基金、诺德优势产业混合型证券投资基金、诺德安盛纯债债券型证券投资基金、诺德兴远优选一年持有期混合型证券投资基金、诺德价值发现一年持有期混合型证券投资基金、诺德量化先锋一年持有期混合型证券投资基金、诺德新能源汽车混合型证券投资基金、诺德安元纯债债券型证券投资基金、诺德策略回报股票型证券投资基金、诺德兴新趋势混合型证券投资基金、诺德中短债债券型证券投资基金、诺德惠享稳健三个月持有期基金中基金（FOF）、诺德安承利率债债券型证券投资基金。

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		
曾文宏	本基金基金经理、	2023年7月14日	-	11年	华中师范大学数量经济学硕士。2012年6月至2014年7月于上海大智慧股份有限公

	诺德量化蓝筹增强混合型证券投资基金、诺德天富灵活配置混合型证券投资基金基金经理				司担任行业研究员兼产品经理，2014 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，先后担任风控专员、FOHF 事业部高级研究员, FOF 管理部投资经理等职务，具有基金从业资格。
王恒楠	本基金基金经理、诺德量化核心灵活配置混合型证券投资基金基金经理、诺德量化先锋一年持有期混合型证券投资基金基金经理、量化投资部总监	2020 年 8 月 27 日	2023 年 7 月 14 日	12 年	英国约克大学数学金融硕士，曾经任职于华商基金管理有限公司。2012 年 7 月加入诺德基金管理有限公司，历任助理研究员、量化策略研究员、专户投资部总监、量化事业部总监、量化投资部总监等职务，具有基金从业资格。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日；除首任基金经理外，“任职日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的任职日期；“离任日期”为本公司总经理办公会作出决定并履行必要备案程序后对外公告的离任日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司用职级管理相关规定作为薪酬管理机制，根据员工不同的工作内容及工作表现，设立不同职务等级。基金经理作为公司运营的核心，设立单独职级序列。基金经理薪酬严格按照职级管理相关规定进行管理。同时，公司根据有关法规要求，建立薪酬递延机制。

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基金合同、《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金

运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没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

为保证各类受托投资资金的安全，保证本公司各项资产管理业务的正常运行，维护投资者的合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律、法规、规范性文件的规定，基金管理人制定并实施了《诺德基金管理有限公司公平交易管理办法》，确保在投资管理活动中公平对待所有投资组合，严防直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送，其规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。具体的控制措施包括：

一、实施信息隔离制度：公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；

二、公平分享研究分析报告：所有研究报告均在公司内网平台上发布，但是禁止在其他公开渠道发布，各组合经理同步获取研究分析报告资料；

三、严格控制同日反向交易：原则上禁止不同投资组合之间的同日反向交易，确实由于投资组合的投资决策或流动性等需要而发生的同日反向交易，相关投资组合经理应向投资决策委员会提供决策依据并留存记录备案；

四、公平执行交易指令：（1）交易员对于接收到的交易指令依照时间优先、价格优先的顺序执行。在执行多个投资组合在同一时点就同一证券下达的相同方向的投资指令时，除需经过公平性审核的例外指令外，必须开启系统的公平交易开关；（2）不同投资组合参与银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易，对于需要分配交易量的交易，应当填写《公平交易审批表》，按比例分配的原则实施分配，保证不同投资组合获得公平的交易机会；（3）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，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室应按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（4）对于由于特殊原因无法通过投资交易系统公平交易模块分配的交易，应当实施公平性审核，填写《公平交易审批表》，报公司投资总监或分管投资的高管审批后实施。

五、实施事前审核和事后稽核：公司风险管理部门根据市场公认的第三方信息对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行事前审查，对不同投资组合同日和临近交易日的

反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行事后分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。本公司在 2023 年各季度末对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行专项分析。经 T 检验分析和贡献率分析，本投资组合与其他投资组合日内、3 日内、5 日内的同向交易不存在显著占优或占劣的情况，也未发现其他存在利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

基金经理严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易相关制度要求执行，对公平交易进行管理，独立确定投资组合的交易价格和数量。报告期内，不存在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

公司根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《诺德基金管理有限公司异常交易监控与报告管理办法》，明确公司对投资组合的同向与反向交易和其他日常交易行为进行监控，并对发现的异常交易行为进行报告。该办法覆盖异常交易的类型、界定标准、监控方法与识别程序、对异常交易的分析报告等内容并得到有效执行。本报告期内，本基金与其它组合之间未有参与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 5% 的交易，也未发现存在不公平交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，国内宏观经济整体处于逐步复苏过程中。就股票二级市场而言，2023 年具体表现为：上证综指跌幅 3.7%，上证 50 指数跌幅 11.73%，沪深 300 指数跌幅 11.38%，中证 500 指数跌幅 7.42%，中证 1000 指数跌幅 6.28%，创业板指数跌幅 19.41%，指数层面全年震荡调整为主。

报告期内，本基金通过量化优选股票，同时结合行业配置策略、个股精选策略等，积极把握中国经济增长和资本市场发展机遇。坚守价值投资理念的同时，本基金主要采用量化技术手段，争取获取超越业绩基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.6066 元，累计净值为 0.6066 元。本报告期份额净值增长率为-13.13%，同期业绩比较基准增长率为-8.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济整体依旧处于温和复苏的大背景中。从基本面的来看，我们可以看到中国的宏观经济已经开始复苏，但是节奏相对缓慢。从国际层面上来说，美国经济见顶迹象逐渐明显，美国高企的通货膨胀或将随着 2023 年底经济的放缓见顶。我们认为在 2024 年 A 股市场存在较大机会，本基金将继续关注业绩反转和业绩超预期的公司，同时需要注意回避业绩可能存疑的个股。我们认为低位价值股回归的同时，科创板和创业板已经出现不错的机会，操作上注意规避业绩存疑的个股，关注真正能成长起来的公司，有望获得超额回报。从全年来看，预计 2024 年国企改革真正落实的相关标的，以及资本市场改革背景下，券商行业以及核心资产中业绩和估值匹配的龙头股票，其投资机会都有可能贯穿 2024 年全年。目前看来，指数或已处于长期底部区间。

未来，本基金将加大对相关行业和个股的研究和跟踪力度，以量化优选股票配置为主，适当关注业绩逐步兑现的成长型公司，主要通过主动量化手段，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现基金资产的长期、稳定增值。2024 年可能是股市见底回升的一年，可能有整体系统性的行情，本基金将力争抓住机会，努力为投资者创造更好的回报。

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，本基金管理人从保障基金份额持有人利益出发，继续加强了公司内部控制制度体系的建设，积极开展了风险管理及合规培训。公司内部设立专门的合规稽核部门，负责督促投资研究、市场营销、运营保障等业务部门合规运作，并实施定期和不定期检查，确保各项法规和公司管理制度的有效落实，发现潜在违规风险及时与相关业务部门沟通并向管理层报告，定期向公司董事会出具稽核报告。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 根据公司业务发展情况以及基金监管法律、法规的要求，推动公司各部门完善规章制度和业务流程建设，确保基金投资研究、销售及运营保障的制度化、规范化。

(2) 全面开展了监察稽核工作，保证了公司和基金在合法合规前提下进行投资运作。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，加强了对投资运作的事前、事中及事后的风险控制，确保了本基金在报告期内未出现违法违规的投资行为。

(3) 报告期内，通过各部门的积极参与，重点对投资管理人员管理、投资监控措施、基金销售适用性、反洗钱工作等实际业务运作中存在的潜在风险点进行了梳理、检查，有效地防止了基金和公司投资运作和经营方面的风险。

(4) 根据监管部门的要求，完成定期的稽核报告及专项监察报告，及时报送中国证监会和董事会审阅。

报告期内，本基金管理人各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用；本基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续贯彻内控优先的经营理念，进一步完善公司内部控制制度体系，加强对公司投资研究、市场营销、运营保障等环节的风险点识别及控制，提高内部监察工作的科学性和有效性，保障基金在合法合规前提下的有效运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格遵守企业会计准则、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程序的相关约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责制定基金资产的估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性以及确保估值政策和程序的一贯性。估值委员会由投资、研究、风控、合规、清算等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的业务负责人员或相关指定人员担任。估值委员会成员中不包含基金经理，基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议，但不参与最终估值决策。上述各方不存在任何重大利益冲突。

基金日常估值由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金（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合规守信、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《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 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

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 20495 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“诺德量化优选基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了诺德量化优选基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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

	<p>步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于诺德量化优选基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>诺德量化优选基金的基金管理人诺德基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估诺德量化优选基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算诺德量化优选基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督诺德量化优选基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对诺德量化优选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</p>

	<p>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诺德量化优选基金不能持续经营。</p> <p>(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	魏佳亮	顾俊懿
会计师事务所的地址	中国上海市	
审计报告日期	2024年3月25日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	26,788,079.14	8,019,835.99
结算备付金		1,652,445.44	1,050,491.35
存出保证金		93,364.31	112,200.42
交易性金融资产	7.4.7.2	133,740,298.95	197,641,049.60
其中：股票投资		133,740,298.95	187,729,362.79
基金投资		-	-
债券投资		-	9,911,686.81
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	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		204,303.69	-

应收股利		-	-
应收申购款		14,179.41	15,974.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		162,492,670.94	206,839,552.23
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		1,591,256.92	-
应付赎回款		621,458.05	70,226.19
应付管理人报酬		164,064.14	271,298.73
应付托管费		27,344.03	45,216.46
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	451,716.19	463,295.06
负债合计		2,855,839.33	850,036.44
净资产:			
实收基金	7.4.7.10	263,163,306.55	294,990,784.36
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-103,526,474.94	-89,001,268.57
净资产合计		159,636,831.61	205,989,515.79
负债和净资产总计		162,492,670.94	206,839,552.23

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.6066 元，基金份额总额 263,163,306.55 份。

7.2 利润表

会计主体：诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金

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 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		-22,763,944.29	-104,244,129.90
1. 利息收入		99,354.48	175,307.08
其中：存款利息收入	7.4.7.13	96,222.74	175,307.08

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		3,131.74	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-32,959,904.51	-88,769,861.48
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-35,697,706.91	-92,370,350.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	84,430.41	13,423.90
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,653,371.99	3,587,065.12
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	10,096,605.74	-15,649,575.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		3,178,536.38	4,652,644.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,553,288.31	3,833,694.89
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	425,548.07	638,949.13
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	199,700.00	180,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-25,942,480.67	-108,896,773.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-25,942,480.67	-108,896,773.92
五、其他综合收益的税后		-	-

净额			
六、综合收益总额		-25,942,480.67	-108,896,773.92

7.3 净资产变动表

会计主体：诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金

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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	294,990,784.36	-	-89,001,268.57	205,989,515.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	294,990,784.36	-	-89,001,268.57	205,989,515.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,827,477.81	-	-14,525,206.37	-46,352,684.18
（一）、综合收益总额	-	-	-25,942,480.67	-25,942,480.67
（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）	-31,827,477.81	-	11,417,274.30	-20,410,203.51
其中：1. 基金申购款	3,409,855.88	-	-1,178,924.87	2,230,931.01
2. 基金赎回款	-35,237,333.69	-	12,596,199.17	-22,641,134.52
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	263,163,306.55	-	-103,526,474.9	159,636,831.61

资产			4	
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	323,796,984.75	-	13,765,604.85	337,562,589.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	323,796,984.75	-	13,765,604.85	337,562,589.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-28,806,200.39	-	-102,766,873.42	-131,573,073.81
(一)、综合收益总额	-	-	-108,896,773.92	-108,896,773.92
(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)	-28,806,200.39	-	6,129,900.50	-22,676,299.89
其中：1. 基金申购款	19,159,317.00	-	-4,680,756.09	14,478,560.91
2. 基金赎回款	-47,965,517.39	-	10,810,656.59	-37,154,860.80
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	294,990,784.36	-	-89,001,268.57	205,989,515.79

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：

罗凯

基金管理人负责人

罗凯

主管会计工作负责人

高奇

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1411 号《关于准予诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由诺德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《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,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 1,811,767,705.91 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0768 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2020 年 8 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,812,340,657.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 572,951.26 份基金份额。本基金的基金管理人为诺德基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准、注册上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债、可交换债券、可转换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、货币市场工具、资产支持证券、银行存款、同业存单、股指期货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)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者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、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*80%+中债综合全价指数收益率*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人诺德基金管理有限公司于 2024 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、

中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量:

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

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

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产

支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

或者(3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值; 估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的, 应对市场交易价格进行调整, 确定公允价值。与上述投资品种相同, 但具有不同特征的, 应以相同资产或负债的公允价值为基础, 并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等, 如果该限制是针对资产持有者的, 那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外, 基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

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

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净资产比例计

算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公

司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	26,788,079.14	8,019,835.99
等于：本金	26,784,546.03	8,018,508.01
加：应计利息	3,533.11	1,327.98
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	26,788,079.14	8,019,835.99

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		135,557,103.11	-	133,740,298.95	-1,816,804.16
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		135,557,103.11	-	133,740,298.95	-1,816,804.16
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		199,643,862.69	-	187,729,362.79	-11,914,499.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	9,895,910.00	14,686.81	9,911,686.81	1,090.00
	合计	9,895,910.00	14,686.81	9,911,686.81	1,090.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		209,539,772.69	14,686.81	197,641,049.60	-11,913,409.90

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未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末及上年度末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未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末未计提债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末及上年度末未计提其他债权投资减值准备。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	271,716.19	283,295.06
其中：交易所市场	271,541.19	283,120.06
银行间市场	175.00	175.00
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	180,000.00
合计	451,716.19	463,295.06

7.4.7.10 实收基金

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	294,990,784.36	294,990,784.36
本期申购	3,409,855.88	3,409,855.88
本期赎回（以“-”号填列）	-35,237,333.69	-35,237,333.69
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	263,163,306.55	263,163,306.55

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

不适用。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-34,692,637.44	-54,308,631.13	-89,001,268.57
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-34,692,637.44	-54,308,631.13	-89,001,268.57
本期利润	-36,039,086.41	10,096,605.74	-25,942,480.67
本期基金份额交易产生的变动数	5,647,289.34	5,769,984.96	11,417,274.30
其中：基金申购款	-634,722.61	-544,202.26	-1,178,924.87
基金赎回款	6,282,011.95	6,314,187.22	12,596,199.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-65,084,434.51	-38,442,040.43	-103,526,474.94

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	83,847.76	167,121.08
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	10,869.48	6,698.10
其他	1,505.50	1,487.90
合计	96,222.74	175,307.08

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	-35,697,706.91	-92,370,350.50
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-35,697,706.91	-92,370,350.50

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	890,505,734.30	624,684,487.13
减：卖出股票成本总额	923,905,156.36	715,384,286.77
减：交易费用	2,298,284.85	1,670,550.86
买卖股票差价收入	-35,697,706.91	-92,370,350.50

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年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	105,486.96	13,598.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-21,056.55	-175.00
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	84,430.41	13,423.90

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年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	29,997,172.57	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,896,199.07	-
减：应计利息总额	121,330.05	-
减：交易费用	700.00	175.00
买卖债券差价收入	-21,056.55	-175.00

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	2,653,371.99	3,587,065.12
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	2,653,371.99	3,587,065.12

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 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
1. 交易性金融资产	10,096,605.74	-15,649,575.50
股票投资	10,097,695.74	-15,650,665.50
债券投资	-1,090.00	1,090.00
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	10,096,605.74	-15,649,575.50

7.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未计提信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	19,700.00	-
合计	199,700.00	180,000.00

7.4.7.24 分部报告

不适用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
诺德基金管理有限公司（“诺德基金”）	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（“中国光大银行”）	基金托管人、基金代销机构
天府清源控股有限公司（“天府清控”）	基金管理人的股东
北京天朗云创信息技术有限公司（“天朗云创”）	基金管理人的股东

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 于 2023 年 4 月 3 日，诺德基金管理有限公司的股东宜信惠民投资管理(北京)有限公司名称变更为宜信惠民科技发展(北京)有限公司。于 2023 年 9 月 22 日，宜信惠民科技发展(北京)有限公司名称变更为北京天朗云创信息技术有限公司。

3. 根据诺德基金管理有限公司于 2024 年 1 月 12 日发布的公告，经中国证券监督管理委员会证监许可（2024）38 号文核准，诺德基金管理有限公司实际控制人变更为四川省能源投资集团有限责任公司。本次实际控制人变更不涉及诺德基金管理有限公司注册资本变更、不涉及诺德基金管理有限公司股权结构变更。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	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管理费	2,553,288.31	3,833,694.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	955,685.08	1,389,854.32
应支付基金管理人的净管理费	1,597,603.23	2,443,840.57

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 21 日，支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

根据《诺德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，支付基金管理人诺德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 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托管费	425,548.07	638,949.13

注：自 2022 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 21 日，支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

根据《诺德基金管理有限公司关于调低旗下部分基金管理费率和/或托管费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

不适用。

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

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 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	
	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	26,788,079.14	83,847.76	8,019,835.99	167,121.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

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	证券	成功	受限期	流通受限	认购	期末估	数量	期末	期末估值	备注

代码	名称	认购日		类型	价格	值单价	(单 位: 股)	成本总额	总额	
001239	永达股份	2023年 12月4日	6个月	新股流通 受限	12.05	19.92	122	1,470.10	2,430.24	-
001306	夏厦精密	2023年 11月9日	6个月	新股流通 受限	53.63	75.36	26	1,394.38	1,959.36	-
001326	联域股份	2023年 11月1日	6个月	新股流通 受限	41.18	48.64	55	2,264.90	2,675.20	-
001378	德冠新材	2023年 10月23日	6个月	新股流通 受限	31.68	31.27	87	2,756.16	2,720.49	-
301172	君逸数码	2023年 7月19日	6个月	新股流通 受限	31.33	38.16	219	6,861.27	8,357.04	-
301202	朗威股份	2023年 6月28日	6个月	新股流通 受限	25.82	31.80	133	3,434.06	4,229.40	-
301210	金杨股份	2023年 6月21日	6个月 以上	新股流通 受限	57.88	45.48	108	6,251.04	4,911.84	-
301251	威尔高	2023年 8月30日	6个月	新股流通 受限	28.88	34.59	151	4,360.88	5,223.09	-
301261	恒工精密	2023年 6月29日	6个月	新股流通 受限	36.90	50.85	88	3,247.20	4,474.80	-
301272	英华特	2023年 7月6日	6个月	新股流通 受限	51.39	53.38	76	3,905.64	4,056.88	-
301291	明阳电气	2023年 6月21日	6个月 以上	新股流通 受限	38.13	28.36	194	7,397.22	5,501.84	-
301348	蓝箭电子	2023年 8月1日	6个月	新股流通 受限	18.08	44.57	288	5,207.04	12,836.16	-
301370	国科恒泰	2023年 7月3日	6个月	新股流通 受限	13.39	16.01	528	7,069.92	8,453.28	-
301371	敷尔佳	2023年 7月24日	6个月	新股流通 受限	55.68	37.58	68	3,786.24	2,555.44	-
301372	科净源	2023年 8月3日	6个月	新股流通 受限	45.00	43.59	130	5,850.00	5,666.70	-
301381	赛维时	2023年	6个月	新股流通	20.45	29.69	325	6,646.25	9,649.25	-

	代	7月5日		受限							
301393	昊帆生物	2023年7月5日	6个月	新股流通受限	67.68	59.37	75	5,076.00	4,452.75		-
301413	安培龙	2023年12月11日	6个月	新股流通受限	33.25	58.19	98	3,258.50	5,702.62		-
301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	51.88	50.20	79	4,098.52	3,965.80		-
301421	波长光电	2023年8月16日	6个月	新股流通受限	29.38	59.37	171	5,023.98	10,152.27		-
301456	盘古智能	2023年7月6日	6个月	新股流通受限	37.96	30.39	137	5,200.52	4,163.43		-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股流通受限	31.90	39.84	112	3,572.80	4,462.08		-
301468	博盈特焊	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	47.58	30.22	147	6,994.26	4,442.34		-
301469	恒达新材	2023年8月10日	6个月	新股流通受限	36.58	33.09	138	5,048.04	4,566.42		-
301498	乖宝宠物	2023年8月9日	6个月	新股流通受限	39.99	38.81	141	5,638.59	5,472.21		-
301499	维科精密	2023年7月13日	6个月	新股流通受限	19.50	28.93	253	4,933.50	7,319.29		-
301500	飞南资源	2023年9月13日	6个月	新股流通受限	23.97	20.89	152	3,643.44	3,175.28		-
301505	苏州规划	2023年7月12日	6个月	新股流通受限	26.35	35.81	145	3,820.75	5,192.45		-
301507	民生健康	2023年8月24日	6个月	新股流通受限	10.00	15.85	395	3,950.00	6,260.75		-
301508	中机认检	2023年11月23日	6个月	新股流通受限	16.82	26.68	196	3,296.72	5,229.28		-
301510	固高科技	2023年8月4日	6个月	新股流通受限	12.00	35.01	320	3,840.00	11,203.20		-
301511	德福科技	2023年8月8日	6个月	新股流通受限	28.00	22.67	183	5,124.00	4,148.61		-

301515	港通医疗	2023年 7月13日	6个月	新股流通 受限	31.16	28.27	111	3,458.76	3,137.97	-
301516	中远通	2023年 12月1日	6个月	新股流通 受限	6.87	15.51	374	2,569.38	5,800.74	-
301519	舜禹股份	2023年 7月19日	6个月	新股流通 受限	20.93	20.21	218	4,562.74	4,405.78	-
301520	万邦医药	2023年 9月18日	6个月	新股流通 受限	67.88	52.74	48	3,258.24	2,531.52	-
301525	儒竞科技	2023年 8月23日	6个月	新股流通 受限	99.57	81.46	41	4,082.37	3,339.86	-
301528	多浦乐	2023年 8月17日	6个月	新股流通 受限	71.80	68.91	60	4,308.00	4,134.60	-
301529	福赛科技	2023年 8月31日	6个月	新股流通 受限	36.60	37.88	84	3,074.40	3,181.92	-
301548	崇德科技	2023年 9月11日	6个月	新股流通 受限	66.80	58.99	47	3,139.60	2,772.53	-
301550	斯菱股份	2023年 9月6日	6个月	新股流通 受限	37.56	43.57	93	3,493.08	4,052.01	-
301555	惠柏新材	2023年 10月24日	6个月	新股流通 受限	22.88	32.44	160	3,660.80	5,190.40	-
301558	三态股份	2023年 9月21日	6个月	新股流通 受限	7.33	13.40	551	4,038.83	7,383.40	-
301559	中集环科	2023年 9月26日	6个月	新股流通 受限	24.22	18.24	177	4,286.94	3,228.48	-
301568	思泰克	2023年 11月21日	6个月	新股流通 受限	23.23	35.58	116	2,694.68	4,127.28	-
601083	锦江航运	2023年 11月28日	6个月	新股流通 受限	11.25	11.07	211	2,373.75	2,335.77	-
603062	麦加芯彩	2023年 10月31日	6个月	新股流通 受限	58.08	57.81	29	1,684.32	1,676.49	-

603075	热威股份	2023年 9月1日	6个月	新股流通 受限	23.10	23.31	61	1,409.10	1,421.91	-
603107	上海汽配	2023年 10月25 日	6个月	新股流通 受限	14.23	18.19	82	1,166.86	1,491.58	-
603231	索宝蛋白	2023年 12月6 日	6个月	新股流通 受限	21.29	21.53	58	1,234.82	1,248.74	-
603270	金帝股份	2023年 8月25 日	6个月	新股流通 受限	21.77	29.58	76	1,654.52	2,248.08	-
603273	天元智能	2023年 10月16 日	6个月	新股流通 受限	9.50	18.97	133	1,263.50	2,523.01	-
603275	众辰科技	2023年 8月16 日	6个月	新股流通 受限	49.97	39.70	48	2,398.56	1,905.60	-
603276	恒兴新材	2023年 9月18 日	6个月	新股流通 受限	25.73	24.88	67	1,723.91	1,666.96	-
603296	华勤技术	2023年 8月1日	6个月	新股流通 受限	80.80	77.75	52	4,201.60	4,043.00	-
688548	广钢气体	2023年 8月8日	6个月	新股流通 受限	9.87	12.75	585	5,773.95	7,458.75	-
688549	中巨芯-U	2023年 8月30 日	6个月	新股流通 受限	5.18	8.09	1,203	6,231.54	9,732.27	-
688573	信宇人	2023年 8月9日	6个月	新股流通 受限	23.68	28.80	244	5,777.92	7,027.20	-
688648	中邮科技	2023年 11月6 日	6个月	新股流通 受限	15.18	21.43	255	3,870.90	5,464.65	-
688652	京仪装备	2023年 11月22 日	6个月	新股流通 受限	31.95	52.25	117	3,738.15	6,113.25	-
688653	康希通信	2023年 11月10 日	6个月	新股流通 受限	10.50	15.99	354	3,717.00	5,660.46	-
688657	浩辰软件	2023年 9月25 日	6个月	新股流通 受限	103.40	78.23	37	3,825.80	2,894.51	-
688693	锆威特	2023年 8月10 日	6个月	新股流通 受限	40.83	43.41	89	3,633.87	3,863.49	-

688702	盛科通信-U	2023年9月6日	6个月	新股流通受限	42.66	48.18	103	4,393.98	4,962.54	-
688719	爱科赛博	2023年9月20日	6个月	新股流通受限	69.98	60.10	65	4,548.70	3,906.50	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股流通受限	28.03	49.84	110	3,083.30	5,482.40	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金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

本基金本报告期末无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

本基金本报告期末无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

本基金为混合型基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制风险的前提下为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的长期稳定回报。

本基金的基金管理人内部风险控制机制分为“决策系统”、“执行系统”和“监督系统”三个方面：(1)决策系统由股东会、董事会、公司经营层下设的投资决策委员会和风险管理委员会组成；(2)执行系统由公司各职能部门组成，承担公司日常经营管理、风险控制、基金投资运作活动和具体工作，负责将公司决策系统的各项决议付诸实施；(3)监督系统由监事会、董事会及其下设的审计委员会、督察长、合规稽核部、风险控制部组成。各自监督的内容和对象分别由公司章程及相应的专门制度加以明确规定。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小。

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，本基金未持有债券（2022 年 12 月 31 日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券）。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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 2023 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本报告期末，本基金组合资产中经确认的当日净赎回金额不超过 7 个工作日可变现资产的账面价值。

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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

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							
货币资金	26,788,079.14	-	-	-	-	-	26,788,079.14
结算备付金	1,652,445.44	-	-	-	-	-	1,652,445.44
存出保证金	93,364.31	-	-	-	-	-	93,364.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-133,740,298.95	133,740,298.95
应收申购款	-	-	-	-	-	14,179.41	14,179.41
应收清算款	-	-	-	-	-	204,303.69	204,303.69
资产总计	28,533,888.89	-	-	-	-	-133,958,782.05	162,492,670.94
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	621,458.05	621,458.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	164,064.14	164,064.14
应付托管费	-	-	-	-	-	27,344.03	27,344.03
应付清算款	-	-	-	-	-	1,591,256.92	1,591,256.92
其他负债	-	-	-	-	-	451,716.19	451,716.19
负债总计	-	-	-	-	-	2,855,839.33	2,855,839.33
利率敏感度缺口	28,533,888.89	-	-	-	-	-131,102,942.72	159,636,831.61
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	8,019,835.99	-	-	-	-	-	8,019,835.99
结算备付金	1,050,491.35	-	-	-	-	-	1,050,491.35
存出保证金	112,200.42	-	-	-	-	-	112,200.42
交易性金融资产	-	-	-9,911,686.81	-	-	-187,729,362.79	197,641,049.60
应收申购款	-	-	-	-	-	15,974.87	15,974.87
资产总计	9,182,527.76	-	-9,911,686.81	-	-	-187,745,337.66	206,839,552.23
负债							

应付赎回款	-	-	-	-	70,226.19	70,226.19
应付管理人报酬	-	-	-	-	271,298.73	271,298.73
应付托管费	-	-	-	-	45,216.46	45,216.46
其他负债	-	-	-	-	463,295.06	463,295.06
负债总计	-	-	-	-	850,036.44	850,036.44
利率敏感度缺口	9,182,527.76	-9,911,686.81	-	-	-186,895,301.22	205,989,515.79

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的到期日予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2022 年 12 月 31 日：4.81%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2022 年 12 月 31 日：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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者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、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试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	133,740,298.95	83.78	187,729,362.79	91.14
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	133,740,298.95	83.78	187,729,362.79	91.14

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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）
	沪深 300 指数上升 5%	5,161,856.95	7,585,563.92
	沪深 300 指数下降 5%	-5,161,856.95	-7,585,563.92

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	133,428,275.51	187,232,208.23
第二层次	-	9,911,686.81
第三层次	312,023.44	497,154.56
合计	133,740,298.95	197,641,049.60

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

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	0.00	497,154.56	497,154.56
当期购买	0.00	436,329.57	436,329.57
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	1,804,581.19	1,804,581.19
当期利得或损失总额	0.00	1,183,120.50	1,183,120.50
其中：计入损益的利得或损失	0.00	1,183,120.50	1,183,120.50
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	312,023.44	312,023.44
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一	0.00	53,267.65	53,267.65

一公允价值变动损益			
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	0.00	3,188,854.24	3,188,854.24
当期购买	0.00	979,198.17	979,198.17
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	5,920,598.04	5,920,598.04
当期利得或损失总额	0.00	2,249,700.19	2,249,700.19
其中：计入损益的利得或损失	0.00	2,249,700.19	2,249,700.19
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	497,154.56	497,154.56
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	0.00	-55,494.55	-55,494.55

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资（2022 年 12 月 31 日：同）。于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2022 年 12 月 31 日：同）。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	312,023.44	平均价格亚式期权模型	预期波动率	14.62%-219.88%	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
股票投资	497,154.56	平均价格亚	预期波动率	21.27%-247.56%	负相关

		式期权模型			
--	--	-------	--	--	--

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	133,740,298.95	82.31
	其中：股票	133,740,298.95	82.31
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	28,440,524.58	17.50
8	其他各项资产	311,847.41	0.19
9	合计	162,492,670.94	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	289,730.00	0.18
B	采矿业	4,922,530.84	3.08
C	制造业	86,461,527.88	54.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,215,409.00	0.76
E	建筑业	1,554,358.18	0.97
F	批发和零售业	2,954,158.77	1.85

G	交通运输、仓储和邮政业	3,080,722.77	1.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,671,758.90	7.94
J	金融业	10,934,527.59	6.85
K	房地产业	1,300,017.00	0.81
L	租赁和商务服务业	975,687.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	2,698,403.85	1.69
N	水利、环境和公共设施管理业	2,041,099.03	1.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	186,375.00	0.12
Q	卫生和社会工作	1,589,260.14	1.00
R	文化、体育和娱乐业	820,370.00	0.51
S	综合	44,363.00	0.03
	合计	133,740,298.95	83.78

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

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	601288	农业银行	945,200	3,440,528.00	2.16
2	600519	贵州茅台	1,909	3,294,934.00	2.06
3	300750	宁德时代	13,882	2,266,375.32	1.42
4	300308	中际旭创	19,400	2,190,454.00	1.37
5	600030	中信证券	96,600	1,967,742.00	1.23
6	000333	美的集团	33,442	1,826,936.46	1.14
7	002050	三花智控	57,400	1,687,560.00	1.06
8	000063	中兴通讯	63,400	1,678,832.00	1.05
9	300760	迈瑞医疗	5,700	1,656,420.00	1.04
10	601899	紫金矿业	131,604	1,639,785.84	1.03
11	600809	山西汾酒	6,977	1,609,803.21	1.01
12	688012	中微公司	10,387	1,595,443.20	1.00
13	002304	洋河股份	14,488	1,592,231.20	1.00
14	300015	爱尔眼科	99,800	1,578,836.00	0.99
15	600276	恒瑞医药	34,732	1,570,928.36	0.98
16	603444	吉比特	6,400	1,568,768.00	0.98
17	601138	工业富联	100,000	1,512,000.00	0.95
18	603259	药明康德	20,660	1,503,221.60	0.94
19	600309	万华化学	18,800	1,444,216.00	0.90
20	000568	泸州老窖	8,006	1,436,436.52	0.90
21	300274	阳光电源	14,515	1,271,368.85	0.80

22	688320	禾川科技	26,402	1,082,482.00	0.68
23	002371	北方华创	3,491	857,773.61	0.54
24	000858	五粮液	6,095	855,189.45	0.54
25	002215	诺普信	97,900	808,654.00	0.51
26	600640	国脉文化	70,100	804,047.00	0.50
27	601966	玲珑轮胎	41,200	792,276.00	0.50
28	600426	华鲁恒升	28,484	785,873.56	0.49
29	002068	黑猫股份	66,800	774,880.00	0.49
30	300502	新易盛	14,900	734,868.00	0.46
31	300002	神州泰岳	72,700	643,395.00	0.40
32	600028	中国石化	91,300	509,454.00	0.32
33	300059	东方财富	35,900	504,036.00	0.32
34	300627	华测导航	15,900	493,218.00	0.31
35	601088	中国神华	15,700	492,195.00	0.31
36	601006	大秦铁路	67,700	488,117.00	0.31
37	601398	工商银行	102,000	487,560.00	0.31
38	600282	南钢股份	130,800	483,960.00	0.30
39	601328	交通银行	83,800	481,012.00	0.30
40	600997	开滦股份	62,800	479,164.00	0.30
41	600177	雅戈尔	72,700	476,185.00	0.30
42	600015	华夏银行	84,300	473,766.00	0.30
43	600019	宝钢股份	79,800	473,214.00	0.30
44	600782	新钢股份	131,200	457,888.00	0.29
45	300033	同花顺	2,872	450,530.64	0.28
46	300624	万兴科技	4,300	406,780.00	0.25
47	600926	杭州银行	39,995	400,349.95	0.25
48	300418	昆仑万维	10,300	385,220.00	0.24
49	300832	新产业	4,800	375,360.00	0.24
50	300678	中科信息	12,300	368,754.00	0.23
51	300573	兴齐眼药	2,000	364,640.00	0.23
52	300017	网宿科技	45,800	359,530.00	0.23
53	300001	特锐德	17,800	357,780.00	0.22
54	300693	盛弘股份	11,800	352,938.00	0.22
55	300910	瑞丰新材	7,600	349,144.00	0.22
56	300036	超图软件	16,700	349,030.00	0.22
57	601225	陕西煤业	16,600	346,774.00	0.22
58	300024	机器人	28,600	339,482.00	0.21
59	300525	博思软件	22,700	338,684.00	0.21
60	300124	汇川技术	5,300	334,642.00	0.21
61	600585	海螺水泥	14,700	331,632.00	0.21
62	603886	元祖股份	18,100	329,963.00	0.21
63	300130	新国都	13,600	329,120.00	0.21
64	300316	晶盛机电	7,400	326,266.00	0.20

65	300724	捷佳伟创	4,400	325,644.00	0.20
66	300075	数字政通	18,500	325,600.00	0.20
67	600808	马钢股份	119,600	325,312.00	0.20
68	300541	先进数通	21,100	324,729.00	0.20
69	600985	淮北矿业	19,500	324,285.00	0.20
70	600295	鄂尔多斯	33,400	323,980.00	0.20
71	300315	掌趣科技	62,800	323,420.00	0.20
72	300433	蓝思科技	24,500	323,400.00	0.20
73	600755	厦门国贸	46,300	322,711.00	0.20
74	601998	中信银行	60,900	322,161.00	0.20
75	600057	厦门象屿	47,700	320,067.00	0.20
76	300009	安科生物	31,300	319,886.00	0.20
77	601666	平煤股份	27,600	319,056.00	0.20
78	300456	赛微电子	13,200	317,328.00	0.20
79	300855	图南股份	10,500	317,100.00	0.20
80	600188	兖矿能源	16,000	316,960.00	0.20
81	300633	开立医疗	6,700	316,910.00	0.20
82	600325	华发股份	43,900	316,519.00	0.20
83	300296	利亚德	52,700	316,200.00	0.20
84	600971	恒源煤电	28,300	315,545.00	0.20
85	600398	海澜之家	42,500	315,350.00	0.20
86	600153	建发股份	32,700	314,901.00	0.20
87	600377	宁沪高速	30,700	314,675.00	0.20
88	600350	山东高速	45,300	314,382.00	0.20
89	300487	蓝晓科技	5,900	313,054.00	0.20
90	600801	华新水泥	25,100	311,993.00	0.20
91	600548	深高速	34,500	310,155.00	0.19
92	300285	国瓷材料	13,400	309,808.00	0.19
93	300408	三环集团	10,500	309,225.00	0.19
94	600395	盘江股份	50,000	308,500.00	0.19
95	600479	千金药业	28,500	306,945.00	0.19
96	600546	山煤国际	17,400	304,674.00	0.19
97	300168	万达信息	35,800	303,584.00	0.19
98	601000	唐山港	86,700	303,450.00	0.19
99	688606	奥泰生物	4,398	301,702.80	0.19
100	300476	胜宏科技	16,300	300,735.00	0.19
101	300494	盛天网络	19,016	300,642.96	0.19
102	300146	汤臣倍健	17,600	299,728.00	0.19
103	300773	拉卡拉	18,600	298,344.00	0.19
104	300782	卓胜微	2,100	296,100.00	0.19
105	301039	中集车辆	31,400	294,532.00	0.18
106	300638	广和通	15,400	293,062.00	0.18
107	300866	安克创新	3,300	292,380.00	0.18

108	601098	中南传媒	27,300	277,641.00	0.17
109	300474	景嘉微	3,900	275,769.00	0.17
110	600757	长江传媒	36,900	274,905.00	0.17
111	300454	深信服	3,800	274,702.00	0.17
112	601928	凤凰传媒	30,400	267,824.00	0.17
113	300576	容大感光	6,800	266,968.00	0.17
114	300896	爱美客	900	264,897.00	0.17
115	600678	四川金顶	31,600	254,380.00	0.16
116	301067	显盈科技	7,500	252,075.00	0.16
117	300637	扬帆新材	23,800	247,758.00	0.16
118	600234	科新发展	27,300	236,418.00	0.15
119	603037	凯众股份	11,200	233,072.00	0.15
120	000890	法尔胜	42,700	231,861.00	0.15
121	600272	开开实业	19,300	218,862.00	0.14
122	603089	正裕工业	19,000	218,120.00	0.14
123	301131	聚赛龙	4,300	217,150.00	0.14
124	603329	上海雅仕	13,600	216,784.00	0.14
125	002058	威尔泰	15,400	214,368.00	0.13
126	600689	上海三毛	18,100	209,417.00	0.13
127	300920	润阳科技	9,900	208,395.00	0.13
128	300703	创源股份	18,100	203,444.00	0.13
129	002295	精艺股份	24,900	203,433.00	0.13
130	300417	南华仪器	16,200	203,310.00	0.13
131	300535	达威股份	11,500	201,365.00	0.13
132	002830	名雕股份	13,500	201,015.00	0.13
133	300883	龙利得	27,300	200,655.00	0.13
134	600128	苏豪弘业	20,500	200,490.00	0.13
135	000668	荣丰控股	15,700	199,390.00	0.12
136	300321	同大股份	10,300	199,305.00	0.12
137	301036	双乐股份	8,944	198,288.48	0.12
138	600493	凤竹纺织	29,400	197,568.00	0.12
139	300956	英力股份	10,600	197,478.00	0.12
140	688260	昀冢科技	6,500	196,950.00	0.12
141	001202	炬申股份	11,200	196,784.00	0.12
142	688129	东来技术	11,880	196,614.00	0.12
143	603080	新疆火炬	11,800	196,588.00	0.12
144	300621	维业股份	17,100	196,479.00	0.12
145	300819	聚杰微纤	12,600	195,930.00	0.12
146	002247	聚力文化	83,700	195,858.00	0.12
147	002826	易明医药	16,500	195,855.00	0.12
148	603860	中公高科	6,300	195,615.00	0.12
149	300644	南京聚隆	9,400	195,050.00	0.12
150	301075	多瑞医药	7,300	194,691.00	0.12

151	600319	亚星化学	33,600	194,208.00	0.12
152	002802	洪汇新材	15,100	193,431.00	0.12
153	301259	艾布鲁	11,700	193,401.00	0.12
154	301234	五洲医疗	5,700	193,116.00	0.12
155	301032	新柴股份	19,000	192,470.00	0.12
156	002098	浔兴股份	28,800	192,384.00	0.12
157	301156	美农生物	10,200	192,372.00	0.12
158	000856	冀东装备	20,100	192,357.00	0.12
159	600235	民丰特纸	31,300	192,182.00	0.12
160	300626	华瑞股份	17,700	192,045.00	0.12
161	603139	康惠制药	10,200	191,454.00	0.12
162	001211	双枪科技	7,900	190,864.00	0.12
163	002888	惠威科技	7,600	190,760.00	0.12
164	002767	先锋电子	11,800	189,744.00	0.12
165	300126	锐奇股份	26,500	189,475.00	0.12
166	688067	爱威科技	7,950	189,289.50	0.12
167	600444	国机通用	12,600	189,000.00	0.12
167	605180	华生科技	13,500	189,000.00	0.12
168	603813	原尚股份	11,700	188,955.00	0.12
169	600232	金鹰股份	31,000	187,860.00	0.12
170	603320	迪贝电气	11,800	187,738.00	0.12
171	301081	严牌股份	16,900	187,590.00	0.12
172	300899	上海凯鑫	6,900	187,542.00	0.12
173	300931	通用电梯	22,200	187,368.00	0.12
174	301037	保立佳	9,400	187,342.00	0.12
175	600083	博信股份	23,500	187,295.00	0.12
176	301113	雅艺科技	5,800	187,166.00	0.12
177	600692	亚通股份	30,000	186,900.00	0.12
178	600455	博通股份	7,500	186,375.00	0.12
179	600768	宁波富邦	15,700	186,045.00	0.12
180	600137	浪莎股份	10,200	185,844.00	0.12
181	600539	狮头股份	25,900	185,703.00	0.12
182	300385	雪浪环境	27,600	185,472.00	0.12
183	002836	新宏泽	21,100	184,625.00	0.12
184	300984	金沃股份	6,600	184,536.00	0.12
185	603637	镇海股份	20,500	184,500.00	0.12
186	600883	博闻科技	21,700	184,450.00	0.12
187	605255	天普股份	10,500	184,275.00	0.12
188	000632	三木集团	40,300	184,171.00	0.12
189	301288	清研环境	9,700	184,106.00	0.12
190	301053	远信工业	6,600	183,876.00	0.12
191	600082	海泰发展	53,200	183,540.00	0.11
192	000638	万方发展	27,300	183,456.00	0.11

193	603022	新通联	17,800	183,340.00	0.11
194	000608	阳光股份	63,600	183,168.00	0.11
195	603580	艾艾精工	12,300	183,147.00	0.11
196	003003	天元股份	15,900	182,691.00	0.11
197	300929	华骐环保	15,000	182,550.00	0.11
198	002890	弘宇股份	11,800	182,310.00	0.11
199	688616	西力科技	13,350	182,094.00	0.11
200	002278	神开股份	31,000	181,970.00	0.11
201	002357	富临运业	24,100	181,955.00	0.11
202	300640	德艺文创	28,300	181,686.00	0.11
203	002188	中天服务	27,600	181,608.00	0.11
204	603356	华菱精工	12,400	181,412.00	0.11
205	300955	嘉亨家化	8,200	181,302.00	0.11
206	300992	泰福泵业	8,400	181,272.00	0.11
207	605155	西大门	11,700	181,116.00	0.11
208	300886	华业香料	7,300	180,821.00	0.11
209	300823	建科机械	8,400	180,684.00	0.11
210	002883	中设股份	14,700	180,516.00	0.11
211	002899	英派斯	10,900	180,395.00	0.11
212	688092	爱科科技	5,850	179,946.00	0.11
213	601166	兴业银行	11,100	179,931.00	0.11
214	002629	仁智股份	45,600	179,664.00	0.11
215	300960	通业科技	8,100	179,658.00	0.11
216	605003	众望布艺	9,100	179,634.00	0.11
217	688528	秦川物联	16,200	179,010.00	0.11
218	300923	研奥股份	7,300	178,996.00	0.11
219	002144	宏达高科	15,400	178,948.00	0.11
220	300961	深水海纳	15,900	178,557.00	0.11
221	300854	中兰环保	10,200	177,990.00	0.11
222	000691	亚太实业	35,100	177,957.00	0.11
223	688296	和达科技	9,900	177,903.00	0.11
224	688607	康众医疗	8,700	177,306.00	0.11
225	600674	川投能源	11,700	176,904.00	0.11
226	002193	如意集团	26,700	176,754.00	0.11
227	301049	超越科技	7,600	176,016.00	0.11
228	688193	仁度生物	3,900	175,968.00	0.11
229	688466	金科环境	9,900	175,725.00	0.11
230	300907	康平科技	7,900	175,301.00	0.11
231	000953	河化股份	31,900	174,493.00	0.11
232	300995	奇德新材	8,200	174,414.00	0.11
233	301027	华蓝集团	13,900	173,889.00	0.11
234	603272	联翔股份	10,300	173,864.00	0.11
235	003816	中国广核	55,800	173,538.00	0.11

236	301105	鸿铭股份	4,600	173,098.00	0.11
237	300717	华信新材	10,300	172,937.00	0.11
238	300243	瑞丰高材	17,700	172,929.00	0.11
239	000027	深圳能源	26,800	172,860.00	0.11
240	600820	隧道股份	30,000	172,800.00	0.11
241	002778	中晟高科	11,500	172,730.00	0.11
242	301209	联合化学	6,900	172,224.00	0.11
243	301022	海泰科	6,300	171,864.00	0.11
244	002910	庄园牧场	15,700	171,758.00	0.11
245	688367	工大高科	9,600	171,264.00	0.11
246	605368	蓝天燃气	15,900	171,243.00	0.11
247	301300	远翔新材	5,400	170,802.00	0.11
248	002207	准油股份	24,400	170,312.00	0.11
249	688251	井松智能	5,850	170,118.00	0.11
250	001259	利仁科技	6,000	169,920.00	0.11
251	002032	苏泊尔	3,200	169,632.00	0.11
252	300906	日月明	6,700	169,443.00	0.11
253	688681	科汇股份	10,950	169,177.50	0.11
254	301178	天亿马	5,200	168,636.00	0.11
255	688350	富淼科技	10,200	168,606.00	0.11
256	600273	嘉化能源	19,600	168,364.00	0.11
257	000895	双汇发展	6,300	168,273.00	0.11
258	301098	金埔园林	14,200	167,702.00	0.11
259	601298	青岛港	27,100	167,478.00	0.10
260	688215	瑞晟智能	4,650	167,167.50	0.10
261	601866	中远海发	71,300	166,842.00	0.10
262	003017	大洋生物	6,860	166,835.20	0.10
263	688038	中科通达	11,550	166,435.50	0.10
264	301057	汇隆新材	9,900	166,320.00	0.10
265	002034	旺能环境	10,900	166,225.00	0.10
266	002545	东方铁塔	23,200	165,880.00	0.10
267	688096	京源环保	17,700	165,849.00	0.10
268	000157	中联重科	25,300	165,209.00	0.10
269	600660	福耀玻璃	4,400	164,516.00	0.10
270	600790	轻纺城	41,400	164,358.00	0.10
271	601229	上海银行	27,500	164,175.00	0.10
272	600901	江苏金租	33,900	164,076.00	0.10
273	000725	京东方 A	42,000	163,800.00	0.10
274	002091	江苏国泰	20,900	163,647.00	0.10
275	002538	司尔特	27,000	163,080.00	0.10
276	600236	桂冠电力	29,400	162,876.00	0.10
277	301167	建研设计	9,600	162,432.00	0.10
278	300635	中达安	12,900	162,282.00	0.10

279	000538	云南白药	3,300	162,195.00	0.10
280	601211	国泰君安	10,900	162,192.00	0.10
281	002966	苏州银行	25,100	162,146.00	0.10
282	301336	趣睡科技	3,700	162,023.00	0.10
283	688013	天臣医疗	7,650	161,415.00	0.10
284	600008	首创环保	60,000	161,400.00	0.10
285	301040	中环海陆	8,500	161,245.00	0.10
286	601009	南京银行	21,800	160,884.00	0.10
287	601187	厦门银行	31,700	160,719.00	0.10
288	600284	浦东建设	25,500	160,650.00	0.10
289	600887	伊利股份	6,000	160,500.00	0.10
290	600668	尖峰集团	14,500	160,225.00	0.10
291	603323	苏农银行	38,500	160,160.00	0.10
292	600064	南京高科	26,500	160,060.00	0.10
293	688178	万德斯	8,850	160,008.00	0.10
294	688009	中国通号	36,500	159,870.00	0.10
295	601860	紫金银行	63,000	159,390.00	0.10
296	000930	中粮科技	24,000	159,360.00	0.10
297	600016	民生银行	42,600	159,324.00	0.10
298	002233	塔牌集团	22,500	159,300.00	0.10
299	600740	山西焦化	31,600	159,264.00	0.10
300	000778	新兴铸管	41,600	158,912.00	0.10
301	600039	四川路桥	21,200	158,788.00	0.10
302	000709	河钢股份	74,500	158,685.00	0.10
303	688171	纬德信息	7,050	158,625.00	0.10
304	600035	楚天高速	41,500	158,530.00	0.10
305	603316	诚邦股份	23,500	158,390.00	0.10
306	600655	豫园股份	25,500	158,355.00	0.10
307	600409	三友化工	28,800	158,112.00	0.10
308	600022	山东钢铁	115,400	158,098.00	0.10
309	603045	福达合金	10,000	157,900.00	0.10
310	688679	通源环境	12,300	157,809.00	0.10
311	600000	浦发银行	23,800	157,556.00	0.10
312	000825	太钢不锈	42,100	157,033.00	0.10
313	002004	华邦健康	33,600	156,576.00	0.10
314	000783	长江证券	29,100	156,558.00	0.10
315	002701	奥瑞金	37,800	156,492.00	0.10
316	600837	海通证券	16,700	156,479.00	0.10
317	002839	张家港行	40,300	156,364.00	0.10
318	600810	神马股份	21,000	156,240.00	0.10
319	600704	物产中大	35,200	155,936.00	0.10
320	000898	鞍钢股份	62,600	155,874.00	0.10
321	600598	北大荒	13,000	155,610.00	0.10

322	601216	君正集团	41,600	155,584.00	0.10
323	688004	博汇科技	5,250	154,192.50	0.10
324	603113	金能科技	19,100	154,137.00	0.10
325	600623	华谊集团	23,900	153,916.00	0.10
326	002030	达安基因	15,900	153,912.00	0.10
327	300521	爱司凯	11,100	153,735.00	0.10
328	601992	金隅集团	80,400	153,564.00	0.10
329	000559	万向钱潮	29,500	153,105.00	0.10
330	002563	森马服饰	26,500	152,905.00	0.10
331	603036	如通股份	10,400	152,880.00	0.10
332	600126	杭钢股份	28,600	152,438.00	0.10
333	600741	华域汽车	9,300	151,404.00	0.09
334	603955	大千生态	10,300	151,307.00	0.09
335	300948	冠中生态	10,500	151,305.00	0.09
336	000401	冀东水泥	23,500	150,165.00	0.09
337	600639	浦东金桥	14,800	149,628.00	0.09
338	000932	华菱钢铁	28,800	148,320.00	0.09
339	002736	国信证券	17,200	146,888.00	0.09
340	600867	通化东宝	13,500	146,205.00	0.09
341	600327	大东方	28,800	144,576.00	0.09
342	000717	中南股份	56,700	144,018.00	0.09
343	600104	上汽集团	10,600	143,418.00	0.09
344	600742	一汽富维	14,900	142,295.00	0.09
345	300980	祥源新材	5,900	138,414.00	0.09
346	688021	奥福环保	6,600	137,610.00	0.09
347	300106	西部牧业	14,000	134,120.00	0.08
348	603238	诺邦股份	9,300	127,875.00	0.08
349	603041	美思德	9,500	127,870.00	0.08
350	603090	宏盛股份	5,400	127,008.00	0.08
351	301065	本立科技	5,500	125,125.00	0.08
352	300947	德必集团	7,900	123,951.00	0.08
353	300564	筑博设计	9,200	123,832.00	0.08
354	603150	万朗磁塑	4,200	122,010.00	0.08
355	301043	绿岛风	3,700	121,101.00	0.08
356	301008	宏昌科技	4,000	120,760.00	0.08
357	301233	盛帮股份	2,700	119,934.00	0.08
358	002105	信隆健康	18,500	119,880.00	0.08
359	300789	唐源电气	5,300	119,462.00	0.07
360	605081	太和水	8,600	119,368.00	0.07
361	300658	延江股份	17,500	118,475.00	0.07
362	688669	聚石化学	6,300	118,062.00	0.07
363	001296	长江材料	5,000	117,650.00	0.07
364	300509	新美星	16,200	117,126.00	0.07

365	301130	西点药业	4,200	117,096.00	0.07
366	301055	张小泉	8,100	116,802.00	0.07
367	003023	彩虹集团	5,700	115,482.00	0.07
368	605298	必得科技	7,400	115,366.00	0.07
369	300971	博亚精工	4,500	112,050.00	0.07
370	001336	楚环科技	3,900	112,008.00	0.07
371	603810	丰山集团	8,300	110,971.00	0.07
372	600857	宁波中百	11,700	110,331.00	0.07
373	301359	东南电子	4,094	108,941.34	0.07
374	301125	腾亚精工	5,640	106,708.80	0.07
375	301010	晶雪节能	5,700	106,533.00	0.07
376	301182	凯旺科技	4,500	105,210.00	0.07
377	603506	南都物业	9,600	104,352.00	0.07
378	688655	迅捷兴	6,900	104,190.00	0.07
379	300743	天地数码	7,400	102,712.00	0.06
380	688217	睿昂基因	2,844	101,758.32	0.06
381	301273	瑞晨环保	3,600	99,324.00	0.06
382	002952	亚世光电	2,500	96,900.00	0.06
383	301192	泰祥股份	4,100	94,136.00	0.06
384	300857	协创数据	1,400	74,186.00	0.05
385	601021	春秋航空	1,400	70,280.00	0.04
386	002962	五方光电	2,900	68,063.00	0.04
387	688228	开普云	1,000	65,430.00	0.04
388	300556	丝路视觉	1,700	62,645.00	0.04
389	001339	智微智能	1,700	58,446.00	0.04
390	603052	可川科技	1,300	56,654.00	0.04
391	600571	信雅达	4,100	56,375.00	0.04
392	605218	伟时电子	2,100	54,957.00	0.03
393	002189	中光学	2,300	53,613.00	0.03
394	301205	联特科技	500	52,375.00	0.03
395	002937	兴瑞科技	2,000	52,120.00	0.03
396	002955	鸿合科技	1,600	51,696.00	0.03
397	603283	赛腾股份	700	50,792.00	0.03
398	300354	东华测试	1,000	49,670.00	0.03
399	002587	奥拓电子	5,700	48,849.00	0.03
400	300691	联合光电	2,100	48,699.00	0.03
401	688283	坤恒顺维	700	48,041.00	0.03
402	300351	永贵电器	2,300	47,656.00	0.03
403	688378	奥来德	1,000	47,340.00	0.03
404	000409	云鼎科技	5,100	47,226.00	0.03
405	688039	当虹科技	1,300	47,008.00	0.03
406	301153	中科江南	600	46,962.00	0.03
407	301313	凡拓数创	1,300	46,878.00	0.03

408	688170	德龙激光	1,200	46,860.00	0.03
409	300389	艾比森	2,700	46,818.00	0.03
410	002976	瑞玛精密	1,300	46,644.00	0.03
411	301278	快可电子	800	46,600.00	0.03
412	002983	芯瑞达	1,500	46,290.00	0.03
413	688025	杰普特	500	46,275.00	0.03
414	002362	汉王科技	1,800	46,116.00	0.03
415	301318	维海德	1,300	46,033.00	0.03
416	301391	卡莱特	400	45,792.00	0.03
417	600353	旭光电子	5,000	45,700.00	0.03
418	300793	佳禾智能	2,100	45,591.00	0.03
419	603386	骏亚科技	3,300	45,540.00	0.03
420	300620	光库科技	1,000	45,300.00	0.03
421	002972	科安达	3,500	45,255.00	0.03
422	301280	珠城科技	1,100	45,188.00	0.03
423	300684	中石科技	2,100	45,129.00	0.03
424	002947	恒铭达	1,400	45,052.00	0.03
425	300081	恒信东方	3,900	45,045.00	0.03
426	301051	信濠光电	700	44,569.00	0.03
427	600288	大恒科技	3,900	44,382.00	0.03
428	000532	华金资本	3,700	44,363.00	0.03
429	301266	宇邦新材	800	44,296.00	0.03
430	688668	鼎通科技	800	44,256.00	0.03
431	002876	三利谱	1,200	44,124.00	0.03
432	301326	捷邦科技	1,100	44,121.00	0.03
433	002577	雷柏科技	2,500	44,075.00	0.03
434	003028	振邦智能	1,000	44,060.00	0.03
435	300882	万胜智能	1,800	43,848.00	0.03
436	301396	宏景科技	1,300	43,745.00	0.03
437	300162	雷曼光电	5,400	43,740.00	0.03
438	002449	国星光电	4,600	43,562.00	0.03
439	603703	盛洋科技	3,400	43,554.00	0.03
440	300909	汇创达	1,400	43,540.00	0.03
441	600071	凤凰光学	1,900	43,529.00	0.03
442	603890	春秋电子	3,800	43,510.00	0.03
443	300516	久之洋	1,300	43,498.00	0.03
444	300572	安车检测	2,400	43,368.00	0.03
445	688595	芯海科技	1,000	43,300.00	0.03
446	002655	共达电声	3,200	43,296.00	0.03
447	300884	狄耐克	3,300	43,164.00	0.03
448	002315	焦点科技	1,300	43,069.00	0.03
449	002835	同为股份	2,400	43,056.00	0.03
450	301330	熵基科技	1,300	43,030.00	0.03

451	300566	激智科技	2,300	42,964.00	0.03
452	300570	太辰光	1,100	42,955.00	0.03
453	003019	宸展光电	1,900	42,940.00	0.03
454	300739	明阳电路	2,800	42,868.00	0.03
455	001229	魅视科技	1,200	42,720.00	0.03
456	688630	芯碁微装	500	42,685.00	0.03
457	301380	挖金客	900	42,624.00	0.03
458	300543	朗科智能	3,900	42,588.00	0.03
459	300976	达瑞电子	800	42,584.00	0.03
460	002658	雪迪龙	5,300	42,559.00	0.03
461	002866	传艺科技	2,000	42,440.00	0.03
462	002264	新华都	7,700	42,427.00	0.03
462	600537	亿晶光电	7,700	42,427.00	0.03
463	300514	友讯达	2,600	42,380.00	0.03
464	003015	日久光电	3,600	42,336.00	0.03
465	300932	三友联众	2,600	42,328.00	0.03
466	300790	宇瞳光学	2,600	42,302.00	0.03
467	300241	瑞丰光电	7,500	42,225.00	0.03
468	300410	正业科技	4,800	42,192.00	0.03
469	300730	科创信息	3,100	42,160.00	0.03
470	300590	移为通信	3,500	42,035.00	0.03
471	688207	格灵深瞳	2,000	41,920.00	0.03
472	688049	炬芯科技	1,100	41,877.00	0.03
473	688689	银河微电	1,500	41,805.00	0.03
474	600237	铜峰电子	5,400	41,796.00	0.03
475	300847	中船汉光	2,400	41,712.00	0.03
476	300939	秋田微	1,100	41,668.00	0.03
477	300632	光莆股份	3,300	41,646.00	0.03
478	300785	值得买	1,900	41,534.00	0.03
479	603083	剑桥科技	1,100	41,492.00	0.03
480	301379	天山电子	1,400	41,426.00	0.03
481	300843	胜蓝股份	1,800	41,364.00	0.03
482	300771	智莱科技	3,800	41,306.00	0.03
483	300219	鸿利智汇	4,900	41,258.00	0.03
484	002296	辉煌科技	5,000	41,250.00	0.03
485	300941	创识科技	1,700	41,242.00	0.03
486	000823	超声电子	4,300	41,151.00	0.03
487	300288	朗玛信息	2,500	41,125.00	0.03
488	002609	捷顺科技	3,600	41,112.00	0.03
489	300306	远方信息	3,400	41,072.00	0.03
490	688618	三旺通信	700	41,020.00	0.03
491	002819	东方中科	1,600	40,976.00	0.03
492	300440	运达科技	5,500	40,975.00	0.03

493	002897	意华股份	1,100	40,876.00	0.03
494	002354	天娱数科	7,400	40,848.00	0.03
495	603508	思维列控	2,600	40,820.00	0.03
496	301221	光庭信息	700	40,810.00	0.03
497	688386	泛亚微透	1,000	40,800.00	0.03
498	688259	创耀科技	600	40,758.00	0.03
499	300987	川网传媒	2,300	40,756.00	0.03
500	300560	中富通	2,300	40,733.00	0.03
501	301099	雅创电子	800	40,680.00	0.03
502	300120	经纬辉开	5,600	40,656.00	0.03
503	688579	山大地纬	3,200	40,640.00	0.03
504	300835	龙磁科技	1,400	40,614.00	0.03
505	300708	聚灿光电	3,600	40,608.00	0.03
506	002881	美格智能	1,500	40,590.00	0.03
507	301195	北路智控	1,000	40,580.00	0.03
507	688080	映翰通	1,000	40,580.00	0.03
508	301139	元道通信	1,200	40,572.00	0.03
509	301041	金百泽	1,500	40,530.00	0.03
510	300975	商络电子	4,900	40,523.00	0.03
511	603496	恒为科技	1,300	40,508.00	0.03
512	688588	凌志软件	3,400	40,460.00	0.03
513	300831	派瑞股份	3,300	40,458.00	0.03
514	300548	博创科技	1,500	40,455.00	0.03
515	300814	中富电路	1,200	40,440.00	0.03
516	603421	鼎信通讯	4,300	40,420.00	0.03
517	002376	新北洋	5,300	40,386.00	0.03
518	688225	亚信安全	2,200	40,348.00	0.03
519	688078	龙软科技	1,000	40,320.00	0.03
520	300248	新开普	4,200	40,278.00	0.03
521	300903	科翔股份	4,000	40,240.00	0.03
522	603633	徕木股份	4,200	40,236.00	0.03
523	300099	尤洛卡	6,500	40,235.00	0.03
524	301132	满坤科技	1,400	40,194.00	0.03
525	688135	利扬芯片	1,800	40,158.00	0.03
526	300802	矩子科技	2,100	40,152.00	0.03
527	300698	万马科技	1,100	40,150.00	0.03
528	300468	四方精创	3,700	40,145.00	0.03
529	688246	嘉和美康	1,200	40,104.00	0.03
530	301389	隆扬电子	2,100	40,068.00	0.03
531	301366	一博科技	1,200	40,044.00	0.03
532	688112	鼎阳科技	1,000	40,040.00	0.03
533	300645	正元智慧	2,200	40,018.00	0.03
534	603327	福蓉科技	3,000	39,990.00	0.03

535	300563	神宇股份	2,500	39,975.00	0.03
536	301285	鸿日达	2,500	39,950.00	0.03
537	000836	富通信息	14,900	39,932.00	0.03
538	688589	力合微	1,000	39,910.00	0.03
539	301123	奕东电子	1,700	39,882.00	0.02
540	002148	北纬科技	6,600	39,864.00	0.02
540	002401	中远海科	2,200	39,864.00	0.02
541	300531	优博讯	2,600	39,858.00	0.02
542	688183	生益电子	3,500	39,795.00	0.02
543	600228	返利科技	5,100	39,780.00	0.02
544	301270	汉仪股份	1,000	39,750.00	0.02
545	300872	天阳科技	2,900	39,672.00	0.02
545	300895	铜牛信息	1,200	39,672.00	0.02
546	603869	新智认知	4,200	39,648.00	0.02
547	300213	佳讯飞鸿	5,500	39,600.00	0.02
548	688195	腾景科技	1,100	39,589.00	0.02
549	688103	国力股份	800	39,504.00	0.02
550	300667	必创科技	2,300	39,468.00	0.02
551	301021	英诺激光	1,500	39,465.00	0.02
552	300546	雄帝科技	2,500	39,425.00	0.02
553	002213	大为股份	2,800	39,396.00	0.02
554	003026	中晶科技	1,100	39,380.00	0.02
555	300542	新晨科技	3,000	39,300.00	0.02
556	300656	民德电子	1,600	39,248.00	0.02
557	603738	泰晶科技	2,400	39,240.00	0.02
558	300227	光韵达	5,000	39,200.00	0.02
559	688766	普冉股份	400	39,192.00	0.02
560	688325	赛微微电	1,000	39,190.00	0.02
561	603206	嘉环科技	2,200	39,182.00	0.02
562	301328	维峰电子	800	39,168.00	0.02
563	300520	科大国创	1,800	39,132.00	0.02
564	300032	金龙机电	6,200	39,122.00	0.02
565	002093	国脉科技	5,200	39,104.00	0.02
565	300916	朗特智能	1,600	39,104.00	0.02
566	301208	中亦科技	1,000	39,040.00	0.02
567	300913	兆龙互连	1,300	39,039.00	0.02
568	002232	启明信息	2,300	38,985.00	0.02
569	002977	火箭科技	1,100	38,962.00	0.02
570	300629	新劲刚	1,800	38,934.00	0.02
571	300996	普联软件	1,700	38,930.00	0.02
572	300137	先河环保	7,000	38,920.00	0.02
573	605258	协和电子	1,400	38,878.00	0.02
574	603933	睿能科技	2,500	38,875.00	0.02

575	300951	博硕科技	600	38,868.00	0.02
576	300571	平治信息	1,100	38,863.00	0.02
577	600756	浪潮软件	2,800	38,836.00	0.02
578	300706	阿石创	1,500	38,820.00	0.02
579	002288	超华科技	8,900	38,804.00	0.02
580	002119	康强电子	2,900	38,773.00	0.02
581	301248	杰创智能	2,200	38,742.00	0.02
582	600345	长江通信	2,000	38,740.00	0.02
583	688216	气派科技	1,400	38,738.00	0.02
584	300353	东土科技	4,000	38,720.00	0.02
585	300711	广哈通信	2,900	38,715.00	0.02
586	300787	海能实业	2,300	38,686.00	0.02
587	301183	东田微	900	38,646.00	0.02
588	000561	烽火电子	4,600	38,640.00	0.02
589	002642	荣联科技	4,500	38,610.00	0.02
590	002298	中电兴发	6,700	38,592.00	0.02
590	600855	航天长峰	3,600	38,592.00	0.02
591	300766	每日互动	2,500	38,575.00	0.02
592	301176	逸豪新材	2,300	38,571.00	0.02
593	300852	四会富仕	1,000	38,540.00	0.02
594	300042	朗科科技	1,100	38,500.00	0.02
595	688138	清溢光电	1,700	38,454.00	0.02
596	002197	证通电子	3,700	38,443.00	0.02
597	300504	天邑股份	2,100	38,409.00	0.02
598	300936	中英科技	900	38,367.00	0.02
599	300378	鼎捷软件	1,800	38,358.00	0.02
600	002765	蓝黛科技	5,700	38,247.00	0.02
601	600105	永鼎股份	6,900	38,226.00	0.02
602	300046	台基股份	2,400	38,184.00	0.02
603	300020	银江技术	4,600	38,180.00	0.02
604	603186	华正新材	1,100	38,170.00	0.02
605	688682	霍莱沃	800	38,168.00	0.02
606	002077	大港股份	2,500	38,125.00	0.02
607	600198	大唐电信	5,800	38,106.00	0.02
608	001266	宏英智能	1,300	38,090.00	0.02
609	688369	致远互联	1,100	38,071.00	0.02
610	002885	京泉华	2,100	38,052.00	0.02
611	300275	梅安森	3,300	38,049.00	0.02
612	600130	波导股份	7,900	37,999.00	0.02
613	300465	高伟达	3,800	37,962.00	0.02
614	001309	德明利	400	37,956.00	0.02
615	300615	欣天科技	2,400	37,944.00	0.02
616	300252	金信诺	4,100	37,843.00	0.02

617	688279	峰岷科技	300	37,836.00	0.02
618	688181	八亿时空	1,400	37,800.00	0.02
619	300561	汇金科技	3,200	37,760.00	0.02
620	002279	久其软件	5,800	37,758.00	0.02
621	603859	能科科技	1,000	37,730.00	0.02
622	002491	通鼎互联	7,200	37,728.00	0.02
623	002579	中京电子	4,300	37,711.00	0.02
624	688230	芯导科技	900	37,656.00	0.02
625	300518	新讯达	2,200	37,576.00	0.02
626	300292	吴通控股	10,100	37,572.00	0.02
627	002474	榕基软件	5,700	37,506.00	0.02
628	301282	金禄电子	1,500	37,485.00	0.02
629	603990	麦迪科技	2,900	37,468.00	0.02
630	300493	润欣科技	4,400	37,444.00	0.02
631	605277	新亚电子	2,500	37,350.00	0.02
632	300559	佳发教育	2,400	37,200.00	0.02
633	300365	恒华科技	5,500	37,180.00	0.02
634	300830	金现代	4,600	37,122.00	0.02
635	002803	吉宏股份	1,800	37,008.00	0.02
636	300098	高新兴	9,100	36,946.00	0.02
637	301191	菲菱科思	400	36,880.00	0.02
637	688665	四方光电	500	36,880.00	0.02
638	002792	通宇通讯	2,200	36,872.00	0.02
639	603258	电魂网络	1,600	36,768.00	0.02
640	688601	力芯微	700	36,673.00	0.02
641	688661	和林微纳	800	36,656.00	0.02
642	300250	初灵信息	2,100	36,603.00	0.02
643	000045	深纺织 A	3,100	36,580.00	0.02
644	002095	生意宝	1,800	36,486.00	0.02
645	688662	富信科技	1,000	36,450.00	0.02
646	300925	法本信息	3,100	36,425.00	0.02
647	301213	观想科技	900	36,414.00	0.02
648	300113	顺网科技	2,600	36,400.00	0.02
649	301339	通行宝	1,800	36,324.00	0.02
650	301162	国能日新	700	36,316.00	0.02
651	301110	青木股份	900	36,189.00	0.02
652	000948	南天信息	2,400	36,168.00	0.02
653	688519	南亚新材	1,400	36,064.00	0.02
654	688787	海天瑞声	500	36,050.00	0.02
655	300533	冰川网络	1,300	36,010.00	0.02
656	300797	钢研纳克	2,800	35,924.00	0.02
657	001298	好上好	1,200	35,784.00	0.02
658	301218	华是科技	1,100	35,497.00	0.02

659	300964	本川智能	900	35,478.00	0.02
660	301299	卓创资讯	600	35,472.00	0.02
661	605398	新炬网络	1,200	35,448.00	0.02
662	688201	信安世纪	1,800	35,424.00	0.02
663	300870	欧陆通	800	35,416.00	0.02
664	300928	华安鑫创	700	35,308.00	0.02
665	300231	银信科技	3,400	34,986.00	0.02
666	688095	福昕软件	500	34,925.00	0.02
667	301369	联动科技	600	34,722.00	0.02
668	688258	卓易信息	700	34,650.00	0.02
669	603629	利通电子	1,100	34,606.00	0.02
670	603383	顶点软件	700	34,510.00	0.02
671	301085	亚康股份	600	34,446.00	0.02
672	603220	中贝通信	1,000	33,960.00	0.02
673	688182	灿勤科技	1,900	33,782.00	0.02
674	603918	金桥信息	1,800	33,660.00	0.02
675	002919	名臣健康	1,300	33,332.00	0.02
676	300184	力源信息	5,600	33,320.00	0.02
677	688768	容知日新	900	33,129.00	0.02
678	301117	佳缘科技	600	32,706.00	0.02
679	301302	华如科技	1,300	32,643.00	0.02
680	300302	同有科技	2,400	32,496.00	0.02
681	300553	集智股份	900	32,220.00	0.02
682	301297	富乐德	1,100	29,656.00	0.02
683	300551	古鳌科技	1,600	27,840.00	0.02
684	002308	威创股份	7,900	25,596.00	0.02
685	301348	蓝箭电子	288	12,836.16	0.01
686	301383	天键股份	180	11,700.00	0.01
687	301510	固高科技	320	11,203.20	0.01
688	301387	光大同创	154	10,425.80	0.01
689	301293	三博脑科	167	10,424.14	0.01
690	301421	波长光电	171	10,152.27	0.01
691	688549	中巨芯-U	1,203	9,732.27	0.01
692	301381	赛维时代	325	9,649.25	0.01
693	301320	豪江智能	514	9,493.58	0.01
694	301370	国科恒泰	528	8,453.28	0.01
695	301172	君逸数码	219	8,357.04	0.01
696	301307	美利信	238	8,256.22	0.01
697	688352	顾中科技	512	7,889.92	0.00
698	688548	广钢气体	585	7,458.75	0.00
699	301325	曼恩斯特	96	7,443.84	0.00
700	301558	三态股份	551	7,383.40	0.00
701	301499	维科精密	253	7,319.29	0.00

702	301360	荣旗科技	77	7,207.20	0.00
703	301262	海看股份	231	7,195.65	0.00
704	688484	南芯科技	179	7,133.15	0.00
705	688573	信宇人	244	7,027.20	0.00
706	301429	森泰股份	333	6,806.52	0.00
707	301225	恒勃股份	178	6,372.40	0.00
708	688146	中船特气	187	6,359.87	0.00
709	301281	科源制药	185	6,297.40	0.00
710	301507	民生健康	395	6,260.75	0.00
711	688652	京仪装备	117	6,113.25	0.00
712	301516	中远通	374	5,800.74	0.00
713	301413	安培龙	98	5,702.62	0.00
714	301372	科净源	130	5,666.70	0.00
715	688653	康希通信	354	5,660.46	0.00
716	301428	世纪恒通	143	5,526.95	0.00
717	301291	明阳电气	194	5,501.84	0.00
718	688720	艾森股份	110	5,482.40	0.00
719	301498	乖宝宠物	141	5,472.21	0.00
720	688648	中邮科技	255	5,464.65	0.00
721	301508	中机认检	196	5,229.28	0.00
722	301251	威尔高	151	5,223.09	0.00
723	301505	苏州规划	145	5,192.45	0.00
724	301555	惠柏新材	160	5,190.40	0.00
725	688702	盛科通信-U	103	4,962.54	0.00
726	301210	金杨股份	108	4,911.84	0.00
727	688433	华曙高科	155	4,843.75	0.00
728	301357	北方长龙	95	4,795.60	0.00
729	301399	英特科技	125	4,783.75	0.00
730	301469	恒达新材	138	4,566.42	0.00
731	301397	溯联股份	101	4,563.18	0.00
732	301305	朗坤环境	251	4,530.55	0.00
733	301261	恒工精密	88	4,474.80	0.00
734	301459	丰茂股份	112	4,462.08	0.00
735	301393	昊帆生物	75	4,452.75	0.00
736	301468	博盈特焊	147	4,442.34	0.00
737	301519	舜禹股份	218	4,405.78	0.00
738	301376	致欧科技	179	4,281.68	0.00
739	301202	朗威股份	133	4,229.40	0.00
740	301355	南王科技	278	4,211.70	0.00
741	301456	盘古智能	137	4,163.43	0.00
742	301511	德福科技	183	4,148.61	0.00
743	301528	多浦乐	60	4,134.60	0.00
744	301568	思泰克	116	4,127.28	0.00

745	301550	斯菱股份	94	4,098.39	0.00
746	300804	广康生化	132	4,073.52	0.00
747	301272	英华特	76	4,056.88	0.00
748	603296	华勤技术	52	4,043.00	0.00
749	301232	飞沃科技	83	4,024.67	0.00
750	301418	协昌科技	79	3,965.80	0.00
751	301332	德尔玛	323	3,947.06	0.00
752	688719	爱科赛博	65	3,906.50	0.00
753	688693	锆威特	89	3,863.49	0.00
754	301337	亚华电子	125	3,826.25	0.00
755	001287	中电港	171	3,561.93	0.00
756	301525	儒竞科技	41	3,339.86	0.00
757	001380	华纬科技	95	3,309.80	0.00
758	301559	中集环科	177	3,228.48	0.00
759	601061	中信金属	413	3,184.23	0.00
760	301529	福赛科技	84	3,181.92	0.00
761	301500	飞南资源	152	3,175.28	0.00
762	301515	港通医疗	111	3,137.97	0.00
763	301170	锡南科技	103	3,134.29	0.00
764	688657	浩辰软件	37	2,894.51	0.00
765	301548	崇德科技	47	2,772.53	0.00
766	603137	恒尚节能	139	2,727.18	0.00
767	001378	德冠新材	87	2,720.49	0.00
768	001326	联域股份	55	2,675.20	0.00
769	301371	敷尔佳	68	2,555.44	0.00
770	301520	万邦医药	48	2,531.52	0.00
771	603273	天元智能	133	2,523.01	0.00
772	001239	永达股份	122	2,430.24	0.00
773	001328	登康口腔	84	2,378.04	0.00
774	601083	锦江航运	211	2,335.77	0.00
775	603270	金帝股份	76	2,248.08	0.00
776	001282	三联锻造	58	2,097.86	0.00
777	001306	夏厦精密	26	1,959.36	0.00
778	001324	长青科技	80	1,941.60	0.00
779	603275	众辰科技	48	1,905.60	0.00
780	603062	麦加芯彩	29	1,676.49	0.00
781	603276	恒兴新材	67	1,666.96	0.00
782	603107	上海汽配	82	1,491.58	0.00
783	001367	海森药业	33	1,450.68	0.00
784	603075	热威股份	61	1,421.91	0.00
785	603231	索宝蛋白	58	1,248.74	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	300274	阳光电源	12,473,046.85	6.06
2	600809	山西汾酒	10,371,265.00	5.03
3	300750	宁德时代	9,761,723.00	4.74
4	002050	三花智控	9,726,114.18	4.72
5	301015	百洋医药	9,573,126.00	4.65
6	600519	贵州茅台	8,627,000.00	4.19
7	002594	比亚迪	7,894,406.00	3.83
8	002304	洋河股份	7,754,446.00	3.76
9	300763	锦浪科技	7,699,474.00	3.74
10	688596	正帆科技	7,636,036.36	3.71
11	688063	派能科技	7,502,697.91	3.64
12	688556	高测股份	7,395,741.99	3.59
13	002484	江海股份	7,367,226.00	3.58
14	002472	双环传动	7,246,264.00	3.52
15	000792	盐湖股份	7,243,723.00	3.52
16	603529	爱玛科技	7,241,021.00	3.52
17	603305	旭升集团	7,127,241.00	3.46
18	002056	横店东磁	7,017,109.94	3.41
19	603538	美诺华	7,003,026.20	3.40
20	603667	五洲新春	6,976,498.00	3.39
21	603355	莱克电气	6,894,532.00	3.35
22	300308	中际旭创	6,866,779.00	3.33
23	000516	国际医学	6,820,800.00	3.31
24	300438	鹏辉能源	6,763,997.30	3.28
25	603368	柳药集团	6,756,332.00	3.28
26	002318	久立特材	6,733,789.00	3.27
27	300705	九典制药	6,679,926.00	3.24
28	603308	应流股份	6,652,758.00	3.23
29	002006	精工科技	6,636,228.00	3.22
30	601689	拓普集团	6,628,871.00	3.22
31	601137	博威合金	6,595,346.18	3.20
32	000423	东阿阿胶	6,587,402.00	3.20
33	688278	特宝生物	6,554,881.83	3.18
34	688022	瀚川智能	6,507,563.56	3.16
35	000933	神火股份	6,376,662.00	3.10
36	300888	稳健医疗	6,311,280.00	3.06
37	300963	中洲特材	5,876,884.30	2.85
38	000063	中兴通讯	5,848,913.00	2.84

39	002737	葵花药业	5,778,620.00	2.81
40	300443	金雷股份	5,776,071.00	2.80
41	300138	晨光生物	5,775,613.00	2.80
42	300014	亿纬锂能	5,775,025.00	2.80
43	002129	TCL 中环	5,773,258.00	2.80
44	300114	中航电测	5,652,390.33	2.74
45	600603	广汇物流	5,608,999.00	2.72
46	688599	天合光能	5,557,353.95	2.70
47	603298	杭叉集团	5,554,359.00	2.70
48	000906	浙商中拓	5,554,288.00	2.70
49	688012	中微公司	5,503,545.82	2.67
50	000858	五粮液	5,242,089.00	2.54
51	002518	科士达	5,231,806.00	2.54
52	000568	泸州老窖	4,973,366.00	2.41
53	603259	药明康德	4,936,914.00	2.40
54	300092	科新机电	4,890,789.00	2.37
55	300856	科思股份	4,881,579.00	2.37
56	600048	保利发展	4,873,508.00	2.37
57	300760	迈瑞医疗	4,847,954.00	2.35
58	002850	科达利	4,842,945.00	2.35
59	002028	思源电气	4,657,890.00	2.26
60	603456	九洲药业	4,595,769.00	2.23
61	603102	百合股份	4,422,936.00	2.15
62	000055	方大集团	4,397,650.00	2.13
63	003816	中国广核	4,395,113.00	2.13
64	300087	荃银高科	4,378,745.40	2.13
65	000338	潍柴动力	4,362,919.00	2.12
66	600820	隧道股份	4,325,716.00	2.10
67	600926	杭州银行	4,318,533.00	2.10
68	688335	复洁环保	4,271,573.10	2.07
69	003006	百亚股份	4,257,186.54	2.07
70	603367	辰欣药业	4,186,498.00	2.03
71	002025	航天电器	4,169,952.00	2.02
72	000685	中山公用	4,168,692.00	2.02
73	600406	国电南瑞	4,165,205.00	2.02
74	601518	吉林高速	4,162,386.00	2.02
75	600919	江苏银行	4,160,270.00	2.02
76	002179	中航光电	4,132,099.48	2.01
77	600765	中航重机	4,127,079.00	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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	002179	中航光电	13,860,418.41	6.73
2	300274	阳光电源	10,763,399.31	5.23
3	688239	航宇科技	10,543,119.42	5.12
4	301015	百洋医药	10,116,707.94	4.91
5	300416	苏试试验	9,838,840.36	4.78
6	688122	西部超导	9,760,967.27	4.74
7	603529	爱玛科技	9,718,736.49	4.72
8	600862	中航高科	9,646,110.04	4.68
9	300633	开立医疗	9,596,132.35	4.66
10	600150	中国船舶	9,453,753.49	4.59
11	603355	莱克电气	8,475,429.98	4.11
12	605369	拱东医疗	8,343,279.89	4.05
13	688596	正帆科技	8,214,342.24	3.99
14	002049	紫光国微	8,038,261.94	3.90
15	600809	山西汾酒	7,883,072.13	3.83
16	002050	三花智控	7,832,023.69	3.80
17	000423	东阿阿胶	7,731,311.88	3.75
18	603368	柳药集团	7,503,459.53	3.64
19	002594	比亚迪	7,493,097.19	3.64
20	000768	中航西飞	7,488,029.40	3.64
21	002518	科士达	7,408,451.91	3.60
22	300012	华测检测	7,246,659.89	3.52
23	688022	瀚川智能	7,055,098.01	3.42
24	601689	拓普集团	6,930,638.00	3.36
25	688278	特宝生物	6,711,738.62	3.26
26	000933	神火股份	6,702,896.64	3.25
27	300963	中洲特材	6,412,001.63	3.11
28	688556	高测股份	6,238,936.28	3.03
29	000792	盐湖股份	6,237,380.35	3.03
30	603298	杭叉集团	6,162,013.47	2.99
31	603305	旭升集团	6,131,028.00	2.98
32	300705	九典制药	6,114,438.41	2.97
33	300856	科思股份	6,057,836.43	2.94
34	002318	久立特材	6,021,312.37	2.92
35	603538	美诺华	6,009,846.41	2.92
36	002056	横店东磁	6,006,970.00	2.92
37	688063	派能科技	5,986,746.72	2.91
38	300888	稳健医疗	5,966,806.00	2.90
39	601137	博威合金	5,945,868.73	2.89
40	002484	江海股份	5,933,278.00	2.88
41	002472	双环传动	5,791,479.92	2.81
42	603308	应流股份	5,781,624.35	2.81

43	300114	中航电测	5,778,749.00	2.81
44	688111	金山办公	5,692,325.38	2.76
45	002304	洋河股份	5,645,293.96	2.74
46	002737	葵花药业	5,488,245.07	2.66
47	600519	贵州茅台	5,449,796.08	2.65
48	300760	迈瑞医疗	5,436,057.36	2.64
49	603667	五洲新春	5,287,458.61	2.57
50	300308	中际旭创	5,273,013.76	2.56
51	002850	科达利	5,213,967.09	2.53
52	300443	金雷股份	5,198,085.39	2.52
53	000906	浙商中拓	5,176,892.24	2.51
54	002028	思源电气	5,176,831.38	2.51
55	300138	晨光生物	5,173,115.83	2.51
56	002129	TCL 中环	5,105,215.75	2.48
57	300750	宁德时代	5,096,750.00	2.47
58	600603	广汇物流	5,078,798.41	2.47
59	300438	鹏辉能源	5,029,428.05	2.44
60	300014	亿纬锂能	5,014,439.99	2.43
61	000516	国际医学	4,984,355.61	2.42
62	300092	科新机电	4,830,994.91	2.35
63	002006	精工科技	4,793,717.29	2.33
64	600048	保利发展	4,672,597.00	2.27
65	688599	天合光能	4,571,024.16	2.22
66	300087	荃银高科	4,545,224.66	2.21
67	000055	方大集团	4,521,153.55	2.19
68	300763	锦浪科技	4,468,430.22	2.17
69	000338	潍柴动力	4,461,356.69	2.17
70	600406	国电南瑞	4,353,237.01	2.11
71	000063	中兴通讯	4,338,478.00	2.11
72	688335	复洁环保	4,277,232.25	2.08
73	600765	中航重机	4,258,602.54	2.07
74	600820	隧道股份	4,249,220.42	2.06
75	600131	国网信通	4,246,016.45	2.06
76	000685	中山公用	4,238,660.14	2.06
77	603367	辰欣药业	4,202,731.34	2.04
78	601518	吉林高速	4,193,162.11	2.04
79	603102	百合股份	4,178,362.56	2.03
80	603129	春风动力	4,145,727.18	2.01
81	603300	华铁应急	4,130,843.54	2.01

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	859,818,396.78
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	890,505,734.30
--------------	----------------

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

本基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例投资的前十名证券发行主体中，农业银行（601288）的发行主体中国农业银行股份有限公司（以下简称“农业银行”）、中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）存在被监管公开处罚的情形。

1、农业银行（601288）

根据 2023 年 4 月 3 日的行政处罚决定，农业银行因贷前调查不到位，被中国银行保险监督管理委员会随州监管分局罚款 20 万元。

根据 2023 年 8 月 15 日的行政处罚决定，农业银行因：一、农户贷款发放后流入房地产企业；二、农村个人生产经营贷款贷后管理不到位；三、农户小额贷款发放后转为定期存款；四、违规

向房地产开发企业提供融资；五、违规发放流动资金贷款；六、装修贷款发放不审慎；七、商业用房贷款发放不审慎；八、违规向关系人发放信用贷款；九、贷款风险分类不准确导致不良率失实；十、违规发放固定资产贷款；十一、对不具备法人资格的分支公司客户单独办理授信；十二、集团客户统一授信管理不到位；十三、贷款回流用于归还本行贷款；十四、贷款回流用于缴纳银承保证金；十五、贷款回流用于转存定期存款；十六、贴现资金回流出票人；十七、信贷资金流入证券账户；十八、贷后管理不尽责导致信贷资金实质被关联企业占用；十九、扶贫小额信贷“户贷企用”，被国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计 4420.184584 万元。其中，对总行罚款 1760.092292 万元，没收违法所得 60.092292 万元，对分支机构罚款 2600 万元。

根据 2023 年 11 月 16 日的行政处罚决定，农业银行因：一、流动资金贷款被用于固定资产投资；二、贷款受托支付问题整改不到位；三、贷款风险分类不准确；四、个别精准扶贫贷款被挪用；五、不良资产转让流程问题整改不到位；六、小微企业划型不准确；七、贷款资金转存银承汇票保证金问题整改不到位；八、个人贷款违规流入房地产市场问题整改不到位；九、审计人员配备不足问题未整改；十、非现场数据报送不准确，整改不到位；十一、人员内部问责不到位；十二、向关系人发放信用贷款；十三、个人贷款管理不到位，部分贷款资金被挪用，被国家金融监督管理总局没收违法所得并处罚款合计 2710.9738 万元。其中，总行 570.9738 万元，分支机构 2140 万元。

2、中信证券（600030）

根据 2023 年 2 月 6 日的行政处罚决定，中信证券因：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定保存客户身份资料和交易记录；3. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，被中国人民银行罚款 1376 万元。

对农业银行（601288）、中信证券（600030）投资决策程序的说明：

本基金管理人认为，上述处罚事项未对上述机构的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除上述情况外，本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查的情况，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期内投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	93,364.31
2	应收清算款	204,303.69
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	14,179.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	311,847.41

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

本基金本报告期末前十名股票未存在流通受限的股票投资。

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

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 (%)
4,483	58,702.50	29,844.37	0.01	263,133,462.18	99.99

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	338,891.86	0.13

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

无。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年8月27日） 基金份额总额	1,812,340,657.17
本报告期期初基金份额总额	294,990,784.36
本报告期基金总申购份额	3,409,855.88
减：本报告期基金总赎回份额	35,237,333.69
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	263,163,306.55

注：总申购份额包含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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，基金管理人无重大人事变动。
- (2) 本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资组合策略没有重大改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内续聘普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）担任本基金 2023 年度的审计机构，报告期内应支付给会计师事务所的报酬为人民币 6 万元，目前普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供 3 年的审计服务。

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

本基金的基金管理人及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情形。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金的基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情形。

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 (%)	
东北证券	2	194,146,884.15	11.12	143,003.10	10.39	-
天风证券	1	188,260,202.49	10.78	137,677.36	10.01	-
兴业证券	1	187,624,296.59	10.75	174,915.84	12.71	-
民生证券	2	182,864,172.72	10.47	133,727.43	9.72	-
太平洋证券	1	170,686,215.70	9.78	160,039.17	11.63	-
平安证券	2	166,737,090.88	9.55	121,934.86	8.86	-
华鑫证券	2	145,065,073.76	8.31	108,204.16	7.86	-
渤海证券	2	125,801,076.65	7.21	91,999.15	6.69	-
广发证券	1	110,116,739.39	6.31	103,092.23	7.49	-
中信建投	2	101,511,228.10	5.81	74,238.84	5.39	-
东海证券	2	68,914,961.76	3.95	50,394.37	3.66	-
上海证券	2	59,715,957.89	3.42	43,670.39	3.17	-
中国国际金融股份有限公司	2	18,353,912.00	1.05	13,690.94	0.99	-
中邮证券	1	17,053,264.84	0.98	12,710.84	0.92	-
海通证券	1	9,079,890.87	0.52	6,772.67	0.49	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-

湘财证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证监会的有关规定，基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家证券公司租用了基金交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 公司财务状况良好、经营行为稳健规范，内控制度健全、在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的研究能力，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；

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 基金管理人根据上述标准考察后，确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本报告期内基金管理人新租交易单元：湘财证券股份有限公司，退租交易单元：平安证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、大同证券有限责任公司。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东北证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	16,000,000.00	94.12	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

渤海证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
东海证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	1,000,000.00	5.88	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
财达证 券	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
甬兴证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证 券投资基金 2022 年第 4 季度报告	指定互联网网站	2023 年 1 月 20 日
2	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网 站	2023 年 1 月 20 日
3	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证 券投资基金 2022 年年度报告	指定互联网网站	2023 年 3 月 31 日

4	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2022 年年度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 3 月 31 日
5	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海长量基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 4 月 14 日
6	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	指定互联网网站	2023 年 4 月 22 日
7	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 4 月 22 日
8	诺德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海攀赢基金销售有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 4 月 27 日
9	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、指定互联网网站	2023 年 7 月 14 日
10	诺德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金招募说明书更新提示性公告	中国证券报、指定互联网网站	2023 年 7 月 19 日
11	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年 7 月）	指定互联网网站	2023 年 7 月 19 日
12	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）20230719	指定互联网网站	2023 年 7 月 19 日
13	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	指定互联网网站	2023 年 7 月 21 日
14	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第 2 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 7 月 21 日
15	诺德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	四大报、指定互联网网站	2023 年 8 月 19 日
16	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议	指定互联网网站	2023 年 8 月 19 日
17	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同	指定互联网网站	2023 年 8 月 19 日
18	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定互联网网站	2023 年 8 月 23 日
19	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）	指定互联网网站	2023 年 8 月 23 日
20	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年中期报告	指定互联网网站	2023 年 8 月 31 日
21	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年中期报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 8 月 31 日
22	诺德基金管理有限公司关于旗下部分	四大报、指定互联网网站	2023 年 9 月 27 日

	基金参加海通证券股份有限公司申购（含定期定额投资）业务费率优惠活动的公告	站	
23	诺德基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金招募说明书更新提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 9 月 28 日
24	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定互联网网站	2023 年 9 月 28 日
25	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2023 年 9 月）	指定互联网网站	2023 年 9 月 28 日
26	诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	指定互联网网站	2023 年 10 月 25 日
27	诺德基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年 3 季度报告提示性公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 10 月 25 日
28	诺德基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票的公告	四大报、指定互联网网站	2023 年 12 月 7 日

注：指定互联网网站包括基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
- 2、《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》。
- 4、诺德基金管理有限公司批准成立文件、营业执照、公司章程。
- 5、诺德量化优选 6 个月持有期混合型证券投资基金 2023 年年度报告原文。
- 6、诺德基金管理有限公司董事会决议。

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所，并登载于基金管理人网站：www.nuodefund.com。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间至基金管理人住所免费查阅或登录基金管理人网站查阅。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人诺德基金管理有限公司，咨询电话 400-888-0009、(021)68604888，或发电子邮件，E-mail:service@nuodefund.com。

诺德基金管理有限公司

2024 年 3 月 29 日