

# 南方中证 1000 交易型开放式指数证券 投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

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

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

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

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

## 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§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.....	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	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.....	14
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.....	14
§6 审计报告.....	14
6.1 审计报告基本信息.....	14
6.2 审计报告的基本内容.....	15
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
§8 投资组合报告.....	140
8.1 期末基金资产组合情况.....	140
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	141
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.....	142
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	173

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	175
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.....	175
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.....	176
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.....	176
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.....	176
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	176
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	176
8.12 投资组合报告附注.....	176
§9 基金份额持有人信息.....	178
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	178
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	178
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	178
9.4 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.....	179
§10 开放式基金份额变动.....	179
§11 重大事件揭示.....	179
11.1 基金份额持有人大会决议.....	179
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.....	179
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	179
11.4 基金投资策略的改变.....	179
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	179
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.....	180
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	180
11.8 其他重大事件.....	181
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	184
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.....	184
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	184
§13 备查文件目录.....	184
13.1 备查文件目录.....	184
13.2 存放地点.....	185
13.3 查阅方式.....	185

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证 1000ETF
场内简称	1000ETF；中证 1000ETF
基金主代码	512100
交易代码	512100
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2016 年 9 月 29 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,867,217,646.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2016 年 11 月 4 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用完全复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 1000 指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	400-61-95555
传真	0755-82763889	0755-83195201
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址	深圳市福田区莲花街道 益田路 5999 号基金大 厦 32-42 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银 行大厦
邮政编码	518017	518040
法定代表人	周易	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.nffund.com">http://www.nffund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地 址、基金上市交易的证券交易所(如 有)

## 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)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业 广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 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

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	-206,484,218.25	-653,796,784.69	141,589,200.74
本期利润	-195,824,808.82	-1,236,512,758.70	232,499,468.40
加权平均基金份额本期利润	-0.0493	-0.3325	0.2282
本期加权平均净值利润率	-1.91%	-20.91%	21.70%
本期基金份额净值增长率	-5.54%	-21.20%	24.17%
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	-1,409,579,027.13	-952,386,207.36	294,057,789.46
期末可供分配基金份额利润	-0.3645	-0.2254	0.1644
期末基金资产净值	9,169,553,589.41	10,608,824,206.07	2,081,949,789.46
期末基金份额净值	2.3711	2.5102	1.1645
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-13.32%	-8.24%	16.45%

注：1、基金业绩指标不包括持有人认（申）购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本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；

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

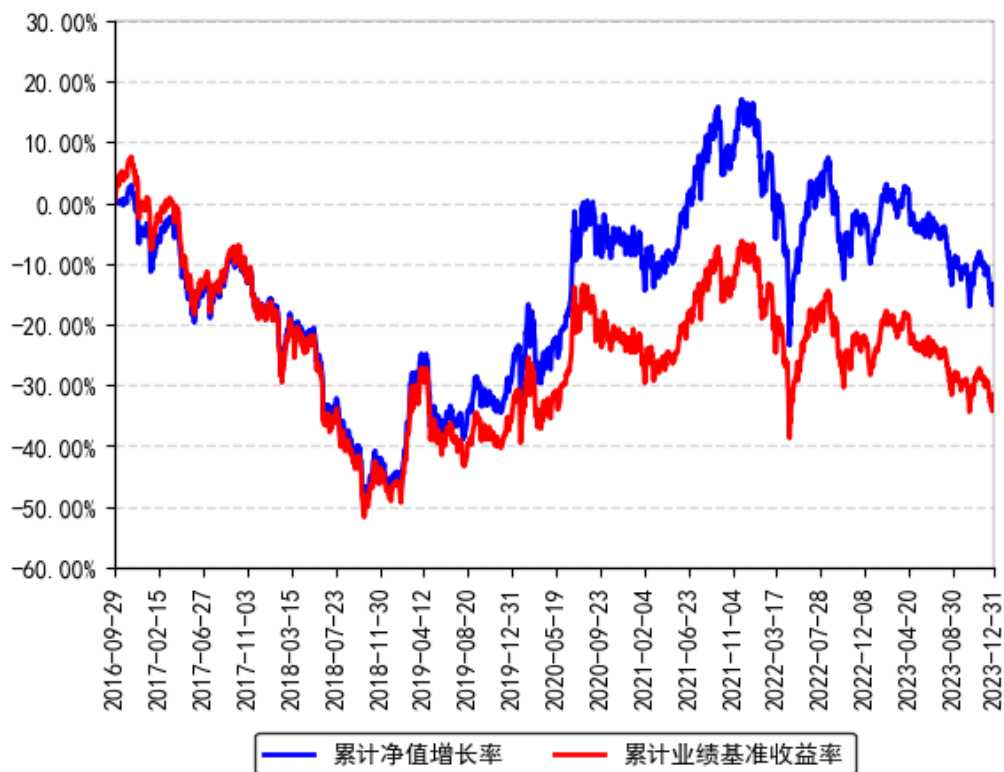
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.10%	1.03%	-3.15%	1.04%	0.05%	-0.01%
过去六个月	-10.64%	1.00%	-10.83%	1.00%	0.19%	0.00%
过去一年	-5.54%	0.95%	-6.28%	0.95%	0.74%	0.00%
过去三年	-7.58%	1.27%	-11.42%	1.28%	3.84%	-0.01%
过去五年	63.42%	1.44%	32.89%	1.44%	30.53%	0.00%
自基金合同生效起至今	-13.32%	1.39%	-31.48%	1.39%	18.16%	0.00%

### 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

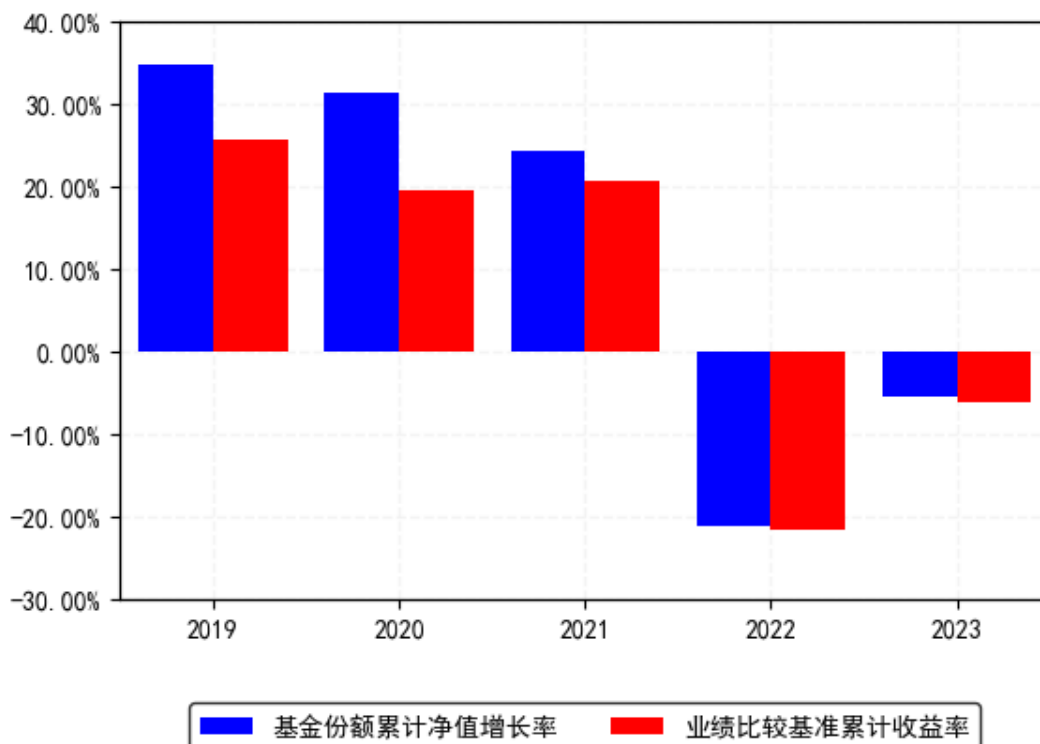
南方中证1000ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 过去五年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



南方中证1000ETF每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

1998年3月6日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018年1月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

#### 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		
崔蕾	本基金 基金经 理	2019 年 7 月 12 日	-	8 年	女，康奈尔大学金融工程硕士，金融风险管理师（FRM），特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。2015 年 2 月加入南方基金，历任量化投资部助理研究员、研究员，指数投资部研究员；2019 年 7 月 12 日至 2021 年 4 月 23 日，任南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2019 年 6 月 28 日至 2022 年 2 月 18 日，任大数据 300 基金经理；2020 年 3 月 26 日至 2023 年 3 月 27 日，任南方粤港澳大湾区联接基金经理；2019 年 11 月 29 日至 2023 年 7 月 4 日，任南方粤港澳大湾区 ETF 基金经理；2018 年 11 月 8 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方中证 500 增强基金经理；2022 年 12 月 1 日至 2023 年 12 月 29 日，任南方上证科创板 50 成份增强策略 ETF 基金经理；2019 年 6 月 12 日至今，任南方顶峰 TOPIX ETF（QDII）基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任有色金属、南方有色金属联接、1000ETF 基金经理；2020 年 1 月 17 日至今，任红利 50 基金经理；2020 年 1 月 21 日至今，任南方大盘红利 50 基金经理；2021 年 6 月 24 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 基金经理；2021 年 8 月 19 日至今，任南方中证科创创业 50ETF 联接基金经理；2021 年 9 月 27 日至今，任南方中证 1000 联接基金经理；2021 年 12 月 29 日至今，任南方国证在线消费 ETF 基金经理；2022 年 1 月 26 日至今，任南方中证 500 增强策略 ETF 基金经理；2022 年 11 月 23 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 基金经理；2023 年 11 月 24 日至今，任南方国证交通运输行业 ETF 发起联接基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

### 4.1.3 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由工资、奖金等构成。工资由基金经理任职的职位职级决定，重点体现员工能力和职位价值导向原则；奖金由员工的绩效贡献决定，重点体现绩效导向与差异化原则。对于兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理，公司对私募资产管理计划产生的超额业绩报酬实施对应激励，并依据其管理产品的长期业绩与个人综合贡献情况实施分配。为贯彻激励约束相结合、激励与约束并重的管理理念，鼓励长期任职，防范经营风险，公司对基金经理奖金实施递延发放；同时，为加强员工利益与持有人利益相捆绑及一致性，公司对基金经理实施了跟投购基机制，有效引导基金经理为客户持续创造价值。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、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，建立了股票、债券、基金等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，集中交易管理办法，公平交易操作指引，异常交易管理制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为0的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

#### 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

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，建立和完善了兼任相关的制度及流程，确保兼任基金经理公平对待其管理的所有投资组合。通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，本报告期内，两两组合同间各项操作、流程及事后分析均正常，未发现不公平对待各组合或组合同相互利益输送的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 25 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

### 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

报告期内，中证 1000 指数下跌 6.28%。期间我们通过自建的指数化交易系统、日内择时交易模型、跟踪误差归因分析系统、ETF 现金流精算系统等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

(1) 大额申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；

(2) 报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）的长期停牌，引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的微小偏离；

(3) 股指期货和现货之间的基差波动带来的本基金与基准的偏离；

(4) 报告期内，我们根据指数定期的成份股调整进行了基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，从实施结果来看，效果良好，跟踪误差控制在理想范围内。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 2.3711 元，报告期内，份额净值增长率为-5.54%，同期业绩基准增长率为-6.28%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年以来，宏观层面上，我国经济整体保持弱复苏节奏，货币政策仍维持 2019 年以来的降息趋势，流动性中短期保持充裕，中长期贷款总体处于筑底阶段，形成宽货币+紧信用大环境；从行业层面上，AI 技术的迭代加速，中证 1000 指数集中超 200 家专精特新企业，成长空间较大的小盘股将是技术变革的核心受益对象；从估值上看，中证 1000 指数当前市

盈率分位数位于近 10 年 P10 附近，仍具备估值优势。同时，小盘大盘指数的估值差异仍处于历史低位，小盘指数仍具备赔率机会；从交易层面上，伴随增量资金陆续入场，当前小市值股票流动性相对充分，后续应有较多的交易性机会。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

#### 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，本基金管理人根据法律法规、监管要求、自律规则和业务发展情况，严格遵守包括《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》在内的公募基金行业各项法律法规及其他规范要求，有效落实了 2023 年度发布的《重要货币市场基金监管暂行规定》《基金从业人员管理规则》和《证券期货经营机构投资管理人员注册登记规则》等公募基金相关新法律法规。

本基金管理人坚持从保护基金份额持有人利益出发，树立并坚守“全员合规、合规从高层做起、合规创造价值、合规是公司生存基础、合规为先、行稳致远”的合规理念。严守底线，始终把内控和合规管理作为规范化管理的重点，通过有效过程管控，将合规管理全面深度嵌入流程与业务，积极推动主动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序开展。

本报告期内，本基金管理人结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际情况，积极推动监管新规落实，持续完善内部控制体系和内部控制制度、业务流程，制订和修订了包括《合规手册》《数据合规管理规定》《从业人员个人投资管理办法》《防控内幕信息及交易管理制度》《信息和保密管理制度》《离任审计及审查制度》等一系列与监察稽核和合规内控相关的管理制度。

在进一步优化制度体系的基础上，本基金管理人贯彻“合规为先，行稳致远”的合规理念，着力创新文化宣传方式，提升宣导效果；优化员工行为检查方式，加强员工行为规范检查力度，严格进行合规问责，强化全员合规、主动合规理念；对投研交易、市场销售、后台运营及人员管理等业务和相关部门开展了定期稽核、专项稽核及多项自查，通过专项稽核和合规检查工作识别问题、防范风险、推动解决，促进公司业务合规运作、稳健经营；根据监管形势和市场形势的变化并结合业务发展的实际情况、各类组合或者业务特点，完善投资合规管理机制，采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，持续完善投资合规控制度流程和系统，加强流动性指标等重要指标的监控和内幕交易防控，有效确保投研交易业务合规运作；全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；积极开

展合规审核工作，不断强化销售合规风险管控，督促落实投资者适当性管理制度；完成各项信息披露工作，保障所披露信息的真实性、准确性和完整性；开展各类监管组织的投教活动，提升投教质效；监督和落实客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人高度重视反洗钱相关工作，贯彻风险为本，自评估驱动，反洗钱重点问题解决方​​案实现落地推进。从制度建设、系统功能建设、业务流程规范、宣传培训、监督检查等方面入手，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程，有效提升了公司反洗钱工作的合规水平。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全全部管理制度，不断提高监察稽核及合规管理工作的科学性和有效性，持续全面推进合规数智化工作在更广范围应用并与合规管理工作深度融合，努力防范和管理各类风险，切实维护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

#### 4.9 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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 23151 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	（一）我们审计的内容 我们审计了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“南方中证 1000ETF 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>(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,公允反映了南方中证 1000ETF 基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于南方中证 1000ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>南方中证 1000ETF 基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司(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南方中证 1000ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算南方中证 1000ETF 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南方中证 1000ETF 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</p>



	<p>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, 就可能对南方中证 1000ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致南方中证 1000ETF 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	张振波 吴玲玮
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2024 年 3 月 28 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体: 南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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	53,155,537.79	26,394,628.45
结算备付金		131,010,670.01	161,842,593.02

存出保证金		24,529,144.50	38,704,832.50
交易性金融资产	7.4.7.2	9,006,030,078.74	10,414,789,651.93
其中：股票投资		9,004,077,344.25	10,412,530,369.35
基金投资		-	-
债券投资		1,952,734.49	2,259,282.58
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		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		38,241,915.45	14,906,332.09
应收股利		465.00	31,516.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	377,027.15	1,147,396.12
资产总计		9,253,344,838.64	10,657,816,950.11
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		18,264,019.20	9,714,572.01
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,332,807.60	4,395,261.73
应付托管费		666,561.52	879,052.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		41,457.29	94,965.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	61,486,403.62	33,908,892.89
负债合计		83,791,249.23	48,992,744.04
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	10,579,132,616.54	11,561,210,413.43
其他综合收益		-	-

未分配利润	7.4.7.8	-1,409,579,027.13	-952,386,207.36
净资产合计		9,169,553,589.41	10,608,824,206.07
负债和净资产总计		9,253,344,838.64	10,657,816,950.11

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.3711 元，基金份额总额 3,867,217,646.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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		-130,078,016.24	-1,199,590,567.09
1.利息收入		37,775,823.69	17,878,253.07
其中：存款利息收入	7.4.7.9	2,414,803.84	969,989.28
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		35,361,019.85	16,908,263.79
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-220,227,179.01	-686,455,439.78
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-314,477,989.49	-716,855,413.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	6,876,810.87	3,596,272.73
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-7,434,864.08	-3,528,951.09
股利收益	7.4.7.14	94,808,863.69	30,332,651.82
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）	7.4.7.15	10,659,409.43	-582,715,974.01
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	7.4.7.16	41,713,929.65	51,702,593.63

号填列)			
减：二、营业总支出		65,746,792.58	36,922,191.61
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	51,795,817.14	29,039,356.49
其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	7.4.10.2.2	10,359,163.39	5,807,871.27
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.税金及附加		169,507.81	61,944.72
8.其他费用	7.4.7.17	3,422,304.24	2,013,019.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-195,824,808.82	-1,236,512,758.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-195,824,808.82	-1,236,512,758.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-195,824,808.82	-1,236,512,758.70

### 7.3 净资产变动表

会计主体：南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金

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	11,561,210,413.4 3	-	-952,386,207.36	10,608,824,206.0 7
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	11,561,210,413.4 3	-	-952,386,207.36	10,608,824,206.0 7
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-982,077,796.89	-	-457,192,819.77	-1,439,270,616.66
（一）、综合收益总额	-	-	-195,824,808.82	-195,824,808.82

(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)	-982,077,796.89	-	-261,368,010.95	-1,243,445,807.84
其中: 1.基金申购款	33,683,353,724.68	-	-1,853,068,791.19	31,830,284,933.49
2.基金赎回款	-34,665,431,521.57	-	1,591,700,780.24	-33,073,730,741.33
(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	10,579,132,616.54	-	-1,409,579,027.13	9,169,553,589.41
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,787,892,000.00	-	294,057,789.46	2,081,949,789.46
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,787,892,000.00	-	294,057,789.46	2,081,949,789.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	9,773,318,413.43	-	-1,246,443,996.82	8,526,874,416.61
(一)、综合收益总额	-	-	-1,236,512,758.70	-1,236,512,758.70
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	9,773,318,413.43	-	-9,931,238.12	9,763,387,175.31
其中: 1.基金申购款	34,984,315,862.09	-	-550,673,615.88	34,433,642,246.21
2.基金赎回款	-25,210,997,448.6	-	540,742,377.76	-24,670,255,070.9

回款	6			0
(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	11,561,210,413.4 3	-	-952,386,207.36	10,608,824,206.0 7

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：

\_\_\_\_杨小松\_\_\_\_                      \_\_\_\_常克川\_\_\_\_                      \_\_\_\_徐超\_\_\_\_  
基金管理人负责人              主管会计工作负责人              会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金(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[2016]366 号《关于准予南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由南方基金管理股份有限公司(原南方基金管理有限公司,已于 2018 年 1 月 4 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 587,892,000.00 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(2016)第 1149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2016 年 9 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 587,892,000.00 份,无认购资金利息折份额。本基金的基金管理人为南方基金管理股份有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2016]264 号审核同意,本基金 587,892,000.00 份基金份额于 2016 年 11 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 1000 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股;此外,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证、股指期货等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转

换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金资产、货币市场工具以及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)。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金可投资于存托凭证。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.1%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数。

本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金(以下简称“南方中证 1000 联接基金”)。南方中证 1000 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人南方基金管理股份有限公司于 2024 年 3 月 28 日批准报出。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、本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商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产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。由于基金份额合并引起的实收基金份额变动于基金份额合并日根据拆分前的基金份额数及确定的合并比例计算认列。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。

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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时,可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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,本基金确定以下以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(1) 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。

(2) 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、可交换债券除外)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、可交换债券除外),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

根据中国证监会于 2024 年 1 月颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 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	53,155,537.79	26,394,628.45
等于：本金	53,151,852.61	26,390,193.33
加：应计利息	3,685.18	4,435.12
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	53,155,537.79	26,394,628.45

### 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	9,478,761,741.56	-	9,004,077,344.25	-474,684,397.31	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,952,600.00	134.49	1,952,734.49	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,952,600.00	134.49	1,952,734.49	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	9,480,714,341.56	134.49	9,006,030,078.74	-474,684,397.31	
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	10,890,871,183.54	-	10,412,530,369.35	-478,340,814.19	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,259,000.00	229.42	2,259,282.58	53.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,259,000.00	229.42	2,259,282.58	53.16
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	10,893,130,183.54	229.42	10,414,789,651.93	-478,340,761.03	

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	160,563,754.29	-	-	-
一股指期货	160,563,754.29	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	160,563,754.29	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	205,839,760.00	-	-	-
—股指期货	205,839,760.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	205,839,760.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2401	IM2401	135.00	158,976,000.00	-1,587,754.29
合计				-1,587,754.29
减：可抵销期货暂收款				-1,587,754.29
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 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无各项买入返售金融资产。

##### 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无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

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
应收利息	-	-
其他应收款	377,027.15	1,147,396.12
待摊费用	-	-
可收退补款	-	-
应收退补款	-	-
合计	377,027.15	1,147,396.12

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	950,311.38	1,982,939.94
其中：交易所市场	950,311.38	1,982,939.94
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应退退补款	59,210,081.55	30,851,811.40
预提费用	270,000.00	240,000.00
应付指数使用费	681,084.18	831,613.55
可退替代款	374,926.51	2,528.00
合计	61,486,403.62	33,908,892.89

#### 7.4.7.7 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	4,226,217,646.00	11,561,210,413.43
本期申购	12,313,000,000.00	33,683,353,724.68
本期赎回（以“-”号填列）	-12,672,000,000.00	-34,665,431,521.57
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,867,217,646.00	10,579,132,616.54

注：红利再投及转入份额计入本期申购，转出份额计入本期赎回。

#### 7.4.7.8 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	905,044,802.15	-1,857,431,009.51	-952,386,207.36
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	905,044,802.15	-1,857,431,009.51	-952,386,207.36
本期利润	-206,484,218.25	10,659,409.43	-195,824,808.82
本期基金份额交易产生的变动数	-107,499,318.81	-153,868,692.14	-261,368,010.95
其中：基金申购款	3,262,262,261.73	-5,115,331,052.92	-1,853,068,791.19
基金赎回款	-3,369,761,580.54	4,961,462,360.78	1,591,700,780.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	591,061,265.09	-2,000,640,292.22	-1,409,579,027.13

## 7.4.7.9 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	174,079.68	127,592.24
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	2,107,637.91	791,176.27
其他	133,086.25	51,220.77
合计	2,414,803.84	969,989.28

## 7.4.7.10 股票投资收益

## 7.4.7.10.1 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	-215,392,901.13	-523,919,372.35
股票投资收益——赎回差价收入	-99,085,088.36	-192,936,040.89
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	-314,477,989.49	-716,855,413.24

## 7.4.7.10.2 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	27,396,266,845.26	21,337,858,712.15
减：卖出股票成本总额	27,578,902,491.46	21,831,627,751.83
减：交易费用	32,757,254.93	30,150,332.67
买卖股票差价收入	-215,392,901.13	-523,919,372.35

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

## 7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	33,073,730,741.33	24,670,255,070.90
减：现金支付赎回款总额	19,600,372,581.33	15,204,493,179.90
减：赎回股票成本总额	13,572,443,248.36	9,658,697,931.89
减：交易费用	-	-

赎回差价收入	-99,085,088.36	-192,936,040.89
--------	----------------	-----------------

#### 7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	3,770.30	2,799.18
债券投资收益——买卖债券（、 债转股及债券到期兑付）差价收 入	6,873,040.57	3,593,473.55
债券投资收益——赎回差价收 入	-	-
债券投资收益——申购差价收 入	-	-
合计	6,876,810.87	3,596,272.73

##### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到 期兑付）成交总额	34,564,901.67	18,883,747.07
减：卖出债券（债转股及债 券到期兑付）成本总额	27,686,500.00	15,287,000.00
减：应计利息总额	3,978.51	2,650.93
减：交易费用	1,382.59	622.59
买卖债券差价收入	6,873,040.57	3,593,473.55

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

##### 7.4.7.11.3 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赎回差价收入。

##### 7.4.7.11.4 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申购差价收入。

**7.4.7.11.5 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。

**7.4.7.12 贵金属投资收益****7.4.7.12.1 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。

**7.4.7.12.2 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买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.12.3 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赎回差价收入。

**7.4.7.12.4 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申购差价收入。

**7.4.7.13 衍生工具收益****7.4.7.13.1 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买卖权证差价收入。

**7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益**

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
股指期货-投资收益	-7,434,864.08	-3,528,951.09

**7.4.7.14 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	94,808,863.69	30,332,651.82
其中：证券出借权益补偿收入	20,559,520.17	4,369,707.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	94,808,863.69	30,332,651.82

**7.4.7.15 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	3,656,363.72	-573,987,378.45

——股票投资	3,656,416.88	-573,987,431.61
——债券投资	-53.16	53.16
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	7,003,045.71	-8,728,595.56
——权证投资	-	-
——期货投资	7,003,045.71	-8,728,595.56
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	10,659,409.43	-582,715,974.01

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

#### 7.4.7.16 其他收入

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
基金赎回费收入	-	-
替代损益	41,491,297.65	51,661,480.12
其他	222,632.00	41,113.51
合计	41,713,929.65	51,702,593.63

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 7.4.7.17 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	150,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	3,107,748.99	1,742,361.43
银行费用	44,555.25	30,657.70
合计	3,422,304.24	2,013,019.13

### 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

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	基金管理人
招商银行股份有限公司("招商银行")	基金托管人
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
南方资本管理有限公司("南方资本")	基金管理人的子公司
南方东英资产管理有限公司("南方东英")	基金管理人的子公司
厦门国际信托有限公司("厦门国际信托")	基金管理人的股东
深圳市投资控股有限公司("深圳投资控股")	基金管理人的股东
厦门合泽吉企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽祥企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽益企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
厦门合泽盈企业管理合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金("南方中证 1000 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	14,170,314,243.73	26.13%	13,279,739,846.12	27.22%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	17,796,790.81	51.49%	8,625,986.81	45.68%

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	1,417,175.07	26.12%	229,435.90	24.14%
关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	1,328,074.97	27.22%	625,786.97	31.56%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	51,795,817.14	29,039,356.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	911,637.96	471,670.97
应支付基金管理人的净管理费	50,884,179.18	28,567,685.52

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 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 × 0.50% ÷ 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	10,359,163.39	5,807,871.27

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 当年天数。

### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无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

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	1,492,000,012.00	1,082,463.36	-	-

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	3,045,337,687.00	1,949,878.45	165,191,732.00	40,830.64

#### 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

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	5,633,773,531.00	1.1~3.5	1.58	3,911,045.37	401,728,865.00	114,923.52
兴业证券	19,105,479.00	3~3.5	3.01	21,704.01	-	-

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	1,329,184,743.00	3.1~3.6	3.20	1,560,206.90	97,871,253.00	36,540.91

### 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

无。



## 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华泰证券股份有限公司	312,692,949.00	8.09%	25,622,692.00	0.61%
南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	334,430,936.00	8.65%	336,822,474.00	7.97%
兴业证券股份有限公司	17,400,735.00	0.45%	114,676,017.00	2.71%

注：本基金其他关联方投资本基金适用的认(申)购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

## 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
招商银行	53,155,537.79	174,079.68	26,394,628.45	127,592.24

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位：股/张)	总金额
华泰联合	127084	柳工转 2	配债	16,419	1,641,900.00
华泰联合	127100	神码转债	配债	9,266	926,600.00
华泰联合	113666	爱玛转债	配债	7,070	707,000.00
华泰联合	123208	孩王转债	配债	5,350	535,000.00
华泰联合	113674	华设转债	配债	4,800	480,000.00
华泰联合	123188	水羊转债	配债	4,258	425,800.00
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688478	晶升股份	网下申购	4,013	130,502.76
华泰联合	301421	波长光电	网下申购	3,315	97,394.70
华泰联合	301519	舜禹股份	网下申购	4,414	92,385.02
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80

华泰联合	301413	安培龙	网下申购	1,633	54,297.25
华泰联合	301566	达利凯普	网下申购	5,755	51,219.50
华泰联合	301487	盟固利	网下申购	8,662	46,081.84
华泰联合	688720	艾森股份	网下申购	1,644	46,081.32
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	127083	山路转债	配债	21,705	2,170,500.00
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券	301578	辰奕智能	网下申购	1,175	57,504.50
兴业证券,华泰联合	688469	芯联集成	网下申购	137,994	785,185.86

## 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
华泰联合	113056	重银转债	配债	7,490	749,000.00
华泰联合	301327	华宝新能	网下申购	2,417	574,037.50
华泰联合	688048	长光华芯	网下申购	6,790	548,632.00
华泰联合	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合	688046	药康生物	网下申购	12,070	271,937.10
华泰联合	123145	药石转债	配债	2,414	241,400.00
华泰联合	301195	北路智控	网下申购	3,300	234,861.00
华泰联合	113650	博 22 转债	配债	1,590	159,000.00
华泰联合	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
华泰联合	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
兴业证券	301165	锐捷网络	网下申购	10,769	348,700.22
兴业证券	603280	南方路机	网下申购	363	8,621.25

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期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——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

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

688563	航材股份	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688548	广钢气体	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
301526	国际复材	2023 年 12 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-
301487	盟固利	2023 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
688549	中巨芯	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-
688702	盛科通信	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
301559	中集环科	2023 年 9 月 26 日	6 个月	新股锁 定期	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
301511	德福科技	2023 年 8 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	28.00	22.67	982	27,496.00	22,261.94	-
688652	京仪装备	2023 年 11 月 22 日	6 个月	新股锁 定期	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301525	儒竞科技	2023 年 8 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301371	敷尔佳	2023 年 7 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301370	国科恒泰	2023 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023 年 8 月	6 个月	新股锁 定期	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-

		16 日								
301558	三态股份	2023 年 9 月 21 日	6 个月	新股锁定期	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
688627	精智达	2023 年 7 月 11 日	6 个月	新股锁定期	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688591	泰凌微	2023 年 8 月 18 日	6 个月	新股锁定期	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期	39.78	69.09	262	10,422.36	18,101.58	-
301509	金凯生科	2023 年 7 月 26 日	6 个月	新股锁定期	56.56	62.23	266	15,044.96	16,553.18	-
301362	民爆光电	2023 年 7 月 27 日	6 个月	新股锁定期	51.05	38.52	420	21,441.00	16,178.40	-
688612	威迈斯	2023 年 7 月 19 日	6 个月	新股锁定期	47.29	37.97	422	19,956.38	16,023.34	-
601096	宏盛华源	2023 年 12 月 15 日	6 个月	新股锁定期	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-
301393	昊帆生物	2023 年 7 月 5 日	6 个月	新股锁定期	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-
601083	锦江航运	2023 年 11 月 28 日	6 个月	新股锁定期	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-
301510	固高科技	2023 年 8 月 4 日	6 个月	新股锁定期	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301507	民生健康	2023 年 8 月 24 日	6 个月	新股锁定期	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301566	达利凯普	2023 年 12 月 22 日	6 个月	新股锁定期	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023 年 7 月 6 日	6 个月	新股锁定期	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688719	爱科赛博	2023	6 个月	新股锁	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-

		年 9 月 20 日		定期						
301550	斯菱股份	2023 年 9 月 6 日	6 个月	新股锁 定期	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301508	中机认检	2023 年 11 月 23 日	6 个月	新股锁 定期	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301251	威尔高	2023 年 8 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
688592	司南导航	2023 年 8 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
301499	维科精密	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688653	康希通信	2023 年 11 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
301528	多浦乐	2023 年 8 月 17 日	6 个月	新股锁 定期	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301372	科净源	2023 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁 定期	45.00	43.59	231	10,395.00	10,069.29	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
688716	中研股份	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023 年 12 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南资源	2023 年 9 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-

301418	协昌科技	2023年8月10日	6个月	新股锁定期	51.88	50.20	189	9,805.32	9,487.80	-
301516	中远通	2023年12月1日	6个月	新股锁定期	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301519	舜禹股份	2023年7月19日	6个月	新股锁定期	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-
301568	思泰克	2023年11月21日	6个月	新股锁定期	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301520	万邦医药	2023年9月18日	6个月	新股锁定期	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301459	丰茂股份	2023年12月6日	6个月	新股锁定期	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-
688720	艾森股份	2023年11月29日	6个月	新股锁定期	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
301489	思泉新材	2023年10月16日	6个月	新股锁定期	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦安全	2023年7月19日	6个月	新股锁定期	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301517	陕西华达	2023年10月9日	6个月	新股锁定期	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	辰奕智能	2023年12月21日	6个月	新股锁定期	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023年9月11日	6个月	新股锁定期	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688646	逸飞激光	2023年7月21日	6个月	新股锁定期	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
603275	众辰科技	2023年8月16日	6个月	新股锁定期	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马农机	2023年8月	6个月	新股锁定期	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-

		7 日								
301555	惠柏新材	2023 年 10 月 24 日	6 个月	新股锁定期	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023 年 7 月 12 日	6 个月	新股锁定期	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-
301529	福赛科技	2023 年 8 月 31 日	6 个月	新股锁定期	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301515	港通医疗	2023 年 7 月 13 日	6 个月	新股锁定期	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮科技	2023 年 11 月 6 日	6 个月	新股锁定期	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688450	光格科技	2023 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁定期	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	鼎龙科技	2023 年 12 月 20 日	6 个月	新股锁定期	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603270	金帝股份	2023 年 8 月 25 日	6 个月	新股锁定期	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603119	浙江荣泰	2023 年 7 月 21 日	6 个月	新股锁定期	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603107	上海汽配	2023 年 10 月 25 日	6 个月	新股锁定期	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023 年 10 月 9 日	6 个月	新股锁定期	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
001306	夏厦精密	2023 年 11 月 9 日	6 个月	新股锁定期	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
603075	热威股份	2023 年 9 月 1 日	6 个月	新股锁定期	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023 年 12 月 14 日	6 个月	新股锁定期	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023	6 个月	新股锁	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-

		年 12 月 4 日		定期						
603231	索宝蛋白	2023 年 12 月 6 日	6 个月	新股锁定期	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023 年 10 月 16 日	6 个月	新股锁定期	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023 年 9 月 18 日	6 个月	新股锁定期	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023 年 12 月 13 日	6 个月	新股锁定期	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博 23 转债	2023 年 12 月 25 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.01	10,250	1,025,000.00	1,025,067.40	-
127100	神码转债	2023 年 12 月 21 日	1 个月内(含)	配债未上市	100.00	100.01	9,266	926,600.00	926,667.02	-
127101	豪鹏转债	2023 年 12 月 27 日	1 个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.07	-

注：本基金持有的上述流通受限证券，根据中国证监会、证券交易所发布的相关规定，在受限期内不得转让：

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

金额单位：人民币元



股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大事项停牌	8.48	2024年1月10日	9.33	862,708	8,409,071.68	7,315,763.84	-
000801	四川九洲	2023年12月21日	重大事项停牌	7.70	2024年1月5日	8.47	755,748	5,743,914.41	5,819,259.60	-
688337	普源精电	2023年12月25日	重大事项停牌	43.87	2024年1月9日	41.72	92,126	4,861,773.11	4,041,567.62	-

本基金截至 2023 年 12 月 31 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 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因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	688368	晶丰明源	2024年1月5日	107.94	1,000.00	107,940.00
2	301381	赛维时代	2024年1月9日 -2024年1月10日	30.29	4,000.00	121,160.00
3	301367	怡和嘉业	2024年1月9日	121.75	1,000.00	121,750.00
4	301316	慧博云通	2024年1月2日 -2024年1月9日	23.24	10,000.00	232,400.00

5	301376	致欧科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	23.92	10,000.00	239,200.00
6	002038	双鹭药业	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 9 日	10.19	24,400.00	248,636.00
7	301180	万祥科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.09	15,500.00	280,395.00
8	301286	侨源股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	29.06	10,000.00	290,600.00
9	600776	东方通信	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 9 日	11.29	30,000.00	338,700.00
10	301177	迪阿股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	29.49	11,500.00	339,135.00
11	603103	横店影视	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	17.78	19,300.00	343,154.00
12	301246	宏源药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	25.98	13,700.00	355,926.00
13	601068	中铝国际	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.62	79,100.00	365,442.00
14	002911	佛燃能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.46	32,500.00	372,450.00
15	301262	海看股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	31.15	12,700.00	395,605.00

16	301200	大族数控	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	37.77	11,000.00	415,470.00
17	688128	中国电研	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.52	20,800.00	426,816.00
18	600403	大有能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.80	119,000.00	452,200.00
19	301363	美好医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	36.80	12,500.00	460,000.00
20	002287	奇正藏药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	22.49	20,700.00	465,543.00
21	603693	江苏新能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.21	41,900.00	469,699.00
22	603530	神马电力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	20.74	23,600.00	489,464.00
23	603938	三孚股份	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 9 日	17.98	27,300.00	490,854.00
24	300755	华致酒行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.29	28,800.00	526,752.00
25	002946	新乳业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.48	46,000.00	528,080.00
26	600618	氯碱化工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.10	58,600.00	533,260.00

27	003039	顺控发展	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.16	35,200.00	533,632.00
28	603032	德新科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.30	27,600.00	560,280.00
29	688161	威高骨科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	41.45	14,000.00	580,300.00
30	002838	道恩股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.81	45,500.00	582,855.00
31	000517	荣安地产	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.45	242,400.00	593,880.00
32	300208	青岛中程	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.68	89,200.00	595,856.00
33	600510	黑牡丹	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.65	105,500.00	596,075.00
34	688209	英集芯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.86	33,500.00	598,310.00
35	300860	锋尚文化	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	54.63	11,000.00	600,930.00
36	603877	太平鸟	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.08	35,500.00	606,340.00
37	000550	江铃汽车	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 9 日	19.03	32,000.00	608,960.00

38	688275	万润新能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	61.67	10,000.00	616,700.00
39	688499	利元亨	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	38.08	16,200.00	616,896.00
40	002959	小熊电器	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	51.93	12,000.00	623,160.00
41	603363	傲农生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.07	103,800.00	630,066.00
42	600400	红豆股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.79	230,500.00	643,095.00
43	000736	中交地产	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 9 日	9.79	66,000.00	646,140.00
44	688351	微电生理	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.65	25,200.00	646,380.00
45	600696	岩石股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.99	36,000.00	647,640.00
46	000058	深赛格	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	7.17	90,500.00	648,885.00
47	688031	星环科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	65.07	10,000.00	650,700.00
48	002978	安宁股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	31.66	20,800.00	658,528.00

49	301165	锐捷网络	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	37.89	17,400.00	659,286.00
50	300741	华宝股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.41	31,000.00	663,710.00
51	002053	云南能投	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.62	69,500.00	668,590.00
52	301090	华润材料	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.86	61,700.00	670,062.00
53	300887	谱尼测试	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.81	57,900.00	683,799.00
54	002275	桂林三金	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	14.49	47,200.00	683,928.00
55	002378	章源钨业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.66	121,600.00	688,256.00
56	000761	本钢板材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.57	193,900.00	692,223.00
57	603299	苏盐井神	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.52	81,400.00	693,528.00
58	000791	甘肃能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.57	124,900.00	695,693.00
59	600903	贵州燃气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	7.89	88,400.00	697,476.00

60	600876	凯盛新能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.03	50,000.00	701,500.00
61	000030	富奥股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.34	131,400.00	701,676.00
62	688337	普源精电	2024 年 1 月 9 日	43.87	16,000.00	701,920.00
63	300953	震裕科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	55.18	12,800.00	706,304.00
64	688206	概伦电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	21.80	32,400.00	706,320.00
65	301060	兰卫医学	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	13.29	53,900.00	716,331.00
66	601886	江河集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.66	107,700.00	717,282.00
67	301301	川宁生物	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 11 日	8.40	85,400.00	717,360.00
68	688526	科前生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	20.38	35,600.00	725,528.00
69	300894	火星人	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.24	44,900.00	729,176.00
70	603489	八方股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	54.95	13,300.00	730,835.00
71	002782	可立克	2024 年 1 月 2 日	14.05	52,300.00	734,815.00

			-2024 年 1 月 9 日			
72	603098	森特股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.61	54,000.00	734,940.00
73	600810	神马股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.44	98,800.00	735,072.00
74	688380	中微半导	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	23.86	30,900.00	737,274.00
75	688268	华特气体	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	67.38	11,000.00	741,180.00
76	002534	西子洁能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.49	59,400.00	741,906.00
77	600475	华光环能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.40	71,400.00	742,560.00
78	002201	正威新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.23	103,100.00	745,413.00
79	688315	诺禾致源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	23.34	32,300.00	753,882.00
80	300653	正海生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	29.02	26,100.00	757,422.00
81	688173	希荻微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.59	43,200.00	759,888.00
82	301291	明阳电气	2024 年 1 月 2 日	28.36	26,900.00	762,884.00



			-2024 年 1 月 9 日			
83	000885	城发环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.34	68,300.00	774,522.00
84	301325	曼恩斯特	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	77.54	10,000.00	775,400.00
85	603888	新华网	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	25.19	30,800.00	775,852.00
86	301267	华夏眼科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	32.09	24,200.00	776,578.00
87	301293	三博脑科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	62.42	12,500.00	780,250.00
88	688372	伟测科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	78.40	10,000.00	784,000.00
89	000789	万年青	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.86	114,300.00	784,098.00
90	603396	金辰股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	54.65	14,400.00	786,960.00
91	688190	云路股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	71.63	11,000.00	787,930.00
92	603609	禾丰股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.56	92,900.00	795,224.00
93	002768	国恩股份	2024 年 1 月 2 日	21.42	37,300.00	798,966.00

			-2024 年 1 月 10 日			
94	300767	震安科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	17.38	46,200.00	802,956.00
95	688001	华兴源创	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	34.95	23,000.00	803,850.00
96	600657	信达地产	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.59	224,000.00	804,160.00
97	300696	爱乐达	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	17.41	46,300.00	806,083.00
98	688185	康希诺	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	74.52	11,000.00	819,720.00
99	002034	旺能环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.25	53,900.00	821,975.00
100	603995	甬金股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.23	42,800.00	823,044.00
101	600662	外服控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.80	172,000.00	825,600.00
102	603915	国茂股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.48	50,100.00	825,648.00
103	002645	华宏科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.30	73,100.00	826,030.00
104	688680	海优新材	2024 年 1 月 2 日	65.65	12,600.00	827,190.00

			-2024 年 1 月 10 日			
105	600335	国机汽车	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 9 日	8.90	93,200.00	829,480.00
106	000869	张裕 A	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.14	34,500.00	832,830.00
107	000813	德展健康	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.27	255,900.00	836,793.00
108	002307	北新路桥	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.24	197,400.00	836,976.00
109	002461	珠江啤酒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.90	106,000.00	837,400.00
110	601069	西部黄金	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.06	69,500.00	838,170.00
111	600929	雪天盐业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.45	130,600.00	842,370.00
112	000029	深深房 A	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.76	71,800.00	844,368.00
113	688046	药康生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.15	42,000.00	846,300.00
114	603055	台华新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.04	70,300.00	846,412.00
115	600639	浦东金桥	2024 年 1 月 2 日	10.11	84,100.00	850,251.00

			-2024 年 1 月 10 日			
116	601869	长飞光纤	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.46	31,000.00	851,260.00
117	002901	大博医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	40.59	21,000.00	852,390.00
118	002267	陕天然气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.33	116,800.00	856,144.00
119	002302	西部建设	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.48	132,500.00	858,600.00
120	600783	鲁信创投	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.58	74,200.00	859,236.00
121	688660	电气风电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.14	167,500.00	860,950.00
122	002697	红旗连锁	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 10 日	4.98	173,000.00	861,540.00
123	603733	仙鹤股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.14	53,500.00	863,490.00
124	600874	创业环保	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.55	156,000.00	865,800.00
125	000025	特力 A	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	15.91	54,600.00	868,686.00
126	600163	中闽能源	2024 年 1 月 2 日	4.37	198,800.00	868,756.00

			-2024 年 1 月 9 日			
127	301217	铜冠铜箔	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.86	73,400.00	870,524.00
128	301327	华宝新能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	76.40	11,400.00	870,960.00
129	000688	国城矿业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.31	84,500.00	871,195.00
130	603105	芯能科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.58	76,000.00	880,080.00
131	300973	立高食品	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	48.55	18,200.00	883,610.00
132	688048	长光华芯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	62.67	14,100.00	883,647.00
133	000498	山东路桥	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.64	157,100.00	886,044.00
134	000062	深圳华强	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.27	79,500.00	895,965.00
135	603730	岱美股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.49	61,900.00	896,931.00
136	600604	市北高新	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.63	194,400.00	900,072.00
137	688586	江航装备	2024 年 1 月 2 日	11.09	81,500.00	903,835.00

			-2024 年 1 月 10 日			
138	603301	振德医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.50	36,900.00	904,050.00
139	002932	明德生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	22.97	39,400.00	905,018.00
140	000968	蓝焰控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.11	127,400.00	905,814.00
141	603718	海利生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	10.71	84,700.00	907,137.00
142	000600	建投能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.01	182,000.00	911,820.00
143	688232	新点软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	36.20	25,200.00	912,240.00
144	603025	大豪科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	13.26	68,800.00	912,288.00
145	688392	骄成超声	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	83.41	11,000.00	917,510.00
146	300527	中船应急	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.62	120,500.00	918,210.00
147	603719	良品铺子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.56	42,600.00	918,456.00
148	002204	大连重工	2024 年 1 月 2 日	4.57	201,100.00	919,027.00

			-2024 年 1 月 9 日			
149	600340	华夏幸福	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	1.74	529,100.00	920,634.00
150	601101	昊华能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.32	146,000.00	922,720.00
151	002190	成飞集成	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.97	48,800.00	925,736.00
152	301207	华兰疫苗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	27.80	33,300.00	925,740.00
153	002891	中宠股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	26.35	35,400.00	932,790.00
154	000672	上峰水泥	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.06	115,800.00	933,348.00
155	300579	数字认证	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.86	36,200.00	936,132.00
156	603010	万盛股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.79	87,000.00	938,730.00
157	001287	中电港	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 10 日	20.83	45,200.00	941,516.00
158	603989	艾华集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.52	43,800.00	942,576.00
159	600169	太原重工	2024 年 1 月 2 日	2.36	402,200.00	949,192.00

			-2024 年 1 月 10 日			
160	600780	通宝能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.20	115,900.00	950,380.00
161	003040	楚天龙	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	19.55	48,700.00	952,085.00
162	601015	陕西黑猫	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.48	212,700.00	952,896.00
163	002741	光华科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	14.87	64,200.00	954,654.00
164	688508	芯朋微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	49.21	19,400.00	954,674.00
165	301069	凯盛新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.42	44,600.00	955,332.00
166	002088	鲁阳节能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.25	67,200.00	957,600.00
167	600458	时代新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.21	104,000.00	957,840.00
168	301216	万凯新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.13	67,900.00	959,427.00
169	000851	高鸿股份	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 9 日	5.87	164,200.00	963,854.00
170	600058	五矿发展	2024 年 1 月 2 日	9.38	103,200.00	968,016.00



			-2024 年 1 月 10 日			
171	603328	依顿电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.15	118,800.00	968,220.00
172	600575	淮河能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.41	402,300.00	969,543.00
173	603583	捷昌驱动	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.03	48,500.00	971,455.00
174	600710	苏美达	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.09	137,200.00	972,748.00
175	601515	东峰集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.04	241,900.00	977,276.00
176	600217	中再资环	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.38	223,800.00	980,244.00
177	600012	皖通高速	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.02	89,000.00	980,780.00
178	002573	清新环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.95	198,500.00	982,575.00
179	301175	中科环保	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.99	197,100.00	983,529.00
180	688381	帝奥微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.32	39,000.00	987,480.00
181	002489	浙江永强	2024 年 1 月 2 日	3.04	325,000.00	988,000.00

			-2024 年 1 月 10 日			
182	600770	综艺股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.91	201,300.00	988,383.00
183	300768	迪普科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	14.78	67,000.00	990,260.00
184	000913	钱江摩托	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.47	79,500.00	991,365.00
185	603297	永新光学	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	99.35	10,000.00	993,500.00
186	002556	辉隆股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.88	169,000.00	993,720.00
187	600648	外高桥	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.86	101,200.00	997,832.00
188	300382	斯莱克	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.93	100,600.00	998,958.00
189	300821	东岳硅材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.30	120,500.00	1,000,150.00
190	603936	博敏电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.44	96,000.00	1,002,240.00
191	688261	东微半导	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	83.59	12,000.00	1,003,080.00
192	600172	黄河旋风	2024 年 1 月 2 日	3.74	268,500.00	1,004,190.00

			-2024 年 1 月 10 日			
193	300183	东软载波	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	15.09	66,600.00	1,004,994.00
194	600508	上海能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.86	72,600.00	1,006,236.00
195	601969	海南矿业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.59	153,000.00	1,008,270.00
196	603118	共进股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.96	113,200.00	1,014,272.00
197	002320	海峡股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.83	174,000.00	1,014,420.00
198	605020	永和股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.01	40,600.00	1,015,406.00
199	688800	瑞可达	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	40.18	25,300.00	1,016,554.00
200	002549	凯美特气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 8 日	9.78	104,000.00	1,017,120.00
201	002646	天佑德酒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.61	74,800.00	1,018,028.00
202	000718	苏宁环球	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.59	393,400.00	1,018,906.00
203	601326	秦港股份	2024 年 1 月 2 日	2.85	357,600.00	1,019,160.00

			-2024 年 1 月 10 日			
204	603229	奥翔药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.21	77,800.00	1,027,738.00
205	002746	仙坛股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.04	146,000.00	1,027,840.00
206	600007	中国国贸	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.38	53,300.00	1,032,954.00
207	301238	瑞泰新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.53	59,000.00	1,034,270.00
208	002135	东南网架	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.78	179,400.00	1,036,932.00
209	000837	秦川机床	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 10 日	10.75	96,500.00	1,037,375.00
210	000048	京基智农	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.30	56,700.00	1,037,610.00
211	601801	皖新传媒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.95	149,500.00	1,039,025.00
212	300737	科顺股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.14	169,600.00	1,041,344.00
213	600835	上海机电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.87	88,000.00	1,044,560.00
214	002913	奥士康	2024 年 1 月 2 日	30.65	34,200.00	1,048,230.00

			-2024 年 1 月 10 日			
215	688238	和元生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.99	116,800.00	1,050,032.00
216	002194	武汉凡谷	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.86	106,900.00	1,054,034.00
217	002941	新疆交建	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.02	81,000.00	1,054,620.00
218	002051	中工国际	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.12	130,000.00	1,055,600.00
219	601882	海天精工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	26.15	40,400.00	1,056,460.00
220	688733	壹石通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	29.27	36,100.00	1,056,647.00
221	600691	阳煤化工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.21	329,600.00	1,058,016.00
222	603699	纽威股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.86	76,500.00	1,060,290.00
223	002206	海利得	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.02	211,300.00	1,060,726.00
224	002242	九阳股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.71	83,500.00	1,061,285.00
225	600491	龙元建设	2024 年 1 月 2 日	3.94	269,500.00	1,061,830.00

			-2024 年 1 月 10 日			
226	000560	我爱我家	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.25	472,100.00	1,062,225.00
227	603920	世运电路	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.28	58,200.00	1,063,896.00
228	601949	中国出版	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.08	132,000.00	1,066,560.00
229	603906	龙蟠科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.46	85,600.00	1,066,576.00
230	300143	盈康生命	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.63	100,500.00	1,068,315.00
231	688776	国光电气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	97.39	11,000.00	1,071,290.00
232	000935	四川双马	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.92	59,900.00	1,073,408.00
233	600284	浦东建设	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.30	171,000.00	1,077,300.00
234	000719	中原传媒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.73	111,400.00	1,083,922.00
235	002274	华昌化工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.55	144,100.00	1,087,955.00
236	002125	湘潭电化	2024 年 1 月 2 日	10.69	102,300.00	1,093,587.00

			-2024 年 1 月 10 日			
237	002440	闰土股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.10	179,800.00	1,096,780.00
238	002895	川恒股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.00	57,900.00	1,100,100.00
239	300602	飞荣达	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.07	60,900.00	1,100,463.00
240	300134	大富科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.32	106,700.00	1,101,144.00
241	002987	京北方	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.58	59,500.00	1,105,510.00
242	600882	妙可蓝多	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.07	68,900.00	1,107,223.00
243	000567	海德股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.63	104,300.00	1,108,709.00
244	603567	珍宝岛	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.16	91,200.00	1,108,992.00
245	301080	百普赛斯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	58.94	18,900.00	1,113,966.00
246	688127	蓝特光学	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	23.29	47,900.00	1,115,591.00
247	000795	英洛华	2024 年 1 月 2 日	6.23	179,100.00	1,115,793.00

			-2024 年 1 月 9 日			
248	603871	嘉友国际	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.86	70,400.00	1,116,544.00
249	688403	汇成股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.55	105,900.00	1,117,245.00
250	605168	三人行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	63.36	17,700.00	1,121,472.00
251	300772	运达股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.64	105,500.00	1,122,520.00
252	688298	东方生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	35.76	31,400.00	1,122,864.00
253	600073	上海梅林	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.81	165,500.00	1,127,055.00
254	300267	尔康制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.21	351,900.00	1,129,599.00
255	688100	威胜信息	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	28.92	39,100.00	1,130,772.00
256	688018	乐鑫科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	102.95	11,000.00	1,132,450.00
257	688133	泰坦科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	46.35	24,500.00	1,135,575.00
258	300080	易成新能	2024 年 1 月 2 日	4.84	235,300.00	1,138,852.00



			-2024 年 1 月 10 日			
259	000061	农产品	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.47	176,300.00	1,140,661.00
260	300639	凯普生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.34	122,300.00	1,142,282.00
261	688097	博众精工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	33.60	34,000.00	1,142,400.00
262	300497	富祥药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.36	122,500.00	1,146,600.00
263	000006	深振业 A	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.59	250,100.00	1,147,959.00
264	600075	新疆天业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.32	266,700.00	1,152,144.00
265	301087	可孚医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	37.90	30,400.00	1,152,160.00
266	688383	新益昌	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	104.79	11,000.00	1,152,690.00
267	000950	重药控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.97	233,800.00	1,161,986.00
268	300671	富满微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	32.33	36,000.00	1,163,880.00
269	600490	鹏欣资源	2024 年 1 月 2 日	2.99	390,000.00	1,166,100.00

			-2024 年 1 月 10 日			
270	601163	三角轮胎	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.41	81,000.00	1,167,210.00
271	603043	广州酒家	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.53	59,900.00	1,169,847.00
272	603008	喜临门	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.01	69,000.00	1,173,690.00
273	300726	宏达电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	30.19	38,900.00	1,174,391.00
274	000016	深康佳 A	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.17	281,700.00	1,174,689.00
275	600649	城投控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.70	318,500.00	1,178,450.00
276	002283	天润工业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.85	201,500.00	1,178,775.00
277	600391	航发科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.12	61,800.00	1,181,616.00
278	000557	西部创业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.83	244,700.00	1,181,901.00
279	000603	盛达资源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.05	107,300.00	1,185,665.00
280	601011	宝泰隆	2024 年 1 月 2 日	3.50	339,100.00	1,186,850.00

			-2024 年 1 月 10 日			
281	605376	博迁新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	28.20	42,100.00	1,187,220.00
282	601606	长城军工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.18	97,600.00	1,188,768.00
283	688409	富创精密	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	78.31	15,200.00	1,190,312.00
284	603636	南威软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.82	93,400.00	1,197,388.00
285	600787	中储股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.10	235,100.00	1,199,010.00
286	000756	新华制药	2024 年 1 月 2 日	20.38	59,000.00	1,202,420.00
287	002043	兔宝宝	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.86	136,200.00	1,206,732.00
288	603123	翠微股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.65	113,400.00	1,207,710.00
289	301268	铭利达	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	29.83	40,500.00	1,208,115.00
290	002705	新宝股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.57	83,000.00	1,209,310.00
291	688356	键凯科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	106.40	11,400.00	1,212,960.00

292	300358	楚天科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.70	113,500.00	1,214,450.00
293	600997	开滦股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.63	159,500.00	1,216,985.00
294	000088	盐田港	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.88	250,400.00	1,221,952.00
295	000801	四川九洲	2024 年 1 月 5 日	7.70	158,800.00	1,222,760.00
296	600623	华谊集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.44	190,000.00	1,223,600.00
297	600751	海航科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.62	467,500.00	1,224,850.00
298	603368	柳药集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.92	64,900.00	1,227,908.00
299	603612	索通发展	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.39	79,800.00	1,228,122.00
300	002218	拓日新能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.51	272,400.00	1,228,524.00
301	002041	登海种业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.23	92,900.00	1,229,067.00
302	603113	金能科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.07	152,600.00	1,231,482.00
303	600550	保变电气	2024 年 1 月 2 日	4.88	252,800.00	1,233,664.00

			-2024 年 1 月 10 日			
304	688131	皓元医药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	52.06	23,700.00	1,233,822.00
305	000828	东莞控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.74	114,900.00	1,234,026.00
306	600812	华北制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.70	216,500.00	1,234,050.00
307	600531	豫光金铅	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.05	204,000.00	1,234,200.00
308	002960	青鸟消防	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.84	89,300.00	1,235,912.00
309	002243	力合科创	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.95	156,000.00	1,240,200.00
310	003021	兆威机电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	93.99	13,200.00	1,240,668.00
311	301089	拓新药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	54.01	23,000.00	1,242,230.00
312	688696	极米科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	112.98	11,000.00	1,242,780.00
313	600643	爱建集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.10	244,000.00	1,244,400.00
314	002545	东方铁塔	2024 年 1 月 2 日	7.15	174,300.00	1,246,245.00

			-2024 年 1 月 10 日			
315	600966	博汇纸业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.21	201,500.00	1,251,315.00
316	301047	义翘神州	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	82.40	15,200.00	1,252,480.00
317	002626	金达威	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.33	76,900.00	1,255,777.00
318	688400	凌云光	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.00	46,600.00	1,258,200.00
319	002097	山河智能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.13	205,400.00	1,259,102.00
320	000966	长源电力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.43	284,800.00	1,261,664.00
321	688318	财富趋势	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	126.30	10,000.00	1,263,000.00
322	002101	广东鸿图	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.23	83,000.00	1,264,090.00
323	688707	振华新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.50	61,700.00	1,264,850.00
324	002928	华夏航空	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.14	177,200.00	1,265,208.00
325	600610	中毅达	2024 年 1 月 2 日	9.39	134,900.00	1,266,711.00

			-2024 年 1 月 9 日			
326	600006	东风汽车	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	5.77	219,800.00	1,268,246.00
327	688239	航宇科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	47.77	26,600.00	1,270,682.00
328	300401	花园生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.81	108,000.00	1,275,480.00
329	002158	汉钟精机	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.26	57,300.00	1,275,498.00
330	688686	奥普特	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	112.00	11,400.00	1,276,800.00
331	001696	宗申动力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.63	192,900.00	1,278,927.00
332	002581	未名医药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.60	87,700.00	1,280,420.00
333	600496	精工钢构	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.05	420,200.00	1,281,610.00
334	000989	九芝堂	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.12	126,800.00	1,283,216.00
335	600017	日照港	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.75	468,000.00	1,287,000.00
336	603713	密尔克卫	2024 年 1 月 2 日	53.21	24,200.00	1,287,682.00

			-2024 年 1 月 10 日			
337	000848	承德露露	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.85	164,400.00	1,290,540.00
338	002254	泰和新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.96	86,500.00	1,294,040.00
339	300377	赢时胜	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.76	167,000.00	1,295,920.00
340	600449	宁夏建材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.93	72,300.00	1,296,339.00
341	688711	宏微科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	41.49	31,300.00	1,298,637.00
342	688339	亿华通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	45.74	28,400.00	1,299,016.00
343	300233	金城医药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.66	78,000.00	1,299,480.00
344	002214	大立科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.47	113,300.00	1,299,551.00
345	300820	英杰电气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	57.28	22,700.00	1,300,256.00
346	688630	芯碁微装	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	85.37	15,300.00	1,306,161.00
347	300596	利安隆	2024 年 1 月 2 日	29.56	44,200.00	1,306,552.00



			-2024 年 1 月 10 日			
348	600305	恒顺醋业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.21	142,000.00	1,307,820.00
349	301078	孩子王	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.21	159,700.00	1,311,137.00
350	300039	上海凯宝	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.65	197,200.00	1,311,380.00
351	600811	东方集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	1.99	662,100.00	1,317,579.00
352	603169	兰石重装	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.16	214,300.00	1,320,088.00
353	300869	康泰医学	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	20.63	64,000.00	1,320,320.00
354	000552	甘肃能化	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.05	434,100.00	1,324,005.00
355	688559	海目星	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	35.70	37,100.00	1,324,470.00
356	600313	农发种业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.45	178,000.00	1,326,100.00
357	300284	苏交科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.45	243,400.00	1,326,530.00
358	001270	铖昌科技	2024 年 1 月 2 日	62.71	21,200.00	1,329,452.00

			-2024 年 1 月 9 日			
359	600682	南京新百	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	7.70	172,800.00	1,330,560.00
360	000059	华锦股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.49	242,500.00	1,331,325.00
361	600223	福瑞达	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.63	138,400.00	1,332,792.00
362	601028	玉龙股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	10.71	124,700.00	1,335,537.00
363	300613	富瀚微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	42.44	31,500.00	1,336,860.00
364	601858	中国科传	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 11 日	24.67	54,200.00	1,337,114.00
365	002612	朗姿股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.23	69,600.00	1,338,408.00
366	603212	赛伍技术	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	17.37	77,300.00	1,342,701.00
367	300409	道氏技术	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.14	120,600.00	1,343,484.00
368	002498	汉缆股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.00	336,500.00	1,346,000.00
369	601702	华峰铝业	2024 年 1 月 2 日	17.95	75,000.00	1,346,250.00

			-2024 年 1 月 10 日			
370	300770	新媒股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	38.68	35,000.00	1,353,800.00
371	000990	诚志股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.21	164,900.00	1,353,829.00
372	688439	振华风光	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	89.11	15,200.00	1,354,472.00
373	603466	风语筑	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.38	94,300.00	1,356,034.00
374	002006	精工科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.28	88,800.00	1,356,864.00
375	600389	江山股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.40	78,000.00	1,357,200.00
376	300443	金雷股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	27.59	49,200.00	1,357,428.00
377	000928	中钢国际	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.83	233,100.00	1,358,973.00
378	688366	昊海生科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	108.29	12,600.00	1,364,454.00
379	300352	北信源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.75	287,700.00	1,366,575.00
380	600773	西藏城投	2024 年 1 月 2 日	10.96	124,800.00	1,367,808.00

			-2024 年 1 月 11 日			
381	300428	立中集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	21.12	64,900.00	1,370,688.00
382	603638	艾迪精密	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.25	84,500.00	1,373,125.00
383	600480	凌云股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.11	150,800.00	1,373,788.00
384	603766	隆鑫通用	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.16	266,400.00	1,374,624.00
385	000488	晨鸣纸业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.88	354,300.00	1,374,684.00
386	300587	天铁股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.84	235,500.00	1,375,320.00
387	300761	立华股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.97	65,700.00	1,377,729.00
388	000735	罗牛山	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.77	239,600.00	1,382,492.00
389	002163	海南发展	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.08	152,300.00	1,382,884.00
390	301358	湖南裕能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	33.95	40,800.00	1,385,160.00
391	002537	海联金汇	2024 年 1 月 2 日	6.66	208,000.00	1,385,280.00

			-2024 年 1 月 10 日			
392	300623	捷捷微电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.87	87,300.00	1,385,451.00
393	301071	力量钻石	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	32.30	42,900.00	1,385,670.00
394	603876	鼎胜新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.53	110,600.00	1,385,818.00
395	300087	荃银高科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.38	166,000.00	1,391,080.00
396	600125	铁龙物流	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.05	231,000.00	1,397,550.00
397	601369	陕鼓动力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.98	175,500.00	1,400,490.00
398	600211	西藏药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	48.80	28,700.00	1,400,560.00
399	002068	黑猫股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.60	120,800.00	1,401,280.00
400	300263	隆华科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.04	199,200.00	1,402,368.00
401	002023	海特高新	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.10	154,600.00	1,406,860.00
402	000901	航天科技	2024 年 1 月 2 日	9.32	151,000.00	1,407,320.00

			-2024 年 1 月 10 日			
403	600277	亿利洁能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.63	536,000.00	1,409,680.00
404	600059	古越龙山	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.30	151,800.00	1,411,740.00
405	002250	联化科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.13	198,300.00	1,413,879.00
406	601619	嘉泽新能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.53	402,200.00	1,419,766.00
407	600098	广州发展	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.37	264,500.00	1,420,365.00
408	000627	天茂集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.84	500,500.00	1,421,420.00
409	601311	骆驼股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.01	177,500.00	1,421,775.00
410	603556	海兴电力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	29.03	49,000.00	1,422,470.00
411	688198	佰仁医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	124.53	11,500.00	1,432,095.00
412	601126	四方股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.16	101,200.00	1,432,992.00
413	002124	天邦食品	2024 年 1 月 2 日	3.63	394,800.00	1,433,124.00

			-2024 年 1 月 9 日			
414	002453	华软科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.30	126,900.00	1,433,970.00
415	603566	普莱柯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.65	63,400.00	1,436,010.00
416	000767	晋控电力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.01	477,200.00	1,436,372.00
417	688289	圣湘生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.55	73,500.00	1,436,925.00
418	000420	吉林化纤	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.91	495,900.00	1,443,069.00
419	600675	中华企业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.15	458,500.00	1,444,275.00
420	002948	青岛银行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.05	473,600.00	1,444,480.00
421	000915	华特达因	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	28.96	50,000.00	1,448,000.00
422	600360	华微电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.23	200,800.00	1,451,784.00
423	002859	洁美科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.95	58,300.00	1,454,585.00
424	603100	川仪股份	2024 年 1 月 2 日	27.72	52,500.00	1,455,300.00

			-2024 年 1 月 10 日			
425	300723	一品红	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	29.83	48,800.00	1,455,704.00
426	600502	安徽建工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.65	313,200.00	1,456,380.00
427	002847	盐津铺子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	69.48	21,000.00	1,459,080.00
428	300634	彩讯股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.47	71,300.00	1,459,511.00
429	300224	正海磁材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.72	124,600.00	1,460,312.00
430	300369	绿盟科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.43	155,200.00	1,463,536.00
431	600869	远东股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.39	333,500.00	1,464,065.00
432	301039	中集车辆	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.38	156,900.00	1,471,722.00
433	600635	大众公用	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.02	487,600.00	1,472,552.00
434	301205	联特科技	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 9 日	104.75	14,100.00	1,476,975.00
435	605123	派克新材	2024 年 1 月 2 日	91.20	16,200.00	1,477,440.00



			-2024 年 1 月 10 日			
436	603128	华贸物流	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.39	200,000.00	1,478,000.00
437	600210	紫江企业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.70	314,700.00	1,479,090.00
438	601952	苏垦农发	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.24	144,500.00	1,479,680.00
439	002216	三全食品	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.40	110,500.00	1,480,700.00
440	688192	迪哲医药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	47.85	31,000.00	1,483,350.00
441	002191	劲嘉股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.37	276,400.00	1,484,268.00
442	002434	万里扬	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.45	199,500.00	1,486,275.00
443	688408	中信博	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	71.75	20,800.00	1,492,400.00
444	002233	塔牌集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.08	211,000.00	1,493,880.00
445	600428	中远海特	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.36	279,800.00	1,499,728.00
446	002108	沧州明珠	2024 年 1 月 2 日	4.11	365,100.00	1,500,561.00

			-2024 年 1 月 10 日			
447	600717	天津港	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.11	365,500.00	1,502,205.00
448	002081	金螳螂	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.76	400,000.00	1,504,000.00
449	000028	国药一致	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	28.99	51,900.00	1,504,581.00
450	600477	杭萧钢构	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.29	458,000.00	1,506,820.00
451	300151	昌红科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.38	82,000.00	1,507,160.00
452	000657	中钨高新	2024 年 1 月 10 日	8.48	177,800.00	1,507,744.00
453	688575	亚辉龙	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.87	66,000.00	1,509,420.00
454	002258	利尔化学	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.97	126,400.00	1,513,008.00
455	603323	苏农银行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.16	364,000.00	1,514,240.00
456	600366	宁波韵升	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.77	195,000.00	1,515,150.00
457	002390	信邦制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.44	341,500.00	1,516,260.00

458	688789	宏华数科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	99.91	15,200.00	1,518,632.00
459	600888	新疆众和	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.24	209,800.00	1,518,952.00
460	301171	易点天下	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	19.77	76,900.00	1,520,313.00
461	300261	雅本化学	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 9 日	7.46	204,000.00	1,521,840.00
462	688322	奥比中光	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	37.58	40,500.00	1,521,990.00
463	002585	双星新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.11	188,400.00	1,527,924.00
464	688676	金盘科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	35.83	42,700.00	1,529,941.00
465	000065	北方国际	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.22	136,500.00	1,531,530.00
466	301219	腾远钴业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	39.37	39,000.00	1,535,430.00
467	002635	安洁科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	16.33	94,100.00	1,536,653.00
468	688123	聚辰股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	61.23	25,100.00	1,536,873.00

469	300158	振东制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.75	227,800.00	1,537,650.00
470	600295	鄂尔多斯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.70	158,700.00	1,539,390.00
471	600138	中青旅	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.62	145,000.00	1,539,900.00
472	600195	中牧股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.86	129,900.00	1,540,614.00
473	301015	百洋医药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	35.86	43,000.00	1,541,980.00
474	300598	诚迈科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	42.93	36,000.00	1,545,480.00
475	002061	浙江交科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.65	423,500.00	1,545,775.00
476	600578	京能电力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.96	522,400.00	1,546,304.00
477	300366	创意信息	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 9 日	13.12	118,200.00	1,550,784.00
478	600158	中体产业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.78	199,400.00	1,551,332.00
479	603348	文灿股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	38.80	40,100.00	1,555,880.00

480	300618	寒锐钴业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	28.29	55,000.00	1,555,950.00
481	300109	新开源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.04	86,300.00	1,556,852.00
482	688389	普门科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.51	69,500.00	1,564,445.00
483	601718	际华集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.84	552,500.00	1,569,100.00
484	301031	中熔电气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	130.76	12,000.00	1,569,120.00
485	600248	陕建股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.02	390,600.00	1,570,212.00
486	600729	重庆百货	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	28.20	55,700.00	1,570,740.00
487	301155	海力风电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	59.15	26,600.00	1,573,390.00
488	002458	益生股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.76	146,600.00	1,577,416.00
489	601200	上海环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.99	175,600.00	1,578,644.00
490	002215	诺普信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.26	191,500.00	1,581,790.00

491	002488	金固股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.18	220,800.00	1,585,344.00
492	688091	上海谊众	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	64.00	24,800.00	1,587,200.00
493	601019	山东出版	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.38	169,300.00	1,588,034.00
494	002726	龙大美食	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.10	196,300.00	1,590,030.00
495	603985	恒润股份	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 9 日	24.85	64,000.00	1,590,400.00
496	300203	聚光科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.85	100,800.00	1,597,680.00
497	002217	合力泰	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.72	587,800.00	1,598,816.00
498	600963	岳阳林纸	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.89	271,500.00	1,599,135.00
499	688321	微芯生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.95	73,000.00	1,602,350.00
500	002077	大港股份	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 12 日	15.25	105,200.00	1,604,300.00
501	603919	金徽酒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.62	65,200.00	1,605,224.00

502	688027	国盾量子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	127.90	12,600.00	1,611,540.00
503	600556	天下秀	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.91	273,000.00	1,613,430.00
504	688158	优刻得	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	16.45	98,100.00	1,613,745.00
505	002237	恒邦股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.78	149,700.00	1,613,766.00
506	600507	方大特钢	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.61	351,000.00	1,618,110.00
507	600720	中交设计	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.08	160,900.00	1,621,872.00
508	688798	艾为电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	69.03	23,500.00	1,622,205.00
509	603308	应流股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.33	113,300.00	1,623,589.00
510	000758	中色股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.50	361,300.00	1,625,850.00
511	000685	中山公用	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.31	222,900.00	1,629,399.00
512	300031	宝通科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.54	87,900.00	1,629,666.00

513	688106	金宏气体	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.09	67,800.00	1,633,302.0 0
514	600688	上海石化	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.86	571,600.00	1,634,776.0 0
515	300855	图南股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	30.20	54,200.00	1,636,840.0 0
516	600063	皖维高新	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.30	382,000.00	1,642,600.0 0
517	600478	科力远	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.92	335,000.00	1,648,200.0 0
518	002003	伟星股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.85	152,000.00	1,649,200.0 0
519	000090	天健集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.60	358,600.00	1,649,560.0 0
520	300260	新莱应材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	30.43	54,600.00	1,661,478.0 0
521	688202	美迪西	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 9 日	68.38	24,300.00	1,661,634.0 0
522	600782	新钢股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.49	476,500.00	1,662,985.0 0
523	300348	长亮科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.31	161,600.00	1,666,096.0 0



524	301095	广立微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	74.73	22,300.00	1,666,479.00
525	301153	中科江南	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	78.27	21,300.00	1,667,151.00
526	002400	省广集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.55	301,000.00	1,670,550.00
527	600320	振华重工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.32	503,500.00	1,671,620.00
528	600740	山西焦化	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.04	331,700.00	1,671,768.00
529	601890	亚星锚链	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.90	169,000.00	1,673,100.00
530	601908	京运通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.57	367,000.00	1,677,190.00
531	000682	东方电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.05	209,300.00	1,684,865.00
532	300735	光弘科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	23.54	71,600.00	1,685,464.00
533	000049	德赛电池	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.12	62,200.00	1,686,864.00
534	600971	恒源煤电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.15	151,500.00	1,689,225.00

535	002839	张家港行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.88	435,500.00	1,689,740.00
536	002048	宁波华翔	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	13.01	130,200.00	1,693,902.00
537	002840	华统股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.79	81,700.00	1,698,543.00
538	600197	伊力特	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.75	78,100.00	1,698,675.00
539	600986	浙文互联	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.46	311,900.00	1,702,974.00
540	600409	三友化工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.49	310,900.00	1,706,841.00
541	603033	三维股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	15.81	108,000.00	1,707,480.00
542	000982	中银绒业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	1.47	1,165,300.00	1,712,991.00
543	002467	二六三	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.64	369,400.00	1,714,016.00
544	300180	华峰超纤	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.42	388,600.00	1,717,612.00
545	300593	新雷能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.77	116,400.00	1,719,228.00

546	300725	药石科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	39.27	43,800.00	1,720,026.00
547	600151	航天机电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.59	261,200.00	1,721,308.00
548	300406	九强生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	19.10	90,200.00	1,722,820.00
549	600459	贵研铂业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	14.36	120,100.00	1,724,636.00
550	600055	万东医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.08	101,000.00	1,725,080.00
551	002583	海能达	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.95	290,000.00	1,725,500.00
552	600246	万通发展	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.49	266,300.00	1,728,287.00
553	603108	润达医疗	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 10 日	20.35	85,000.00	1,729,750.00
554	688023	安恒信息	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	110.89	15,600.00	1,729,884.00
555	300620	光库科技	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 12 日	45.30	38,200.00	1,730,460.00
556	300827	上能电气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	30.26	57,200.00	1,730,872.00

557	601137	博威合金	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.53	111,600.00	1,733,148.00
558	600562	国睿科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.84	125,400.00	1,735,536.00
559	300463	迈克生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.07	115,200.00	1,736,064.00
560	601777	力帆科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	3.58	485,600.00	1,738,448.00
561	688739	成大生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	32.51	53,500.00	1,739,285.00
562	300077	国民技术	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.29	154,100.00	1,739,789.00
563	688326	经纬恒润	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	116.05	15,000.00	1,740,750.00
564	603690	至纯科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.70	68,000.00	1,747,600.00
565	000555	神州信息	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.29	154,800.00	1,747,692.00
566	600797	浙大网新	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.56	266,700.00	1,749,552.00
567	300910	瑞丰新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	45.94	38,100.00	1,750,314.00

568	300319	麦捷科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.64	181,800.00	1,752,552.00
569	002539	云图控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.25	212,500.00	1,753,125.00
570	000927	中国铁物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.67	656,900.00	1,753,923.00
571	600225	卓朗科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.80	461,600.00	1,754,080.00
572	688700	东威科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	61.02	28,800.00	1,757,376.00
573	000969	安泰科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.99	195,700.00	1,759,343.00
574	300416	苏试试验	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.37	95,900.00	1,761,683.00
575	603306	华懋科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.11	65,000.00	1,762,150.00
576	301050	雷电微力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	58.26	30,300.00	1,765,278.00
577	002349	精华制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.87	199,800.00	1,772,226.00
578	600996	贵广网络	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.96	197,800.00	1,772,288.00

579	688568	中科星图	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	49.06	36,300.00	1,780,878.00
580	688083	中望软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	99.54	17,900.00	1,781,766.00
581	002428	云南锗业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.33	144,600.00	1,782,918.00
582	600577	精达股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.14	430,900.00	1,783,926.00
583	300271	华宇软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.19	218,100.00	1,786,239.00
584	603881	数据港	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	19.82	90,300.00	1,789,746.00
585	600259	广晟有色	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	35.45	50,500.00	1,790,225.00
586	603565	中谷物流	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.23	217,600.00	1,790,848.00
587	300113	顺网科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.00	128,100.00	1,793,400.00
588	600586	金晶科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.68	269,500.00	1,800,260.00
589	600252	中恒集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.51	719,100.00	1,804,941.00

590	600557	康缘药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.52	88,000.00	1,805,760.00
591	301239	普瑞眼科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	86.00	21,000.00	1,806,000.00
592	600420	国药现代	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.79	184,600.00	1,807,234.00
593	300685	艾德生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	21.98	82,400.00	1,811,152.00
594	000582	北部湾港	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.51	241,200.00	1,811,412.00
595	300398	飞凯材料	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	15.76	115,200.00	1,815,552.00
596	002421	达实智能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.22	564,400.00	1,817,368.00
597	002171	楚江新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.48	243,000.00	1,817,640.00
598	300332	天壕能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.95	229,700.00	1,826,115.00
599	002416	爱施德	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.29	196,900.00	1,829,201.00
600	301035	润丰股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	70.00	26,200.00	1,834,000.00

601	002985	北摩高科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	34.68	52,900.00	1,834,572.0 0
602	300663	科蓝软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	14.14	129,800.00	1,835,372.0 0
603	000829	天音控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	9.54	192,500.00	1,836,450.0 0
604	300687	赛意信息	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	21.78	84,400.00	1,838,232.0 0
605	600993	马应龙	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.18	76,100.00	1,840,098.0 0
606	600266	城建发展	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.84	380,400.00	1,841,136.0 0
607	002060	粤水电	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 9 日	4.91	375,200.00	1,842,232.0 0
608	688262	国芯科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	29.34	62,800.00	1,842,552.0 0
609	600285	羚锐制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.11	107,700.00	1,842,747.0 0
610	000543	皖能电力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.26	294,700.00	1,844,822.0 0
611	688388	嘉元科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.28	91,000.00	1,845,480.0 0



612	600328	中盐化工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.82	236,000.00	1,845,520.00
613	300171	东富龙	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.99	102,600.00	1,845,774.00
614	002773	康弘药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.44	100,400.00	1,851,376.00
615	600206	有研新材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.39	149,500.00	1,852,305.00
616	300630	普利制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	22.62	82,000.00	1,854,840.00
617	603678	火炬电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	26.47	70,100.00	1,855,547.00
618	300738	奥飞数据	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	10.59	176,300.00	1,867,017.00
619	688518	联赢激光	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	20.48	91,600.00	1,875,968.00
620	600602	云赛智联	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.57	162,500.00	1,880,125.00
621	688270	臻镭科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	68.38	27,500.00	1,880,450.00
622	600037	歌华有线	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.73	245,100.00	1,894,623.00

623	002597	金禾实业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.91	86,500.00	1,895,215.00
624	002649	博彦科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	12.27	155,000.00	1,901,850.00
625	603083	剑桥科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	37.72	50,600.00	1,908,632.00
626	600057	厦门象屿	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.71	284,900.00	1,911,679.00
627	002004	华邦健康	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.66	410,800.00	1,914,328.00
628	601860	紫金银行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.53	759,000.00	1,920,270.00
629	300027	华谊兄弟	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.68	717,500.00	1,922,900.00
630	000012	南玻 A	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.57	346,400.00	1,929,448.00
631	000902	新洋丰	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.39	169,500.00	1,930,605.00
632	002085	万丰奥威	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.94	390,900.00	1,931,046.00
633	002079	苏州固锝	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.28	171,200.00	1,931,136.00

634	300693	盛弘股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	29.91	64,600.00	1,932,186.00
635	002091	江苏国泰	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.83	247,000.00	1,934,010.00
636	603279	景津装备	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.11	87,500.00	1,934,625.00
637	300185	通裕重工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.40	806,900.00	1,936,560.00
638	600775	南京熊猫	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 12 日	13.25	146,300.00	1,938,475.00
639	601519	大智慧	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.38	263,000.00	1,940,940.00
640	688596	正帆科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	39.63	49,000.00	1,941,870.00
641	002807	江阴银行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.55	547,500.00	1,943,625.00
642	600179	安通控股	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.50	777,500.00	1,943,750.00
643	002219	新里程	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.03	642,000.00	1,945,260.00
644	600864	哈投股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.69	342,300.00	1,947,687.00

645	300457	赢合科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.44	106,100.00	1,956,484.00
646	600216	浙江医药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.73	183,100.00	1,964,663.00
647	000811	冰轮环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	13.57	145,200.00	1,970,364.00
648	002130	沃尔核材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.55	261,400.00	1,973,570.00
649	600621	华鑫股份	2024 年 1 月 5 日 -2024 年 1 月 10 日	14.07	140,400.00	1,975,428.00
650	000712	锦龙股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	14.67	134,700.00	1,976,049.00
651	600064	南京高科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.04	327,300.00	1,976,892.00
652	300226	上海钢联	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	28.49	69,400.00	1,977,206.00
653	000951	中国重汽	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.36	148,000.00	1,977,280.00
654	002351	漫步者	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.67	112,200.00	1,982,574.00
655	000681	视觉中国	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.70	135,300.00	1,988,910.00

656	600110	诺德股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.64	353,000.00	1,990,920.00
657	300065	海兰信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.17	195,900.00	1,992,303.00
658	600267	海正药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.36	213,000.00	1,993,680.00
659	688167	炬光科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	114.00	17,500.00	1,995,000.00
660	603997	继峰股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	13.47	148,600.00	2,001,642.00
661	000415	渤海租赁	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.14	936,000.00	2,003,040.00
662	002737	葵花药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.98	77,100.00	2,003,058.00
663	600323	瀚蓝环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.33	116,000.00	2,010,280.00
664	601212	白银有色	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.69	747,500.00	2,010,775.00
665	600933	爱柯迪	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	21.94	91,800.00	2,014,092.00
666	002324	普利特	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	13.15	153,200.00	2,014,580.00

667	002701	奥瑞金	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.14	487,300.00	2,017,422.00
668	000650	仁和药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.63	304,400.00	2,018,172.00
669	603588	高能环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.54	309,000.00	2,020,860.00
670	300773	拉卡拉	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	16.04	126,100.00	2,022,644.00
671	600976	健民集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	65.25	31,000.00	2,022,750.00
672	688139	海尔生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	40.52	50,000.00	2,026,000.00
673	600120	浙江东方	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.59	564,400.00	2,026,196.00
674	600750	江中药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.88	97,100.00	2,027,448.00
675	002446	盛路通信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.30	244,300.00	2,027,690.00
676	300327	中颖电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	22.80	89,100.00	2,031,480.00
677	300343	联创股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.60	308,100.00	2,033,460.00

678	300432	富临精工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.50	194,300.00	2,040,150.00
679	300085	银之杰	2024 年 1 月 4 日 -2024 年 1 月 9 日	14.32	142,500.00	2,040,600.00
680	002745	木林森	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.66	235,900.00	2,042,894.00
681	300133	华策影视	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.87	348,800.00	2,047,456.00
682	002906	华阳集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	35.25	58,100.00	2,048,025.00
683	300655	晶瑞电材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.73	211,300.00	2,055,949.00
684	002099	海翔药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.19	286,000.00	2,056,340.00
685	300841	康华生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	77.54	26,600.00	2,062,564.00
686	600185	格力地产	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.23	285,900.00	2,067,057.00
687	600446	金证股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.57	178,900.00	2,069,873.00
688	300182	捷成股份	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 10 日	5.08	407,500.00	2,070,100.00

689	601918	新集能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.27	393,000.00	2,071,110.00
690	000821	京山轻机	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	15.89	130,400.00	2,072,056.00
691	688033	天宜上佳	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.90	122,700.00	2,073,630.00
692	300123	亚光科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.33	283,100.00	2,075,123.00
693	300035	中科电气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.54	197,000.00	2,076,380.00
694	600587	新华医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.79	80,600.00	2,078,674.00
695	002020	京新药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	12.72	163,600.00	2,080,992.00
696	603393	新天然气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	30.57	68,200.00	2,084,874.00
697	300747	锐科激光	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	23.53	88,700.00	2,087,111.00
698	300232	洲明科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.80	237,400.00	2,089,120.00
699	600331	宏达股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.13	408,000.00	2,093,040.00



700	688266	泽璟制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	52.94	39,600.00	2,096,424.00
701	002249	大洋电机	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.97	422,500.00	2,099,825.00
702	603197	保隆科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	56.40	37,300.00	2,103,720.00
703	600596	新安股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.12	231,000.00	2,106,720.00
704	300451	创业慧康	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.55	321,700.00	2,107,135.00
705	601399	国机重装	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	2.83	746,700.00	2,113,161.00
706	600645	中源协和	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.27	104,500.00	2,118,215.00
707	300079	数码视讯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.69	372,500.00	2,119,525.00
708	600483	福能股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.27	257,000.00	2,125,390.00
709	600395	盘江股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.17	345,000.00	2,128,650.00
710	601965	中国汽研	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.06	96,500.00	2,128,790.00

711	002276	万马股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.22	209,100.00	2,137,002.00
712	002291	遥望科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	9.38	227,900.00	2,137,702.00
713	002183	怡亚通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.48	478,900.00	2,145,472.00
714	688278	特宝生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	52.35	41,100.00	2,151,585.00
715	000917	电广传媒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.48	392,800.00	2,152,544.00
716	603505	金石资源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.15	79,400.00	2,155,710.00
717	002706	良信股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.83	244,300.00	2,157,169.00
718	000875	吉电股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.40	490,500.00	2,158,200.00
719	300303	聚飞光电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.93	364,100.00	2,159,113.00
720	603063	禾望电气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.00	86,400.00	2,160,000.00
721	002984	森麒麟	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	28.85	75,000.00	2,163,750.00

722	300170	汉得信息	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.31	260,600.00	2,165,586.00
723	688578	艾力斯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	41.66	52,300.00	2,178,818.00
724	600116	三峡水利	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.53	289,500.00	2,179,935.00
725	300166	东方国信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.40	232,100.00	2,181,740.00
726	600273	嘉化能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.59	254,700.00	2,187,873.00
727	600908	无锡银行	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.05	435,400.00	2,198,770.00
728	300188	国投智能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	16.02	137,500.00	2,202,750.00
729	601208	东材科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.38	178,500.00	2,209,830.00
730	601333	广深铁路	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.59	856,500.00	2,218,335.00
731	605090	九丰能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	27.93	80,100.00	2,237,193.00
732	600338	西藏珠峰	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.16	184,000.00	2,237,440.00

733	688016	心脉医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	194.63	11,500.00	2,238,245.00
734	002174	游族网络	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.46	196,300.00	2,249,598.00
735	000921	海信家电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.40	110,300.00	2,250,120.00
736	600456	宝钛股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	31.39	71,700.00	2,250,663.00
737	601678	滨化股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.21	534,800.00	2,251,508.00
738	603298	杭叉集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.88	90,600.00	2,254,128.00
739	600718	东软集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.25	244,000.00	2,257,000.00
740	600850	电科数字	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.75	104,000.00	2,262,000.00
741	000035	中国天楹	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.94	458,600.00	2,265,484.00
742	600072	中船科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.54	122,300.00	2,267,442.00
743	002011	盾安环境	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	13.75	165,200.00	2,271,500.00

744	600916	中国黄金	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	9.87	230,800.00	2,277,996.00
745	300323	华灿光电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.32	312,800.00	2,289,696.00
746	603129	春风动力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	102.24	22,400.00	2,290,176.00
747	300075	数字政通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.60	130,300.00	2,293,280.00
748	002567	唐人神	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.50	306,100.00	2,295,750.00
749	300130	新国都	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	24.20	94,900.00	2,296,580.00
750	603027	千禾味业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.17	142,100.00	2,297,757.00
751	002544	普天科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.32	113,300.00	2,302,256.00
752	002239	奥特佳	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 12 日	3.25	708,800.00	2,303,600.00
753	002396	星网锐捷	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.07	127,500.00	2,303,925.00
754	002335	科华数据	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.68	83,300.00	2,305,744.00

755	002123	梦网科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.15	207,100.00	2,309,165.00
756	000528	柳工	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.74	343,400.00	2,314,516.00
757	600612	老凤祥	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	69.00	33,700.00	2,325,300.00
758	601222	林洋能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.39	364,000.00	2,325,960.00
759	002127	南极电商	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.89	598,000.00	2,326,220.00
760	688007	光峰科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.88	90,200.00	2,334,376.00
761	300393	中来股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.34	226,200.00	2,338,908.00
762	605111	新洁能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	37.83	62,100.00	2,349,243.00
763	600572	康恩贝	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.05	466,000.00	2,353,300.00
764	002851	麦格米特	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	24.60	96,400.00	2,371,440.00
765	002484	江海股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.06	148,000.00	2,376,880.00

766	600633	浙数文化	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	11.06	215,200.00	2,380,112.00
767	000676	智度股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.73	273,900.00	2,391,147.00
768	002424	贵州百灵	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.11	295,400.00	2,395,694.00
769	600452	涪陵电力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.20	182,000.00	2,402,400.00
770	300525	博思软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.92	161,600.00	2,411,072.00
771	300083	创世纪	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.33	381,400.00	2,414,262.00
772	000422	湖北宜化	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	10.46	231,200.00	2,418,352.00
773	002643	万润股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	16.59	146,000.00	2,422,140.00
774	002698	博实股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	15.19	160,100.00	2,431,919.00
775	002610	爱康科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.16	1,126,000.00	2,432,160.00
776	300482	万孚生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	30.17	81,100.00	2,446,787.00

777	002541	鸿路钢构	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.73	113,000.00	2,455,490.00
778	300672	国科微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	58.94	41,700.00	2,457,798.00
779	300674	宇信科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	16.28	151,200.00	2,461,536.00
780	600761	安徽合力	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.21	135,700.00	2,471,097.00
781	002245	蔚蓝锂芯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.52	290,500.00	2,475,060.00
782	603599	广信股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	14.50	171,300.00	2,483,850.00
783	000503	国新健康	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.18	189,000.00	2,491,020.00
784	002292	奥飞娱乐	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.75	285,600.00	2,499,000.00
785	002617	露笑科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	6.20	403,600.00	2,502,320.00
786	600877	电科芯片	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.99	179,000.00	2,504,210.00
787	300762	上海瀚讯	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	15.08	166,400.00	2,509,312.00



788	688116	天奈科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	29.04	86,500.00	2,511,960.00
789	603300	华铁应急	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.40	394,500.00	2,524,800.00
790	603236	移远通信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	53.75	47,000.00	2,526,250.00
791	300627	华测导航	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	31.02	81,500.00	2,528,130.00
792	002100	天康生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	8.77	288,700.00	2,531,899.00
793	002747	埃斯顿	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.59	136,400.00	2,535,676.00
794	002727	一心堂	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	23.16	109,600.00	2,538,336.00
795	300034	钢研高纳	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.35	125,000.00	2,543,750.00
796	603477	巨星农牧	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	37.47	68,100.00	2,551,707.00
797	300379	东方通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.28	139,700.00	2,553,716.00
798	002182	宝武镁业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	19.66	130,300.00	2,561,698.00

799	000426	兴业银锡	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.08	285,000.00	2,587,800.00
800	002063	远光软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.18	419,300.00	2,591,274.00
801	600312	平高电气	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.69	204,500.00	2,595,105.00
802	000690	宝新能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	4.43	587,900.00	2,604,397.00
803	688327	云从科技	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 10 日	16.86	154,800.00	2,609,928.00
804	300765	新诺威	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	36.62	71,600.00	2,621,992.00
805	600667	太极实业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 11 日	7.03	376,100.00	2,643,983.00
806	002222	福晶科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	29.53	89,600.00	2,645,888.00
807	688066	航天宏图	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	42.24	62,700.00	2,648,448.00
808	300298	三诺生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	30.40	87,200.00	2,650,880.00
809	300294	博雅生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	33.68	78,900.00	2,657,352.00

810	600821	金开新能	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	6.12	435,500.00	2,665,260.00
811	000032	深桑达 A	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.18	125,900.00	2,666,562.00
812	601001	晋控煤业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	12.33	216,500.00	2,669,445.00
813	300229	拓尔思	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	16.86	158,500.00	2,672,310.00
814	002139	拓邦股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.76	274,400.00	2,678,144.00
815	600123	兰花科创	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.04	242,600.00	2,678,304.00
816	300458	全志科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	22.69	118,100.00	2,679,689.00
817	300101	振芯科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.83	117,600.00	2,684,808.00
818	600552	凯盛科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	13.33	201,600.00	2,687,328.00
819	000686	东北证券	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	7.10	379,700.00	2,695,870.00
820	300777	中简科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	29.83	90,500.00	2,699,615.00

821	002015	协鑫能科	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	12.38	218,500.00	2,705,030.00
822	688166	博瑞医药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	35.00	77,300.00	2,705,500.00
823	300679	电连技术	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	41.50	65,400.00	2,714,100.00
824	300236	上海新阳	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	35.22	77,200.00	2,718,984.00
825	002332	仙琚制药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	12.77	213,100.00	2,721,287.00
826	601375	中原证券	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.83	713,900.00	2,734,237.00
827	601975	招商南油	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	2.80	980,000.00	2,744,000.00
828	300476	胜宏科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.45	149,200.00	2,752,740.00
829	300036	超图软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	20.90	131,900.00	2,756,710.00
830	000810	创维数字	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	15.71	177,100.00	2,782,241.00
831	600330	天通股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.63	324,900.00	2,803,887.00

832	002312	川发龙蟒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.15	392,200.00	2,804,230.00
833	688213	思特威	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	55.56	50,500.00	2,805,780.00
834	600595	中孚实业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.48	807,100.00	2,808,708.00
835	300638	广和通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	19.03	148,000.00	2,816,440.00
836	300633	开立医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	47.30	59,900.00	2,833,270.00
837	600641	万业企业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	17.26	164,400.00	2,837,544.00
838	002354	天娱数科	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 10 日	5.52	516,400.00	2,850,528.00
839	688110	东芯股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	34.43	82,800.00	2,850,804.00
840	688608	恒玄科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	154.27	18,500.00	2,853,995.00
841	601677	明泰铝业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	11.34	251,800.00	2,855,412.00
842	002221	东华能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.30	277,600.00	2,859,280.00

843	688556	高测股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	38.99	73,500.00	2,865,765.00
844	600685	中船防务	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	25.55	113,000.00	2,887,150.00
845	301308	江波龙	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	92.05	31,400.00	2,890,370.00
846	300068	南都电源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	12.94	223,800.00	2,895,972.00
847	002837	英维克	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	27.48	105,500.00	2,899,140.00
848	002036	联创电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	10.21	287,300.00	2,933,333.00
849	300775	三角防务	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.90	105,600.00	2,946,240.00
850	000403	派林生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	27.24	108,300.00	2,950,092.00
851	002832	比音勒芬	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	31.70	93,400.00	2,960,780.00
852	000860	顺鑫农业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	21.29	140,000.00	2,980,600.00
853	002212	天融信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	9.78	307,000.00	3,002,460.00

854	688019	安集科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	159.76	18,900.00	3,019,464.00
855	300666	江丰电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	58.58	51,900.00	3,040,302.00
856	600422	昆药集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.86	145,800.00	3,041,388.00
857	600728	佳都科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	5.72	539,500.00	3,085,940.00
858	688088	虹软科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	41.04	75,900.00	3,114,936.00
859	688050	爱博医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	172.04	18,200.00	3,131,128.00
860	600363	联创光电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	34.00	92,100.00	3,131,400.00
861	002675	东诚药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	18.33	171,100.00	3,136,263.00
862	688639	华恒生物	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	125.90	25,300.00	3,185,270.00
863	000762	西藏矿业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	28.60	111,900.00	3,200,340.00
864	002317	众生药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	16.05	201,000.00	3,226,050.00

865	300475	香农芯创	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 9 日	33.79	95,800.00	3,237,082.00
866	600201	生物股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	10.77	302,600.00	3,259,002.00
867	002389	航天彩虹	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.60	175,500.00	3,264,300.00
868	688598	金博股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	69.90	46,800.00	3,271,320.00
869	002145	中核钛白	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.48	730,800.00	3,273,984.00
870	002261	拓维信息	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 11 日	15.04	218,200.00	3,281,728.00
871	002151	北斗星通	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	31.58	104,000.00	3,284,320.00
872	688333	铂力特	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	115.90	28,400.00	3,291,560.00
873	603005	晶方科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	21.96	150,000.00	3,294,000.00
874	300456	赛微电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	24.04	138,100.00	3,319,924.00
875	600771	广誉远	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	26.99	123,500.00	3,333,265.00



876	002402	和而泰	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.29	235,100.00	3,359,579.00
877	002318	久立特材	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	19.88	172,000.00	3,419,360.00
878	603979	金诚信	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	37.76	91,000.00	3,436,160.00
879	601567	三星医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	20.50	177,500.00	3,638,750.00
880	605589	圣泉集团	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	22.38	162,800.00	3,643,464.00
881	600711	盛屯矿业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	4.34	856,200.00	3,715,908.00
882	000034	神州数码	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	29.91	126,000.00	3,768,660.00
883	688017	绿的谐波	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	153.50	24,800.00	3,806,800.00
884	002126	银轮股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	18.67	207,000.00	3,864,690.00
885	300803	指南针	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	60.26	64,500.00	3,886,770.00
886	603087	甘李药业	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	52.65	75,000.00	3,948,750.00

887	002456	欧菲光	2024 年 1 月 8 日 -2024 年 1 月 10 日	8.71	454,000.00	3,954,340.00
888	300459	汤姆猫	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 9 日	4.94	810,000.00	4,001,400.00
889	300567	精测电子	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	87.62	46,100.00	4,039,282.00
890	688235	百济神州	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	139.04	29,300.00	4,073,872.00
891	600559	老白干酒	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	22.55	184,000.00	4,149,200.00
892	603179	新泉股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	50.71	83,300.00	4,224,143.00
893	688037	芯源微	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	133.61	33,000.00	4,409,130.00
894	688617	惠泰医疗	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	388.50	11,400.00	4,428,900.00
895	300315	掌趣科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	5.15	864,500.00	4,452,175.00
896	000818	航锦科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	31.38	141,900.00	4,452,822.00
897	600100	同方股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	7.35	608,700.00	4,473,945.00

898	300054	鼎龙股份	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	24.20	195,800.00	4,738,360.00
899	300002	神州泰岳	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.85	539,300.00	4,772,805.00
900	300573	兴齐眼药	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	182.32	26,800.00	4,886,176.00
901	600872	中炬高新	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	28.10	175,100.00	4,920,310.00
902	002405	四维图新	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	8.90	598,000.00	5,322,200.00
903	300346	南大光电	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	27.61	196,800.00	5,433,648.00
904	600777	新潮能源	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	3.06	1,862,100.00	5,698,026.00
905	002436	兴森科技	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 10 日	14.73	432,100.00	6,364,833.00
906	601099	太平洋	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 9 日	3.70	1,769,600.00	6,547,520.00
907	002176	江特电机	2024 年 1 月 3 日 -2024 年 1 月 10 日	13.50	550,200.00	7,427,700.00
908	300339	润和软件	2024 年 1 月 2 日 -2024 年 1 月 12 日	25.98	295,500.00	7,677,090.00

合计	-	-	-	-	154,737,300.00	1,516,628,491.00
----	---	---	---	---	----------------	------------------

### 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

本基金是指数型基金，紧密跟踪中证 1000 指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等，在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施，在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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开立的托管账户或其他大中型商业银行开立的存款账户，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管

理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理,对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整,且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类,违约可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主,外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险,以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外,本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级,通过单只信用产品投资占基金净资产的比例及占发行量的比例进行控制,通过分散化投资以分散信用风险。

于本期末,本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金净资产的比例为 0.02%(上期末:0.02%)。

### 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。本基金为履行与金融负债有关的义务而调整基金投资组合时,由于部分成份股流动性差,导致本基金难以及时完成组合调整,或承受较大市场冲击成本,可能产生基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的进行期货投资,以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等,主要采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

于本期末,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息。本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式,流动性风险相对较低。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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“期末本基金持有的流通受限证券”。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超过基金资产

净值的 15%。于本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合该要求。

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。

本基金持有的利率敏感性资产存在相应的利率风险。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。

##### 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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	53,155,537.79	-	-	-	53,155,537.79
结算备付金	131,010,670.01	-	-	-	131,010,670.01
存出保证金	5,452,024.50	-	-	19,077,120.00	24,529,144.50
交易性金融资产	-	1,025,067.40	927,667.09	9,004,077,344.25	9,006,030,078.74
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	38,241,915.45	38,241,915.45
应收股利	-	-	-	465.00	465.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	377,027.15	377,027.15
资产总计	189,618,232.30	1,025,067.40	927,667.09	9,061,773,871.85	9,253,344,838.64
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	18,264,019.20	18,264,019.20
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	3,332,807.60	3,332,807.60
应付托管费	-	-	-	666,561.52	666,561.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	41,457.29	41,457.29
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	61,486,403.62	61,486,403.62
负债总计	-	-	-	83,791,249.23	83,791,249.23
利率敏感度	189,618,232.30	1,025,067.40	927,667.09	8,977,982,623	9,169,553,583

缺口	30			2.62	9.41
上年度末 2022年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	26,394,628.45	-	-	-	26,394,628.45
结算备付金	161,842,593.02	-	-	-	161,842,593.02
存出保证金	9,117,488.50	-	-	29,587,344.00	38,704,832.50
交易性金融资产	-	-	2,259,282.58	10,412,530,369.35	10,414,789,651.93
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	14,906,332.09	14,906,332.09
应收股利	-	-	-	31,516.00	31,516.00
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	1,147,396.12	1,147,396.12
资产总计	197,354,709.97	-	2,259,282.58	10,458,202,957.56	10,657,816,950.11
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	9,714,572.01	9,714,572.01
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,395,261.73	4,395,261.73



应付托管费	-	-	-	879,052.32	879,052.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	94,965.09	94,965.09
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	33,908,892.89	33,908,892.89
负债总计	-	-	-	48,992,744.04	48,992,744.04
利率敏感度缺口	197,354,709.97	-	2,259,282.58	10,409,210.213.52	10,608,824.206.07

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
	1.市场利率平行上升25个基点	0.00	-32,124.94
2.市场利率平行下降25个基点	0.00	32,672.00	

#### 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。

本基金采用完全复制法，跟踪中证 1000 指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，中证 1000 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%。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，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

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	9,004,077,344.25	98.20	10,412,530,369.35	98.15
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	9,004,077,344.25	98.20	10,412,530,369.35	98.15

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）
	1.组合自身基准上升 5%	455,659,718.04	528,071,848.55
	2.组合自身基准下降 5%	-455,659,718.04	-528,071,848.55

### 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	8,985,818,117.14	10,409,387,446.05
第二层次	19,129,325.55	4,424,139.49
第三层次	1,082,636.05	978,066.39
合计	9,006,030,078.74	10,414,789,651.93

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 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	
期初余额	-	978,066.39	978,066.39
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,186,206.05	2,186,206.05
转出第三层次	-	2,420,537.65	2,420,537.65
当期利得或损失总额	-	338,901.26	338,901.26
其中：计入损益的利得或损失	-	338,901.26	338,901.26
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,082,636.05	1,082,636.05
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	-	144,411.29	144,411.29
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	

期初余额	-	2,135,107.68	2,135,107.68
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,672,841.06	1,672,841.06
转出第三层次	-	2,746,120.31	2,746,120.31
当期利得或损失总额	-	-83,762.04	-83,762.04
其中：计入损益的利得或损失	-	-83,762.04	-83,762.04
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	978,066.39	978,066.39
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	-	88,840.09	88,840.09

注：本基金持有的第三层次的交易性金融资产包含证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。本基金从第三层次转出的交易性金融资产包含限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,082,636.05	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1962~2.1988	负相关

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	978,066.39	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.2127~1.65	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上期末：同）。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,004,077,344.25	97.31
	其中：股票	9,004,077,344.25	97.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,952,734.49	0.02
	其中：债券	1,952,734.49	0.02
	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	184,166,207.80	1.99
8	其他资产	63,148,552.10	0.68
9	合计	9,253,344,838.64	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值；

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 1,516,628,491.00 元，占基金资产净值的比例为 16.54%。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	68,655,555.19	0.75
B	采矿业	279,699,168.63	3.05
C	制造业	5,834,880,394.10	63.63
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	243,046,038.00	2.65
E	建筑业	174,527,693.34	1.90
F	批发和零售业	318,869,887.92	3.48
G	交通运输、仓储和邮政业	189,754,364.23	2.07

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,039,738,144.49	11.34
J	金融业	255,954,614.04	2.79
K	房地产业	164,005,277.33	1.79
L	租赁和商务服务业	103,329,482.42	1.13
M	科学研究和技术服务业	97,700,416.08	1.07
N	水利、环境和公共设施管理业	74,587,760.62	0.81
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	38,108,448.15	0.42
R	文化、体育和娱乐业	114,469,057.10	1.25
S	综合	5,628,333.00	0.06
	合计	9,002,954,634.64	98.18

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	945,992.75	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	39,389.60	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,647.72	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	19,002.11	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,082,636.05	0.01

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

## 8.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	601099	太平洋	10,050,700	37,187,590.0 0	0.41
2	002436	兴森科技	2,503,464	36,876,024.7 2	0.40
3	002176	江特电机	2,528,100	34,129,350.0 0	0.37
4	002456	欧菲光	3,829,400	33,354,074.0 0	0.36
5	002405	四维图新	3,486,600	31,030,740.0 0	0.34
6	600777	新潮能源	9,984,200	30,551,652.0 0	0.33
7	300339	润和软件	1,166,900	30,316,062.0 0	0.33
8	300573	兴齐眼药	157,864	28,781,764.4 8	0.31
9	300054	鼎龙股份	1,111,980	26,909,916.0 0	0.29
10	600872	中炬高新	935,400	26,284,740.0 0	0.29
11	300002	神州泰岳	2,909,700	25,750,845.0 0	0.28
12	300567	精测电子	291,493	25,540,616.6 6	0.28
13	600100	同方股份	3,445,200	25,322,220.0 0	0.28
14	688617	惠泰医疗	65,123	25,300,285.5 0	0.28
15	603179	新泉股份	494,689	25,085,679.1 9	0.27
16	000818	航锦科技	793,503	24,900,124.1 4	0.27
17	600559	老白干酒	1,086,534	24,501,341.7 0	0.27
18	603087	甘李药业	431,740	22,731,111.0 0	0.25

19	688235	百济神州	161,237	22,418,392.48	0.24
20	002261	拓维信息	1,482,900	22,302,816.00	0.24
21	002126	银轮股份	1,175,300	21,942,851.00	0.24
22	300803	指南针	363,700	21,916,562.00	0.24
23	300346	南大光电	793,639	21,912,372.79	0.24
24	688017	绿的谐波	141,864	21,776,124.00	0.24
25	601567	三星医疗	1,048,500	21,494,250.00	0.23
26	603005	晶方科技	971,211	21,327,793.56	0.23
27	300315	掌趣科技	4,076,600	20,994,490.00	0.23
28	605589	圣泉集团	936,400	20,956,632.00	0.23
29	000034	神州数码	696,400	20,829,324.00	0.23
30	603979	金诚信	543,662	20,528,677.12	0.22
31	300459	汤姆猫	4,145,200	20,477,288.00	0.22
32	688327	云从科技	1,207,892	20,365,059.12	0.22
33	002318	久立特材	1,015,000	20,178,200.00	0.22
34	600711	盛屯矿业	4,599,200	19,960,528.00	0.22
35	002402	和而泰	1,386,050	19,806,654.50	0.22
36	600771	广誉远	726,100	19,597,439.00	0.21
37	002389	航天彩虹	1,038,000	19,306,800.00	0.21
38	300765	新诺威	508,801	18,632,292.62	0.20
39	600363	联创光电	547,290	18,607,860.00	0.20
40	688333	铂力特	157,153	18,214,032.70	0.20



41	300456	赛微电子	756,230	18,179,769.2 0	0.20
42	688037	芯源微	135,213	18,065,808.9 3	0.20
43	002151	北斗星通	570,700	18,022,706.0 0	0.20
44	002145	中核钛白	4,017,275	17,997,392.0 0	0.20
45	002675	东诚药业	981,300	17,987,229.0 0	0.20
46	600728	佳都科技	3,137,000	17,943,640.0 0	0.20
47	688088	虹软科技	434,828	17,845,341.1 2	0.19
48	000403	派林生物	654,030	17,815,777.2 0	0.19
49	000762	西藏矿业	622,600	17,806,360.0 0	0.19
50	688050	爱博医疗	103,224	17,758,656.9 6	0.19
51	301308	江波龙	192,012	17,674,704.6 0	0.19
52	600201	生物股份	1,628,097	17,534,604.6 9	0.19
53	002212	天融信	1,758,735	17,200,428.3 0	0.19
54	600641	万业企业	969,660	16,736,331.6 0	0.18
55	603728	鸣志电器	254,134	16,734,723.9 0	0.18
56	688639	华恒生物	132,432	16,673,188.8 0	0.18
57	600595	中孚实业	4,757,600	16,556,448.0 0	0.18
58	002221	东华能源	1,607,240	16,554,572.0 0	0.18
59	300624	万兴科技	173,100	16,375,260.0 0	0.18
60	300666	江丰电子	278,924	16,339,367.9 2	0.18
61	002317	众生药业	1,017,773	16,335,256.6 5	0.18
62	002837	英维克	592,924	16,293,551.5 2	0.18

63	688556	高测股份	417,718	16,286,824.8 2	0.18
64	000860	顺鑫农业	763,399	16,252,764.7 1	0.18
65	688110	东芯股份	471,385	16,229,785.5 5	0.18
66	600422	昆药集团	777,292	16,214,311.1 2	0.18
67	300476	胜宏科技	876,460	16,170,687.0 0	0.18
68	601677	明泰铝业	1,421,360	16,118,222.4 0	0.18
69	300775	三角防务	576,700	16,089,930.0 0	0.18
70	300068	南都电源	1,242,400	16,076,656.0 0	0.18
71	601975	招商南油	5,709,234	15,985,855.2 0	0.17
72	002312	川发龙蟒	2,235,400	15,983,110.0 0	0.17
73	002036	联创电子	1,564,790	15,976,505.9 0	0.17
74	300182	捷成股份	3,120,740	15,853,359.2 0	0.17
75	688166	博瑞医药	452,053	15,821,855.0 0	0.17
76	600330	天通股份	1,828,040	15,775,985.2 0	0.17
77	002832	比音勒芬	496,633	15,743,266.1 0	0.17
78	600685	中船防务	613,800	15,682,590.0 0	0.17
79	601375	中原证券	4,076,200	15,611,846.0 0	0.17
80	688213	思特威	280,826	15,602,692.5 6	0.17
81	300679	电连技术	374,090	15,524,735.0 0	0.17
82	688608	恒玄科技	100,534	15,509,380.1 8	0.17
83	688019	安集科技	96,806	15,465,726.5 6	0.17
84	300101	振芯科技	673,900	15,385,137.0 0	0.17

85	600667	太极实业	2,184,200	15,354,926.0 0	0.17
86	300036	超图软件	730,400	15,265,360.0 0	0.17
87	300777	中简科技	509,514	15,198,802.6 2	0.17
88	300633	开立医疗	320,800	15,173,840.0 0	0.17
89	600312	平高电气	1,188,800	15,085,872.0 0	0.16
90	688116	天奈科技	518,421	15,054,945.8 4	0.16
91	601001	晋控煤业	1,216,800	15,003,144.0 0	0.16
92	603236	移远通信	277,941	14,939,328.7 5	0.16
93	300458	全志科技	657,625	14,921,511.2 5	0.16
94	600552	凯盛科技	1,116,000	14,876,280.0 0	0.16
95	600877	电科芯片	1,059,963	14,828,882.3 7	0.16
96	002332	仙琚制药	1,160,700	14,822,139.0 0	0.16
97	000686	东北证券	2,087,400	14,820,540.0 0	0.16
98	300298	三诺生物	486,980	14,804,192.0 0	0.16
99	300294	博雅生物	439,050	14,787,204.0 0	0.16
100	002851	麦格米特	600,134	14,763,296.4 0	0.16
101	603300	华铁应急	2,297,720	14,705,408.0 0	0.16
102	600123	兰花科创	1,331,334	14,697,927.3 6	0.16
103	002015	协鑫能科	1,186,000	14,682,680.0 0	0.16
104	688578	艾力斯	351,534	14,644,906.4 4	0.16
105	002245	蔚蓝锂芯	1,715,400	14,615,208.0 0	0.16
106	002139	拓邦股份	1,496,400	14,604,864.0 0	0.16

107	300627	华测导航	470,140	14,583,742.8 0	0.16
108	000426	兴业银锡	1,606,000	14,582,480.0 0	0.16
109	002222	福晶科技	491,600	14,516,948.0 0	0.16
110	002544	普天科技	712,000	14,467,840.0 0	0.16
111	002182	宝武镁业	734,300	14,436,338.0 0	0.16
112	002727	一心堂	623,000	14,428,680.0 0	0.16
113	000032	深桑达 A	678,600	14,372,748.0 0	0.16
114	000690	宝新能源	3,235,527	14,333,384.6 1	0.16
115	600821	金开新能	2,339,500	14,317,740.0 0	0.16
116	002610	爱康科技	6,611,800	14,281,488.0 0	0.16
117	002747	埃斯顿	766,500	14,249,235.0 0	0.16
118	300762	上海瀚讯	937,424	14,136,353.9 2	0.15
119	000921	海信家电	690,700	14,090,280.0 0	0.15
120	300034	钢研高纳	692,100	14,084,235.0 0	0.15
121	002617	露笑科技	2,266,350	14,051,370.0 0	0.15
122	603477	巨星农牧	373,438	13,992,721.8 6	0.15
123	603298	杭叉集团	561,021	13,958,202.4 8	0.15
124	688066	航天宏图	330,031	13,940,509.4 4	0.15
125	002063	远光软件	2,248,408	13,895,161.4 4	0.15
126	002100	天康生物	1,583,300	13,885,541.0 0	0.15
127	600761	安徽合力	761,800	13,872,378.0 0	0.15
128	002484	江海股份	857,314	13,768,462.8 4	0.15

129	601222	林洋能源	2,146,000	13,712,940.0 0	0.15
130	300672	国科微	231,990	13,673,490.6 0	0.15
131	300229	拓尔思	810,050	13,657,443.0 0	0.15
132	002354	天娱数科	2,472,000	13,645,440.0 0	0.15
133	300482	万孚生物	450,500	13,591,585.0 0	0.15
134	688598	金博股份	194,260	13,578,774.0 0	0.15
135	300735	光弘科技	576,713	13,575,824.0 2	0.15
136	000503	国新健康	1,027,500	13,542,450.0 0	0.15
137	600612	老凤祥	196,107	13,531,383.0 0	0.15
138	300475	香农芯创	400,200	13,522,758.0 0	0.15
139	002698	博实股份	889,350	13,509,226.5 0	0.15
140	002643	万润股份	811,750	13,466,932.5 0	0.15
141	605111	新洁能	355,444	13,446,446.5 2	0.15
142	002541	鸿路钢构	618,610	13,442,395.3 0	0.15
143	000528	柳工	1,992,900	13,432,146.0 0	0.15
144	300674	宇信科技	824,540	13,423,511.2 0	0.15
145	600572	康恩贝	2,648,700	13,375,935.0 0	0.15
146	600850	电科数字	614,240	13,359,720.0 0	0.15
147	600718	东软集团	1,442,200	13,340,350.0 0	0.15
148	002424	贵州百灵	1,639,200	13,293,912.0 0	0.14
149	601965	中国汽研	601,300	13,264,678.0 0	0.14
150	600338	西藏珠峰	1,086,000	13,205,760.0 0	0.14

151	000676	智度股份	1,500,339	13,097,959.47	0.14
152	002123	梦网科技	1,173,800	13,087,870.00	0.14
153	000810	创维数字	832,700	13,081,717.00	0.14
154	600456	宝钛股份	415,400	13,039,406.00	0.14
155	300393	中来股份	1,260,519	13,033,766.46	0.14
156	300638	广和通	684,393	13,023,998.79	0.14
157	600621	华鑫股份	925,300	13,018,971.00	0.14
158	300525	博思软件	871,992	13,010,120.64	0.14
159	600452	涪陵电力	985,259	13,005,418.80	0.14
160	002011	盾安环境	945,800	13,004,750.00	0.14
161	300075	数字政通	734,860	12,933,536.00	0.14
162	002335	科华数据	466,330	12,908,014.40	0.14
163	300166	东方国信	1,372,600	12,902,440.00	0.14
164	601333	广深铁路	4,981,000	12,900,790.00	0.14
165	000035	中国天楹	2,609,100	12,888,954.00	0.14
166	600908	无锡银行	2,551,500	12,885,075.00	0.14
167	603129	春风动力	125,886	12,870,584.64	0.14
168	600116	三峡水利	1,709,100	12,869,523.00	0.14
169	002567	唐人神	1,707,750	12,808,125.00	0.14
170	002396	星网锐捷	707,700	12,788,139.00	0.14
171	603197	保隆科技	226,569	12,778,491.60	0.14
172	000875	吉电股份	2,899,800	12,759,120.00	0.14

173	601678	滨化股份	3,030,300	12,757,563.0 0	0.14
174	603063	禾望电气	508,200	12,705,000.0 0	0.14
175	688007	光峰科技	490,397	12,691,474.3 6	0.14
176	605090	九丰能源	452,140	12,628,270.2 0	0.14
177	600323	瀚蓝环境	725,800	12,578,114.0 0	0.14
178	600596	新安股份	1,374,920	12,539,270.4 0	0.14
179	600273	嘉化能源	1,456,000	12,507,040.0 0	0.14
180	600072	中船科技	674,100	12,497,814.0 0	0.14
181	002984	森麒麟	432,600	12,480,510.0 0	0.14
182	002174	游族网络	1,087,889	12,467,207.9 4	0.14
183	300083	创世纪	1,962,200	12,420,726.0 0	0.14
184	300130	新国都	513,111	12,417,286.2 0	0.14
185	600976	健民集团	190,300	12,417,075.0 0	0.14
186	002249	大洋电机	2,495,800	12,404,126.0 0	0.14
187	600483	福能股份	1,499,220	12,398,549.4 0	0.14
188	600633	浙数文化	1,120,900	12,397,154.0 0	0.14
189	300379	东方通	676,267	12,362,160.7 6	0.13
190	603108	润达医疗	606,880	12,350,008.0 0	0.13
191	002276	万马股份	1,206,700	12,332,474.0 0	0.13
192	603027	千禾味业	756,741	12,236,501.9 7	0.13
193	301035	润丰股份	174,578	12,220,460.0 0	0.13
194	300188	国投智能	758,980	12,158,859.6 0	0.13

195	600587	新华医疗	471,240	12,153,279.6 0	0.13
196	300323	华灿光电	1,656,000	12,121,920.0 0	0.13
197	300079	数码视讯	2,130,300	12,121,407.0 0	0.13
198	603083	剑桥科技	319,600	12,055,312.0 0	0.13
199	600916	中国黄金	1,220,700	12,048,309.0 0	0.13
200	601918	新集能源	2,285,300	12,043,531.0 0	0.13
201	300451	创业慧康	1,835,825	12,024,653.7 5	0.13
202	601399	国机重装	4,234,600	11,983,918.0 0	0.13
203	300170	汉得信息	1,441,500	11,978,865.0 0	0.13
204	002183	怡亚通	2,672,700	11,973,696.0 0	0.13
205	601208	东材科技	963,900	11,933,082.0 0	0.13
206	603588	高能环境	1,823,284	11,924,277.3 6	0.13
207	603505	金石资源	438,803	11,913,501.4 5	0.13
208	600185	格力地产	1,644,400	11,889,012.0 0	0.13
209	688278	特宝生物	227,078	11,887,533.3 0	0.13
210	600750	江中药业	568,100	11,861,928.0 0	0.13
211	002706	良信股份	1,341,540	11,845,798.2 0	0.13
212	601212	白银有色	4,388,300	11,804,527.0 0	0.13
213	002099	海翔药业	1,637,800	11,775,782.0 0	0.13
214	002351	漫步者	664,500	11,741,715.0 0	0.13
215	688266	泽璟制药	221,643	11,733,780.4 2	0.13
216	600110	诺德股份	2,077,500	11,717,100.0 0	0.13



217	000821	京山轻机	737,300	11,715,697.0 0	0.13
218	600395	盘江股份	1,895,600	11,695,852.0 0	0.13
219	000415	渤海租赁	5,451,600	11,666,424.0 0	0.13
220	300303	聚飞光电	1,963,600	11,644,148.0 0	0.13
221	002292	奥飞娱乐	1,326,400	11,606,000.0 0	0.13
222	000917	电广传媒	2,116,200	11,596,776.0 0	0.13
223	600285	羚锐制药	676,500	11,574,915.0 0	0.13
224	300236	上海新阳	328,400	11,566,248.0 0	0.13
225	603599	广信股份	796,945	11,555,702.5 0	0.13
226	002745	木林森	1,330,900	11,525,594.0 0	0.13
227	002400	省广集团	2,075,800	11,520,690.0 0	0.13
228	300747	锐科激光	488,917	11,504,217.0 1	0.13
229	688167	炬光科技	100,871	11,499,294.0 0	0.13
230	600267	海正药业	1,227,900	11,493,144.0 0	0.13
231	000422	湖北宜化	1,097,600	11,480,896.0 0	0.13
232	603393	新天然气	375,269	11,471,973.3 3	0.13
233	300773	拉卡拉	714,600	11,462,184.0 0	0.13
234	000923	河钢资源	681,100	11,442,480.0 0	0.12
235	300133	华策影视	1,949,200	11,441,804.0 0	0.12
236	300432	富临精工	1,089,600	11,440,800.0 0	0.12
237	600446	金证股份	988,300	11,434,631.0 0	0.12
238	600645	中源协和	563,500	11,422,145.0 0	0.12

239	300655	晶瑞电材	1,169,225	11,376,559.25	0.12
240	002807	江阴银行	3,203,300	11,371,715.00	0.12
241	002091	江苏国泰	1,450,130	11,354,517.90	0.12
242	688033	天宜上佳	671,557	11,349,313.30	0.12
243	300035	中科电气	1,076,300	11,344,202.00	0.12
244	000951	中国重汽	848,300	11,333,288.00	0.12
245	002127	南极电商	2,913,200	11,332,348.00	0.12
246	002446	盛路通信	1,362,110	11,305,513.00	0.12
247	600933	爱柯迪	513,329	11,262,438.26	0.12
248	300232	洲明科技	1,278,575	11,251,460.00	0.12
249	002130	沃尔核材	1,488,700	11,239,685.00	0.12
250	603997	继峰股份	833,588	11,228,430.36	0.12
251	300343	联创股份	1,698,496	11,210,073.60	0.12
252	300327	中颖电子	491,622	11,208,981.60	0.12
253	688016	心脉医疗	57,518	11,194,728.34	0.12
254	600602	云赛智联	966,800	11,185,876.00	0.12
255	600037	歌华有线	1,446,900	11,184,537.00	0.12
256	000012	南玻 A	2,001,649	11,149,184.93	0.12
257	000902	新洋丰	977,300	11,131,447.00	0.12
258	600057	厦门象屿	1,658,666	11,129,648.86	0.12
259	301050	雷电微力	190,720	11,111,347.20	0.12
260	300123	亚光科技	1,506,260	11,040,885.80	0.12

261	002906	华阳集团	313,079	11,036,034.7 5	0.12
262	002020	京新药业	867,100	11,029,512.0 0	0.12
263	601519	大智慧	1,490,500	10,999,890.0 0	0.12
264	300185	通裕重工	4,583,000	10,999,200.0 0	0.12
265	603279	景津装备	496,857	10,985,508.2 7	0.12
266	300027	华谊兄弟	4,097,600	10,981,568.0 0	0.12
267	002701	奥瑞金	2,652,200	10,980,108.0 0	0.12
268	600179	安通控股	4,388,500	10,971,250.0 0	0.12
269	300693	盛弘股份	366,787	10,970,599.1 7	0.12
270	002737	葵花药业	422,100	10,966,158.0 0	0.12
271	002085	万丰奥威	2,217,600	10,954,944.0 0	0.12
272	300065	海兰信	1,076,250	10,945,462.5 0	0.12
273	002079	苏州固锝	969,600	10,937,088.0 0	0.12
274	002038	双鹭药业	1,071,200	10,915,528.0 0	0.12
275	002239	奥特佳	3,352,980	10,897,185.0 0	0.12
276	601137	博威合金	701,000	10,886,530.0 0	0.12
277	600331	宏达股份	2,121,500	10,883,295.0 0	0.12
278	600064	南京高科	1,800,000	10,872,000.0 0	0.12
279	601860	紫金银行	4,288,600	10,850,158.0 0	0.12
280	600120	浙江东方	3,018,300	10,835,697.0 0	0.12
281	600055	万东医疗	634,100	10,830,428.0 0	0.12
282	002004	华邦健康	2,322,934	10,824,872.4 4	0.12

283	600216	浙江医药	1,007,998	10,815,818.5 4	0.12
284	688596	正帆科技	272,784	10,810,429.9 2	0.12
285	300226	上海钢联	379,128	10,801,356.7 2	0.12
286	000650	仁和药业	1,628,000	10,793,640.0 0	0.12
287	000727	冠捷科技	4,027,200	10,792,896.0 0	0.12
288	688139	海尔生物	266,286	10,789,908.7 2	0.12
289	300457	赢合科技	584,904	10,785,629.7 6	0.12
290	688262	国芯科技	367,269	10,775,672.4 6	0.12
291	002597	金禾实业	491,600	10,770,956.0 0	0.12
292	688106	金宏气体	446,325	10,751,969.2 5	0.12
293	600259	广晟有色	302,100	10,709,445.0 0	0.12
294	000681	视觉中国	727,500	10,694,250.0 0	0.12
295	600601	方正科技	3,699,300	10,690,977.0 0	0.12
296	688739	成大生物	328,038	10,664,515.3 8	0.12
297	002324	普利特	810,540	10,658,601.0 0	0.12
298	603678	火炬电子	401,120	10,617,646.4 0	0.12
299	000811	冰轮环境	782,400	10,617,168.0 0	0.12
300	002219	新里程	3,498,600	10,600,758.0 0	0.12
301	600206	有研新材	854,500	10,587,255.0 0	0.12
302	300332	天壕能源	1,323,202	10,519,455.9 0	0.11
303	600864	哈投股份	1,846,300	10,505,447.0 0	0.11
304	600993	马应龙	434,048	10,495,280.6 4	0.11

305	688388	嘉元科技	517,439	10,493,662.9 2	0.11
306	688518	联赢激光	511,632	10,478,223.3 6	0.11
307	002649	博彦科技	853,200	10,468,764.0 0	0.11
308	002171	楚江新材	1,397,314	10,451,908.7 2	0.11
309	002777	久远银海	414,348	10,404,278.2 8	0.11
310	000543	皖能电力	1,659,300	10,387,218.0 0	0.11
311	002291	遥望科技	1,107,000	10,383,660.0 0	0.11
312	603306	华懋科技	382,400	10,366,864.0 0	0.11
313	002985	北摩高科	298,400	10,348,512.0 0	0.11
314	600557	康缘药业	503,393	10,329,624.3 6	0.11
315	600328	中盐化工	1,320,830	10,328,890.6 0	0.11
316	300171	东富龙	572,000	10,290,280.0 0	0.11
317	300630	普利制药	454,100	10,271,742.0 0	0.11
318	600577	精达股份	2,479,700	10,265,958.0 0	0.11
319	600252	中恒集团	4,080,000	10,240,800.0 0	0.11
320	002416	爱施德	1,101,300	10,231,077.0 0	0.11
321	002773	康弘药业	554,600	10,226,824.0 0	0.11
322	688270	臻镭科技	149,325	10,210,843.5 0	0.11
323	603308	应流股份	712,180	10,205,539.4 0	0.11
324	000829	天音控股	1,069,300	10,201,122.0 0	0.11
325	300841	康华生物	131,517	10,197,828.1 8	0.11
326	300687	赛意信息	467,900	10,190,862.0 0	0.11

327	000851	高鸿股份	1,734,280	10,180,223.60	0.11
328	600562	国睿科技	735,133	10,174,240.72	0.11
329	603690	至纯科技	395,460	10,163,322.00	0.11
330	300910	瑞丰新材	220,950	10,150,443.00	0.11
331	301155	海力风电	171,486	10,143,396.90	0.11
332	002539	云图控股	1,228,100	10,131,825.00	0.11
333	300685	艾德生物	460,764	10,127,592.72	0.11
334	688083	中望软件	101,556	10,108,884.24	0.11
335	300113	顺网科技	722,000	10,108,000.00	0.11
336	600409	三友化工	1,834,400	10,070,856.00	0.11
337	603565	中谷物流	1,220,759	10,046,846.57	0.11
338	688568	中科星图	204,596	10,037,479.76	0.11
339	300398	飞凯材料	635,760	10,019,577.60	0.11
340	300319	麦捷科技	1,038,800	10,014,032.00	0.11
341	002421	达实智能	3,107,800	10,007,116.00	0.11
342	002839	张家港行	2,570,360	9,972,996.80	0.11
343	688575	亚辉龙	435,376	9,957,049.12	0.11
344	000582	北部湾港	1,324,800	9,949,248.00	0.11
345	601890	亚星锚链	1,002,790	9,927,621.00	0.11
346	600797	浙大网新	1,512,900	9,924,624.00	0.11
347	600586	金晶科技	1,478,800	9,878,384.00	0.11
348	300811	铂科新材	186,280	9,848,623.60	0.11
349	600459	贵研铂业	685,659	9,846,063.24	0.11
350	601908	京运通	2,154,100	9,844,237.00	0.11
351	000712	锦龙股份	669,100	9,815,697.00	0.11
352	000969	安泰科技	1,091,500	9,812,585.00	0.11
353	600246	万通发展	1,511,800	9,811,582.00	0.11
354	600420	国药现代	1,001,300	9,802,727.00	0.11

355	300271	华宇软件	1,195,800	9,793,602.00	0.11
356	600320	振华重工	2,948,000	9,787,360.00	0.11
357	688023	安恒信息	88,180	9,778,280.20	0.11
358	600151	航天机电	1,483,600	9,776,924.00	0.11
359	688700	东威科技	160,195	9,775,098.90	0.11
360	300827	上能电气	322,298	9,752,737.48	0.11
361	603033	三维股份	616,611	9,748,619.91	0.11
362	688326	经纬恒润	83,720	9,715,706.00	0.11
363	300463	迈克生物	643,500	9,697,545.00	0.11
364	600986	浙文互联	1,773,340	9,682,436.40	0.11
365	300077	国民技术	857,300	9,678,917.00	0.11
366	000685	中山公用	1,323,500	9,674,785.00	0.11
367	688321	微芯生物	440,762	9,674,725.90	0.11
368	300406	九强生物	506,300	9,670,330.00	0.11
369	600507	方大特钢	2,091,900	9,643,659.00	0.11
370	600971	恒源煤电	863,500	9,628,025.00	0.10
371	600782	新钢股份	2,758,500	9,627,165.00	0.10
372	600225	卓朗科技	2,532,467	9,623,374.60	0.10
373	000555	神州信息	851,500	9,613,435.00	0.10
374	601777	力帆科技	2,685,200	9,613,016.00	0.10
375	600478	科力远	1,951,300	9,600,396.00	0.10
376	600063	皖维高新	2,232,200	9,598,460.00	0.10
377	600266	城建发展	1,976,900	9,568,196.00	0.10
378	300593	新雷能	646,000	9,541,420.00	0.10
379	300470	中密控股	252,000	9,525,600.00	0.10
380	300725	药石科技	242,353	9,517,202.31	0.10
381	600740	山西焦化	1,887,076	9,510,863.04	0.10
382	000927	中国铁物	3,553,700	9,488,379.00	0.10
383	000682	东方电子	1,177,200	9,476,460.00	0.10
384	300366	创意信息	722,100	9,473,952.00	0.10
385	000049	德赛电池	349,240	9,471,388.80	0.10
386	002583	海能达	1,590,300	9,462,285.00	0.10
387	002428	云南锗业	767,400	9,462,042.00	0.10
388	002048	宁波华翔	725,085	9,433,355.85	0.10
389	600211	西藏药业	192,791	9,408,200.80	0.10
390	000758	中色股份	2,088,400	9,397,800.00	0.10
391	002467	二六三	2,024,280	9,392,659.20	0.10
392	300416	苏试试验	510,150	9,371,455.50	0.10
393	600556	天下秀	1,582,500	9,352,575.00	0.10
394	600720	中交设计	926,900	9,343,152.00	0.10
395	600688	上海石化	3,263,100	9,332,466.00	0.10
396	603348	文灿股份	240,510	9,331,788.00	0.10
397	600963	岳阳林纸	1,580,350	9,308,261.50	0.10

398	300180	华峰超纤	2,105,500	9,306,310.00	0.10
399	600775	南京熊猫	702,300	9,305,475.00	0.10
400	300260	新莱应材	305,025	9,281,910.75	0.10
401	300618	寒锐钴业	327,400	9,262,146.00	0.10
402	000982	中银绒业	6,300,600	9,261,882.00	0.10
403	601718	际华集团	3,258,400	9,253,856.00	0.10
404	603919	金徽酒	374,270	9,214,527.40	0.10
405	002003	伟星股份	844,500	9,162,825.00	0.10
406	002840	华统股份	440,600	9,160,074.00	0.10
407	300085	银之杰	637,100	9,123,272.00	0.10
408	601200	上海环境	1,013,434	9,110,771.66	0.10
409	002726	龙大美食	1,115,971	9,039,365.10	0.10
410	688158	优刻得	546,972	8,997,689.40	0.10
411	301239	普瑞眼科	104,400	8,978,400.00	0.10
412	002237	恒邦股份	831,300	8,961,414.00	0.10
413	600248	陕建股份	2,227,300	8,953,746.00	0.10
414	300855	图南股份	296,440	8,952,488.00	0.10
415	600197	伊力特	411,200	8,943,600.00	0.10
416	688798	艾为电子	129,480	8,938,004.40	0.10
417	603323	苏农银行	2,146,390	8,928,982.40	0.10
418	688389	普门科技	396,194	8,918,326.94	0.10
419	600195	中牧股份	751,800	8,916,348.00	0.10
420	600059	古越龙山	958,200	8,911,260.00	0.10
421	600366	宁波韵升	1,144,600	8,893,542.00	0.10
422	600138	中青旅	837,400	8,893,188.00	0.10
423	601126	四方股份	626,500	8,871,240.00	0.10
424	301219	腾远钴业	225,083	8,861,517.71	0.10
425	600717	天津港	2,151,987	8,844,666.57	0.10
426	300598	诚迈科技	205,907	8,839,587.51	0.10
427	601019	山东出版	942,100	8,836,898.00	0.10
428	000090	天健集团	1,920,800	8,835,680.00	0.10
429	002929	润建股份	211,600	8,830,068.00	0.10
430	002217	合力泰	3,242,400	8,819,328.00	0.10
431	002390	信邦制药	1,986,200	8,818,728.00	0.10
432	002216	三全食品	657,918	8,816,101.20	0.10
433	300623	捷捷微电	555,130	8,809,913.10	0.10
434	300031	宝通科技	475,100	8,808,354.00	0.10
435	600158	中体产业	1,131,000	8,799,180.00	0.10
436	688289	圣湘生物	449,433	8,786,415.15	0.10
437	600578	京能电力	2,967,500	8,783,800.00	0.10
438	300738	奥飞数据	828,975	8,778,845.25	0.10
439	002081	金螳螂	2,334,300	8,776,968.00	0.10
440	601858	中国科传	353,700	8,725,779.00	0.10



441	300348	长亮科技	846,150	8,723,806.50	0.10
442	600635	大众公用	2,876,718	8,687,688.36	0.09
443	300203	聚光科技	546,600	8,663,610.00	0.09
444	600729	重庆百货	307,000	8,657,400.00	0.09
445	002458	益生股份	804,500	8,656,420.00	0.09
446	300620	光库科技	191,000	8,652,300.00	0.09
447	002215	诺普信	1,042,700	8,612,702.00	0.09
448	002434	万里扬	1,156,000	8,612,200.00	0.09
449	002233	塔牌集团	1,214,307	8,597,293.56	0.09
450	688027	国盾量子	67,201	8,595,007.90	0.09
451	301015	百洋医药	239,362	8,583,521.32	0.09
452	603128	华贸物流	1,160,762	8,578,031.18	0.09
453	600888	新疆众和	1,183,700	8,569,988.00	0.09
454	688676	金盘科技	238,981	8,562,689.23	0.09
455	600869	远东股份	1,950,300	8,561,817.00	0.09
456	002258	利尔化学	714,946	8,557,903.62	0.09
457	300224	正海磁材	729,600	8,550,912.00	0.09
458	301153	中科江南	108,800	8,515,776.00	0.09
459	603556	海兴电力	293,250	8,513,047.50	0.09
460	688091	上海谊众	132,832	8,501,248.00	0.09
461	000420	吉林化纤	2,917,100	8,488,761.00	0.09
462	600210	紫江企业	1,802,700	8,472,690.00	0.09
463	301031	中熔电气	64,720	8,462,787.20	0.09
464	600675	中华企业	2,685,555	8,459,498.25	0.09
465	000028	国药一致	291,460	8,449,425.40	0.09
466	601311	骆驼股份	1,051,500	8,422,515.00	0.09
467	688789	宏华数科	84,287	8,421,114.17	0.09
468	600428	中远海特	1,570,200	8,416,272.00	0.09
469	688322	奥比中光	223,837	8,411,794.46	0.09
470	002488	金固股份	1,171,000	8,407,780.00	0.09
471	002585	双星新材	1,036,520	8,406,177.20	0.09
472	300109	新开源	465,718	8,401,552.72	0.09
473	002006	精工科技	549,522	8,396,696.16	0.09
474	688366	昊海生科	77,504	8,392,908.16	0.09
475	688707	振华新材	409,288	8,390,404.00	0.09
476	300087	荃银高科	1,001,220	8,390,223.60	0.09
477	300151	昌红科技	456,100	8,383,118.00	0.09
478	002061	浙江交科	2,292,380	8,367,187.00	0.09
479	603876	鼎胜新材	667,720	8,366,531.60	0.09
480	301095	广立微	111,581	8,338,448.13	0.09
481	000627	天茂集团	2,928,600	8,317,224.00	0.09
482	600502	安徽建工	1,788,000	8,314,200.00	0.09
483	000065	北方国际	740,777	8,311,517.94	0.09

484	600125	铁龙物流	1,371,600	8,298,180.00	0.09
485	603566	普莱柯	366,200	8,294,430.00	0.09
486	600295	鄂尔多斯	854,380	8,287,486.00	0.09
487	600098	广州发展	1,543,200	8,286,984.00	0.09
488	601369	陕鼓动力	1,035,500	8,263,290.00	0.09
489	300352	北信源	1,736,800	8,249,800.00	0.09
490	300770	新媒股份	212,997	8,238,723.96	0.09
491	600277	亿利洁能	3,127,320	8,224,851.60	0.09
492	601952	苏垦农发	802,970	8,222,412.80	0.09
493	603100	川仪股份	296,100	8,207,892.00	0.09
494	688192	迪哲医药	171,282	8,195,843.70	0.09
495	603985	恒润股份	329,740	8,194,039.00	0.09
496	002214	大立科技	713,860	8,187,974.20	0.09
497	600360	华微电子	1,132,100	8,185,083.00	0.09
498	688408	中信博	114,024	8,181,222.00	0.09
499	300723	一品红	274,225	8,180,131.75	0.09
500	002453	华软科技	723,700	8,177,810.00	0.09
501	000915	华特达因	282,211	8,172,830.56	0.09
502	000767	晋控电力	2,708,000	8,151,080.00	0.09
503	600477	杭萧钢构	2,473,522	8,137,887.38	0.09
504	688123	聚辰股份	132,793	8,130,915.39	0.09
505	301171	易点天下	411,200	8,129,424.00	0.09
506	002191	劲嘉股份	1,508,300	8,099,571.00	0.09
507	002859	洁美科技	324,500	8,096,275.00	0.09
508	300158	振东制药	1,198,900	8,092,575.00	0.09
509	002108	沧州明珠	1,958,389	8,048,978.79	0.09
510	300634	彩讯股份	392,900	8,042,663.00	0.09
511	600776	东方通信	712,000	8,038,480.00	0.09
512	002060	粤水电	1,635,900	8,032,269.00	0.09
513	000837	秦川机床	745,700	8,016,275.00	0.09
514	600773	西藏城投	729,000	7,989,840.00	0.09
515	002537	海联金汇	1,198,640	7,982,942.40	0.09
516	603881	数据港	402,444	7,976,440.08	0.09
517	000735	罗牛山	1,381,100	7,968,947.00	0.09
518	002948	青岛银行	2,606,100	7,948,605.00	0.09
519	002550	千红制药	1,349,800	7,936,824.00	0.09
520	002124	天邦食品	2,182,900	7,923,927.00	0.09
521	002635	安洁科技	483,900	7,902,087.00	0.09
522	301358	湖南裕能	232,300	7,886,585.00	0.09
523	301039	中集车辆	840,564	7,884,490.32	0.09
524	300663	科蓝软件	557,400	7,881,636.00	0.09
525	603888	新华网	312,773	7,878,751.87	0.09
526	603595	东尼电子	213,991	7,872,728.89	0.09

527	688630	芯碁微装	91,919	7,847,125.03	0.09
528	000059	华锦股份	1,428,800	7,844,112.00	0.09
529	603638	艾迪精密	482,640	7,842,900.00	0.09
530	300428	立中集团	370,318	7,821,116.16	0.09
531	002250	联化科技	1,095,200	7,808,776.00	0.09
532	600682	南京新百	1,013,380	7,803,026.00	0.09
533	603766	隆鑫通用	1,511,900	7,801,404.00	0.09
534	002498	汉缆股份	1,949,200	7,796,800.00	0.09
535	000488	晨鸣纸业	2,007,500	7,789,100.00	0.08
536	002068	黑猫股份	670,900	7,782,440.00	0.08
537	600996	贵广网络	868,300	7,779,968.00	0.08
538	002023	海特高新	854,600	7,776,860.00	0.08
539	300409	道氏技术	696,500	7,759,010.00	0.08
540	002163	海南发展	853,100	7,746,148.00	0.08
541	601702	华峰铝业	431,400	7,743,630.00	0.08
542	600389	江山股份	444,720	7,738,128.00	0.08
543	605123	派克新材	84,693	7,724,001.60	0.08
544	301071	力量钻石	238,900	7,716,470.00	0.08
545	300761	立华股份	367,868	7,714,191.96	0.08
546	002960	青鸟消防	555,454	7,687,483.36	0.08
547	300369	绿盟科技	814,000	7,676,020.00	0.08
548	300613	富瀚微	180,657	7,667,083.08	0.08
549	600335	国机汽车	861,400	7,666,460.00	0.08
550	601619	嘉泽新能	2,169,100	7,656,923.00	0.08
551	000989	九芝堂	756,300	7,653,756.00	0.08
552	002077	大港股份	499,900	7,623,475.00	0.08
553	002847	盐津铺子	109,700	7,621,956.00	0.08
554	300263	隆华科技	1,076,400	7,577,856.00	0.08
555	300261	雅本化学	1,015,300	7,574,138.00	0.08
556	000901	航天科技	812,518	7,572,667.76	0.08
557	300726	宏达电子	250,803	7,571,742.57	0.08
558	300671	富满微	233,800	7,558,754.00	0.08
559	600531	豫光金铅	1,247,400	7,546,770.00	0.08
560	601028	玉龙股份	701,900	7,517,349.00	0.08
561	600811	东方集团	3,770,400	7,503,096.00	0.08
562	002612	朗姿股份	389,100	7,482,393.00	0.08
563	688439	振华风光	83,933	7,479,269.63	0.08
564	600305	恒顺醋业	809,592	7,456,342.32	0.08
565	000848	承德露露	949,800	7,455,930.00	0.08
566	600449	宁夏建材	415,700	7,453,501.00	0.08
567	301047	义翘神州	90,329	7,443,109.60	0.08
568	600017	日照港	2,706,300	7,442,325.00	0.08
569	600480	凌云股份	815,806	7,431,992.66	0.08

570	002254	泰和新材	496,405	7,426,218.80	0.08
571	300869	康泰医学	358,900	7,404,107.00	0.08
572	300587	天铁股份	1,263,115	7,376,591.60	0.08
573	600643	爱建集团	1,445,153	7,370,280.30	0.08
574	300233	金城医药	440,700	7,342,062.00	0.08
575	603713	密尔克卫	137,900	7,337,659.00	0.08
576	600313	农发种业	983,800	7,329,310.00	0.08
577	002349	精华制药	826,300	7,329,281.00	0.08
578	000657	中钨高新	862,708	7,315,763.84	0.08
579	600966	博汇纸业	1,174,000	7,290,540.00	0.08
580	301268	铭利达	244,300	7,287,469.00	0.08
581	000756	新华制药	357,400	7,283,812.00	0.08
582	600997	开滦股份	954,300	7,281,309.00	0.08
583	300284	苏交科	1,334,756	7,274,420.20	0.08
584	000928	中钢国际	1,247,000	7,270,010.00	0.08
585	300596	利安隆	245,200	7,248,112.00	0.08
586	300039	上海凯宝	1,087,300	7,230,545.00	0.08
587	600223	福瑞达	749,700	7,219,611.00	0.08
588	601528	瑞丰银行	1,455,260	7,203,537.00	0.08
589	600623	华谊集团	1,115,600	7,184,464.00	0.08
590	600496	精工钢构	2,355,500	7,184,275.00	0.08
591	603466	风语筑	499,335	7,180,437.30	0.08
592	000990	诚志股份	873,160	7,168,643.60	0.08
593	002101	广东鸿图	470,600	7,167,238.00	0.08
594	000552	甘肃能化	2,348,100	7,161,705.00	0.08
595	688339	亿华通	156,489	7,157,806.86	0.08
596	002626	金达威	438,000	7,152,540.00	0.08
597	002158	汉钟精机	321,200	7,149,912.00	0.08
598	688198	佰仁医疗	57,305	7,136,191.65	0.08
599	001287	中电港	342,386	7,131,900.38	0.08
600	688559	海目星	199,745	7,130,896.50	0.08
601	603612	索通发展	462,204	7,113,319.56	0.08
602	000966	长源电力	1,602,800	7,100,404.00	0.08
603	603169	兰石重装	1,151,000	7,090,160.00	0.08
604	600812	华北制药	1,243,000	7,085,100.00	0.08
605	603368	柳药集团	374,168	7,079,258.56	0.08
606	688711	宏微科技	170,258	7,064,004.42	0.08
607	300820	英杰电气	123,168	7,055,063.04	0.08
608	002895	川恒股份	370,900	7,047,100.00	0.08
609	688400	凌云光	259,372	7,003,044.00	0.08
610	688018	乐鑫科技	67,812	6,981,245.40	0.08
611	603896	寿仙谷	216,535	6,981,088.40	0.08
612	600751	海航科技	2,651,400	6,946,668.00	0.08

613	688318	财富趋势	54,826	6,924,523.80	0.08
614	300401	花园生物	586,260	6,923,730.60	0.08
615	002243	力合科创	870,300	6,918,885.00	0.08
616	600649	城投控股	1,867,300	6,909,010.00	0.08
617	688239	航宇科技	144,568	6,906,013.36	0.08
618	603113	金能科技	855,500	6,903,885.00	0.08
619	002605	姚记科技	310,500	6,899,310.00	0.08
620	000603	盛达资源	623,900	6,894,095.00	0.08
621	603567	珍宝岛	566,900	6,893,504.00	0.08
622	002097	山河智能	1,123,257	6,885,565.41	0.08
623	688409	富创精密	87,732	6,870,292.92	0.07
624	601011	宝泰隆	1,961,900	6,866,650.00	0.07
625	001270	铖昌科技	109,480	6,865,490.80	0.07
626	002928	华夏航空	959,825	6,853,150.50	0.07
627	002705	新宝股份	470,100	6,849,357.00	0.07
628	002581	未名医药	469,100	6,848,860.00	0.07
629	300443	金雷股份	248,003	6,842,402.77	0.07
630	001696	宗申动力	1,031,000	6,835,530.00	0.07
631	002283	天润工业	1,168,400	6,835,140.00	0.07
632	600490	鹏欣资源	2,278,800	6,813,612.00	0.07
633	002226	江南化工	1,552,900	6,801,702.00	0.07
634	605376	博迁新材	240,000	6,768,000.00	0.07
635	600073	上海梅林	992,500	6,758,925.00	0.07
636	600006	东风汽车	1,171,000	6,756,670.00	0.07
637	300772	运达股份	633,550	6,740,972.00	0.07
638	003021	兆威机电	71,700	6,739,083.00	0.07
639	603008	喜临门	396,032	6,736,504.32	0.07
640	600550	保变电气	1,380,100	6,734,888.00	0.07
641	000828	东莞控股	626,300	6,726,462.00	0.07
642	603171	税友股份	190,000	6,722,200.00	0.07
643	002545	东方铁塔	938,900	6,713,135.00	0.07
644	300377	赢时胜	864,850	6,711,236.00	0.07
645	601949	中国出版	827,600	6,687,008.00	0.07
646	601606	长城军工	548,600	6,681,948.00	0.07
647	002041	登海种业	504,899	6,679,813.77	0.07
648	603043	广州酒家	341,720	6,673,791.60	0.07
649	300119	瑞普生物	406,769	6,666,943.91	0.07
650	300358	楚天科技	622,900	6,665,030.00	0.07
651	688696	极米科技	58,781	6,641,077.38	0.07
652	688403	汇成股份	628,088	6,626,328.40	0.07
653	002993	奥海科技	173,900	6,625,590.00	0.07
654	600391	航发科技	346,100	6,617,432.00	0.07
655	000088	盐田港	1,354,520	6,610,057.60	0.07

656	002218	拓日新能	1,465,500	6,609,405.00	0.07
657	000061	农产品	1,020,700	6,603,929.00	0.07
658	603533	掌阅科技	331,800	6,596,184.00	0.07
659	002043	兔宝宝	744,400	6,595,384.00	0.07
660	601163	三角轮胎	456,600	6,579,606.00	0.07
661	688131	皓元医药	126,251	6,572,627.06	0.07
662	605168	三人行	103,421	6,552,754.56	0.07
663	000016	深康佳 A	1,571,100	6,551,487.00	0.07
664	600075	新疆天业	1,509,073	6,519,195.36	0.07
665	603636	南威软件	508,103	6,513,880.46	0.07
666	000567	海德股份	611,058	6,495,546.54	0.07
667	000006	深振业 A	1,410,700	6,475,113.00	0.07
668	600787	中储股份	1,267,600	6,464,760.00	0.07
669	603801	志邦家居	384,533	6,448,618.41	0.07
670	603871	嘉友国际	406,325	6,444,314.50	0.07
671	603123	翠微股份	604,098	6,433,643.70	0.07
672	600284	浦东建设	1,020,916	6,431,770.80	0.07
673	688127	蓝特光学	275,697	6,420,983.13	0.07
674	600861	北京人力	340,400	6,379,096.00	0.07
675	300639	凯普生物	682,871	6,378,015.14	0.07
676	000795	英洛华	1,022,500	6,370,175.00	0.07
677	688202	美迪西	93,105	6,366,519.90	0.07
678	603118	共进股份	708,000	6,343,680.00	0.07
679	002440	闰土股份	1,035,000	6,313,500.00	0.07
680	600361	创新新材	1,254,700	6,286,047.00	0.07
681	301087	可孚医疗	165,792	6,283,516.80	0.07
682	300602	飞荣达	346,412	6,259,664.84	0.07
683	000557	西部创业	1,295,900	6,259,197.00	0.07
684	601882	海天精工	239,300	6,257,695.00	0.07
685	002967	广电计量	416,631	6,253,631.31	0.07
686	002274	华昌化工	828,100	6,252,155.00	0.07
687	300143	盈康生命	585,700	6,225,991.00	0.07
688	300497	富祥药业	664,940	6,223,838.40	0.07
689	000950	重药控股	1,251,100	6,217,967.00	0.07
690	002987	京北方	333,367	6,193,958.86	0.07
691	600491	龙元建设	1,567,100	6,174,374.00	0.07
692	688097	博众精工	183,406	6,162,441.60	0.07
693	000935	四川双马	343,700	6,159,104.00	0.07
694	002125	湘潭电化	575,600	6,153,164.00	0.07
695	688048	长光华芯	97,608	6,117,093.36	0.07
696	603212	赛伍技术	351,800	6,110,766.00	0.07
697	002979	雷赛智能	283,355	6,106,300.25	0.07
698	600058	五矿发展	650,901	6,105,451.38	0.07

699	002194	武汉凡谷	618,400	6,097,424.00	0.07
700	300080	易成新能	1,259,000	6,093,560.00	0.07
701	300455	航天智装	509,900	6,088,206.00	0.07
702	300792	壹网壹创	253,837	6,084,472.89	0.07
703	600882	妙可蓝多	378,400	6,080,888.00	0.07
704	603936	博敏电子	582,140	6,077,541.60	0.07
705	600610	中毅达	647,100	6,076,269.00	0.07
706	601326	秦港股份	2,127,600	6,063,660.00	0.07
707	603699	纽威股份	436,900	6,055,434.00	0.07
708	688133	泰坦科技	130,582	6,052,475.70	0.07
709	603666	亿嘉和	192,229	6,034,068.31	0.07
710	002913	奥士康	196,600	6,025,790.00	0.07
711	300134	大富科技	583,600	6,022,752.00	0.07
712	603328	依顿电子	738,700	6,020,405.00	0.07
713	000719	中原传媒	617,800	6,011,194.00	0.07
714	688100	威胜信息	207,571	6,002,953.32	0.07
715	600340	华夏幸福	3,448,900	6,001,086.00	0.07
716	603187	海容冷链	395,248	5,991,959.68	0.07
717	002206	海利得	1,193,250	5,990,115.00	0.07
718	002941	新疆交建	459,900	5,987,898.00	0.07
719	603906	龙蟠科技	480,440	5,986,282.40	0.07
720	688298	东方生物	167,378	5,985,437.28	0.07
721	002135	东南网架	1,034,400	5,978,832.00	0.07
722	601801	皖新传媒	859,300	5,972,135.00	0.07
723	600955	维远股份	332,490	5,968,195.50	0.07
724	002891	中宠股份	226,283	5,962,557.05	0.07
725	000550	江铃汽车	313,000	5,956,390.00	0.06
726	002051	中工国际	733,100	5,952,772.00	0.06
727	600169	太原重工	2,513,500	5,931,860.00	0.06
728	300821	东岳硅材	714,600	5,931,180.00	0.06
729	002697	红旗连锁	1,190,300	5,927,694.00	0.06
730	002556	辉隆股份	1,006,900	5,920,572.00	0.06
731	603920	世运电路	323,690	5,917,053.20	0.06
732	605507	国邦医药	336,700	5,912,452.00	0.06
733	000048	京基智农	323,000	5,910,900.00	0.06
734	600007	中国国贸	304,501	5,901,229.38	0.06
735	300662	科锐国际	213,400	5,894,108.00	0.06
736	300267	尔康制药	1,833,600	5,885,856.00	0.06
737	002320	海峡股份	1,007,937	5,876,272.71	0.06
738	301080	百普赛斯	99,563	5,868,243.22	0.06
739	603583	捷昌驱动	292,320	5,855,169.60	0.06
740	688383	新益昌	55,870	5,854,617.30	0.06
741	688776	国光电气	59,957	5,839,212.23	0.06

742	300856	科思股份	93,700	5,830,951.00	0.06
743	301238	瑞泰新材	332,597	5,830,425.41	0.06
744	000801	四川九洲	755,748	5,819,259.60	0.06
745	605020	永和股份	232,600	5,817,326.00	0.06
746	002489	浙江永强	1,912,700	5,814,608.00	0.06
747	000672	上峰水泥	720,400	5,806,424.00	0.06
748	000718	苏宁环球	2,240,100	5,801,859.00	0.06
749	600508	上海能源	418,395	5,798,954.70	0.06
750	003012	东鹏控股	701,300	5,785,725.00	0.06
751	601969	海南矿业	877,500	5,782,725.00	0.06
752	601609	金田股份	853,000	5,774,810.00	0.06
753	601963	重庆银行	824,500	5,738,520.00	0.06
754	600458	时代新材	621,400	5,723,094.00	0.06
755	300382	斯莱克	574,700	5,706,771.00	0.06
756	000597	东北制药	1,065,258	5,699,130.30	0.06
757	600691	阳煤化工	1,770,900	5,684,589.00	0.06
758	688733	壹石通	193,513	5,664,125.51	0.06
759	603229	奥翔药业	427,616	5,648,807.36	0.06
760	688686	奥普特	50,420	5,647,040.00	0.06
761	600780	通宝能源	688,000	5,641,600.00	0.06
762	000913	钱江摩托	452,100	5,637,687.00	0.06
763	301205	联特科技	53,800	5,635,550.00	0.06
764	001213	中铁特货	1,341,200	5,633,040.00	0.06
765	600770	综艺股份	1,146,300	5,628,333.00	0.06
766	002990	盛视科技	162,900	5,624,937.00	0.06
767	600648	外高桥	570,400	5,624,144.00	0.06
768	300768	迪普科技	379,150	5,603,837.00	0.06
769	002646	天佑德酒	411,700	5,603,237.00	0.06
770	002242	九阳股份	440,337	5,596,683.27	0.06
771	601515	东峰集团	1,380,980	5,579,159.20	0.06
772	600172	黄河旋风	1,490,700	5,575,218.00	0.06
773	003040	楚天龙	281,900	5,511,145.00	0.06
774	600575	淮河能源	2,285,600	5,508,296.00	0.06
775	301078	孩子王	669,800	5,499,058.00	0.06
776	301069	凯盛新材	255,733	5,477,800.86	0.06
777	000560	我爱我家	2,434,430	5,477,467.50	0.06
778	300783	三只松鼠	303,400	5,476,370.00	0.06
779	300527	中船应急	716,635	5,460,758.70	0.06
780	688261	东微半导	65,310	5,459,262.90	0.06
781	600835	上海机电	459,900	5,459,013.00	0.06
782	301175	中科环保	1,091,900	5,448,581.00	0.06
783	600710	苏美达	767,500	5,441,575.00	0.06
784	600012	皖通高速	493,600	5,439,472.00	0.06



785	603730	岱美股份	375,062	5,434,648.38	0.06
786	300579	数字认证	209,640	5,421,290.40	0.06
787	002516	旷达科技	1,091,300	5,380,109.00	0.06
788	603010	万盛股份	498,509	5,378,912.11	0.06
789	000498	山东路桥	953,000	5,374,920.00	0.06
790	688508	芯朋微	108,941	5,360,986.61	0.06
791	688586	江航装备	483,236	5,359,087.24	0.06
792	301216	万凯新材	379,250	5,358,802.50	0.06
793	000600	建投能源	1,068,200	5,351,682.00	0.06
794	688356	键凯科技	50,291	5,350,962.40	0.06
795	002746	仙坛股份	759,772	5,348,794.88	0.06
796	601015	陕西黑猫	1,192,400	5,341,952.00	0.06
797	002088	鲁阳节能	373,750	5,325,937.50	0.06
798	600217	中再资环	1,212,300	5,309,874.00	0.06
799	688392	骄成超声	63,589	5,303,958.49	0.06
800	688381	帝奥微	209,398	5,301,957.36	0.06
801	688238	和元生物	589,741	5,301,771.59	0.06
802	002573	清新环境	1,068,900	5,291,055.00	0.06
803	688800	瑞可达	131,519	5,284,433.42	0.06
804	002461	珠江啤酒	668,200	5,278,780.00	0.06
805	603719	良品铺子	244,700	5,275,732.00	0.06
806	601101	昊华能源	833,600	5,268,352.00	0.06
807	603989	艾华集团	244,650	5,264,868.00	0.06
808	002741	光华科技	352,400	5,240,188.00	0.06
809	300183	东软载波	346,500	5,228,685.00	0.06
810	002190	成飞集成	275,100	5,218,647.00	0.06
811	300737	科顺股份	849,760	5,217,526.40	0.06
812	603733	仙鹤股份	322,400	5,203,536.00	0.06
813	601869	长飞光纤	189,400	5,200,924.00	0.06
814	002204	大连重工	1,137,300	5,197,461.00	0.06
815	301207	华兰疫苗	186,861	5,194,735.80	0.06
816	688660	电气风电	1,005,252	5,166,995.28	0.06
817	000869	张裕 A	213,900	5,163,546.00	0.06
818	601921	浙版传媒	670,200	5,120,328.00	0.06
819	000881	中广核技	705,700	5,116,325.00	0.06
820	000968	蓝焰控股	719,200	5,113,512.00	0.06
821	603301	振德医疗	207,126	5,074,587.00	0.06
822	000062	深圳华强	449,015	5,060,399.05	0.06
823	603718	海利生物	467,800	5,010,138.00	0.05
824	603105	芯能科技	432,000	5,002,560.00	0.05
825	002034	旺能环境	326,000	4,971,500.00	0.05
826	600783	鲁信创投	429,200	4,970,136.00	0.05
827	600874	创业环保	894,200	4,962,810.00	0.05

828	002932	明德生物	215,889	4,958,970.33	0.05
829	688232	新点软件	136,983	4,958,784.60	0.05
830	603915	国茂股份	300,740	4,956,195.20	0.05
831	600662	外服控股	1,028,301	4,935,844.80	0.05
832	300653	正海生物	170,066	4,935,315.32	0.05
833	002267	陕天然气	670,900	4,917,697.00	0.05
834	600163	中闽能源	1,123,100	4,907,947.00	0.05
835	000688	国城矿业	475,800	4,905,498.00	0.05
836	000789	万年青	712,670	4,888,916.20	0.05
837	600639	浦东金桥	481,700	4,869,987.00	0.05
838	600604	市北高新	1,051,300	4,867,519.00	0.05
839	601069	西部黄金	403,000	4,860,180.00	0.05
840	002302	西部建设	745,700	4,832,136.00	0.05
841	603609	禾丰股份	562,100	4,811,576.00	0.05
842	000736	中交地产	491,300	4,809,827.00	0.05
843	002307	北新路桥	1,123,140	4,762,113.60	0.05
844	002645	华宏科技	420,600	4,752,780.00	0.05
845	600929	雪天盐业	736,400	4,749,780.00	0.05
846	688185	康希诺	63,617	4,740,738.84	0.05
847	000025	特力 A	297,900	4,739,589.00	0.05
848	600810	神马股份	637,031	4,739,510.64	0.05
849	002866	传艺科技	223,200	4,736,304.00	0.05
850	301089	拓新药业	87,542	4,728,143.42	0.05
851	300696	爱乐达	270,475	4,708,969.75	0.05
852	603055	台华新材	391,000	4,707,640.00	0.05
853	603439	贵州三力	247,800	4,678,464.00	0.05
854	300702	天宇股份	215,480	4,678,070.80	0.05
855	002901	大博医疗	114,500	4,647,555.00	0.05
856	300767	震安科技	266,710	4,635,419.80	0.05
857	603281	江瀚新材	175,580	4,615,998.20	0.05
858	000029	深深房 A	391,600	4,605,216.00	0.05
859	002314	南山控股	1,582,300	4,588,670.00	0.05
860	688680	海优新材	69,806	4,582,763.90	0.05
861	603297	永新光学	46,100	4,580,035.00	0.05
862	688046	药康生物	226,947	4,572,982.05	0.05
863	300973	立高食品	93,759	4,551,999.45	0.05
864	601886	江河集团	681,100	4,536,126.00	0.05
865	000737	北方铜业	778,900	4,517,620.00	0.05
866	002768	国恩股份	210,500	4,508,910.00	0.05
867	688268	华特气体	66,735	4,496,604.30	0.05
868	603995	甬金股份	233,800	4,495,974.00	0.05
869	002815	崇达技术	466,300	4,467,154.00	0.05
870	603098	森特股份	327,300	4,454,553.00	0.05

871	600657	信达地产	1,240,200	4,452,318.00	0.05
872	603025	大豪科技	334,780	4,439,182.80	0.05
873	603396	金辰股份	80,200	4,382,930.00	0.05
874	301217	铜冠铜箔	368,221	4,367,101.06	0.05
875	002201	正威新材	604,018	4,367,050.14	0.05
876	300206	理邦仪器	420,700	4,295,347.00	0.05
877	000885	城发环境	378,340	4,290,375.60	0.05
878	600876	凯盛新能	305,000	4,279,150.00	0.05
879	002782	可立克	304,400	4,276,820.00	0.05
880	600475	华光环能	411,049	4,274,909.60	0.05
881	688001	华兴源创	122,307	4,274,629.65	0.05
882	603938	三孚股份	234,540	4,217,029.20	0.05
883	002534	西子洁能	334,800	4,181,652.00	0.05
884	300741	华宝股份	193,300	4,138,553.00	0.05
885	603170	宝立食品	244,200	4,129,422.00	0.05
886	300894	火星人	254,100	4,126,584.00	0.05
887	301293	三博脑科	65,800	4,107,236.00	0.04
888	301267	华夏眼科	127,806	4,101,294.54	0.04
889	000813	德展健康	1,253,400	4,098,618.00	0.04
890	301060	兰卫医学	308,109	4,094,768.61	0.04
891	603013	亚普股份	235,600	4,071,168.00	0.04
892	605333	沪光股份	204,100	4,061,590.00	0.04
893	002549	凯美特气	414,300	4,051,854.00	0.04
894	002378	章源钨业	715,330	4,048,767.80	0.04
895	601330	绿色动力	609,600	4,047,744.00	0.04
896	688337	普源精电	92,126	4,041,567.62	0.04
897	688315	诺禾致源	172,758	4,032,171.72	0.04
898	003006	百亚股份	265,000	4,017,400.00	0.04
899	000030	富奥股份	749,700	4,003,398.00	0.04
900	603363	傲农生物	659,200	4,001,344.00	0.04
901	688173	希荻微	226,478	3,983,748.02	0.04
902	000791	甘肃能源	714,840	3,981,658.80	0.04
903	688380	中微半导	166,201	3,965,555.86	0.04
904	301327	华宝新能	51,865	3,962,486.00	0.04
905	001301	尚太科技	108,200	3,962,284.00	0.04
906	688526	科前生物	193,523	3,943,998.74	0.04
907	603071	物产环能	259,098	3,938,289.60	0.04
908	002275	桂林三金	271,000	3,926,790.00	0.04
909	688206	概伦电子	180,085	3,925,853.00	0.04
910	000761	本钢板材	1,098,900	3,923,073.00	0.04
911	300953	震裕科技	71,033	3,919,600.94	0.04
912	300887	谱尼测试	330,583	3,904,185.23	0.04
913	002053	云南能投	402,300	3,870,126.00	0.04

914	301325	曼恩斯特	49,800	3,861,492.00	0.04
915	600903	贵州燃气	487,800	3,848,742.00	0.04
916	600400	红豆股份	1,379,300	3,848,247.00	0.04
917	002677	浙江美大	380,300	3,844,833.00	0.04
918	603489	八方股份	69,792	3,835,070.40	0.04
919	300208	青岛中程	571,600	3,818,288.00	0.04
920	603299	苏盐井神	447,700	3,814,404.00	0.04
921	605222	起帆电缆	196,300	3,784,664.00	0.04
922	001311	多利科技	76,200	3,772,662.00	0.04
923	688368	晶丰明源	34,841	3,760,737.54	0.04
924	603877	太平鸟	219,415	3,747,608.20	0.04
925	600696	岩石股份	208,000	3,741,920.00	0.04
926	002991	甘源食品	51,600	3,687,336.00	0.04
927	688372	伟测科技	47,030	3,687,152.00	0.04
928	603032	德新科技	180,400	3,662,120.00	0.04
929	301291	明阳电气	129,000	3,658,440.00	0.04
930	301090	华润材料	336,100	3,650,046.00	0.04
931	002724	海洋王	442,600	3,638,172.00	0.04
932	600510	黑牡丹	635,300	3,589,445.00	0.04
933	300755	华致酒行	195,880	3,582,645.20	0.04
934	688190	云路股份	49,780	3,565,741.40	0.04
935	002950	奥美医疗	373,950	3,545,046.00	0.04
936	000019	深粮控股	469,500	3,540,030.00	0.04
937	002838	道恩股份	274,900	3,521,469.00	0.04
938	000517	荣安地产	1,423,300	3,487,085.00	0.04
939	002918	蒙娜丽莎	257,450	3,485,873.00	0.04
940	603093	南华期货	286,200	3,434,400.00	0.04
941	002978	安宁股份	106,700	3,378,122.00	0.04
942	601811	新华文轩	247,100	3,375,386.00	0.04
943	001258	立新能源	407,000	3,288,560.00	0.04
944	002959	小熊电器	62,550	3,248,221.50	0.04
945	688351	微电生理	125,203	3,211,456.95	0.04
946	605009	豪悦护理	82,596	3,152,689.32	0.03
947	301165	锐捷网络	83,100	3,148,659.00	0.03
948	688499	利元亨	82,348	3,135,811.84	0.03
949	603693	江苏新能	279,560	3,133,867.60	0.03
950	688031	星环科技	48,149	3,133,055.43	0.03
951	301367	怡和嘉业	25,480	3,102,190.00	0.03
952	688275	万润新能	50,255	3,099,225.85	0.03
953	002961	瑞达期货	207,600	3,093,240.00	0.03
954	600618	氯碱化工	338,500	3,080,350.00	0.03
955	002651	利君股份	444,300	3,074,556.00	0.03
956	002946	新乳业	266,900	3,064,012.00	0.03

957	000058	深赛格	426,400	3,057,288.00	0.03
958	301301	川宁生物	363,100	3,050,040.00	0.03
959	688209	英集芯	169,216	3,022,197.76	0.03
960	300860	锋尚文化	54,700	2,988,261.00	0.03
961	003039	顺控发展	193,800	2,938,008.00	0.03
962	688161	威高骨科	69,307	2,872,775.15	0.03
963	605338	巴比食品	133,100	2,858,988.00	0.03
964	003009	中天火箭	62,000	2,858,820.00	0.03
965	001338	永顺泰	236,600	2,853,396.00	0.03
966	603208	江山欧派	94,243	2,798,074.67	0.03
967	001308	康冠科技	99,600	2,786,808.00	0.03
968	600403	大有能源	712,100	2,705,980.00	0.03
969	603983	丸美股份	106,700	2,696,309.00	0.03
970	001236	弘业期货	238,100	2,661,958.00	0.03
971	002265	建设工业	228,800	2,599,168.00	0.03
972	601022	宁波远洋	227,800	2,526,302.00	0.03
973	605369	拱东医疗	45,000	2,511,900.00	0.03
974	603057	紫燕食品	109,648	2,366,203.84	0.03
975	002911	佛燃能源	205,800	2,358,468.00	0.03
976	603132	金徽股份	171,600	2,347,488.00	0.03
977	001337	四川黄金	83,800	2,315,394.00	0.03
978	002096	易普力	218,000	2,258,480.00	0.02
979	603530	神马电力	107,400	2,227,476.00	0.02
980	688128	中国电研	107,615	2,208,259.80	0.02
981	688152	麒麟信安	31,438	2,202,860.66	0.02
982	301200	大族数控	55,857	2,109,718.89	0.02
983	002287	奇正藏药	91,714	2,062,647.86	0.02
984	601068	中铝国际	440,700	2,036,034.00	0.02
985	301363	美好医疗	54,000	1,987,200.00	0.02
986	601279	英利汽车	319,100	1,860,353.00	0.02
987	603103	横店影视	101,320	1,801,469.60	0.02
988	001323	慕思股份	58,503	1,784,341.50	0.02
989	301262	海看股份	55,400	1,725,710.00	0.02
990	301177	迪阿股份	58,507	1,725,371.43	0.02
991	301246	宏源药业	63,800	1,657,524.00	0.02
992	301286	侨源股份	53,200	1,545,992.00	0.02
993	001322	箭牌家居	129,047	1,530,497.42	0.02
994	605365	立达信	75,000	1,395,750.00	0.02
995	603162	海通发展	76,300	1,352,036.00	0.01
996	301180	万祥科技	74,500	1,347,705.00	0.01
997	301381	赛维时代	38,900	1,178,281.00	0.01
998	301316	慧博云通	49,600	1,152,704.00	0.01
999	301376	致欧科技	45,020	1,076,878.40	0.01

1,000	001269	欧晶科技	16,720	893,684.00	0.01
-------	--------	------	--------	------------	------

### 8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
2	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
3	301526	国际复材	9,723	43,267.35	0.00
4	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
5	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
6	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
7	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
8	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
9	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
10	301511	德福科技	982	22,261.94	0.00
11	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
12	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
13	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
14	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
15	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
16	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
17	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
18	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
19	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
20	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
21	301362	民爆光电	420	16,178.40	0.00
22	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
23	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
24	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
25	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
26	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
27	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
28	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
29	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
30	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
31	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
32	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
33	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
34	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
35	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
36	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00

37	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
38	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
39	301372	科净源	231	10,069.29	0.00
40	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
41	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
42	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
43	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
44	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
45	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
46	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
47	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
48	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
49	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
50	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
51	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
52	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
53	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
54	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
55	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
56	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
57	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
58	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
59	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
60	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
61	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
62	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
63	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
64	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
65	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
66	603004	鼎龙科技	195	6,082.05	0.00
67	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
68	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
69	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
70	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
71	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
72	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
73	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
74	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
75	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
76	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
77	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
78	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300672	国科微	147,070,162.19	1.39
2	002405	四维图新	144,597,570.59	1.36
3	300502	新易盛	138,868,512.38	1.31
4	301035	润丰股份	133,150,208.69	1.26
5	002865	钧达股份	123,380,184.43	1.16
6	002176	江特电机	122,188,754.69	1.15
7	301050	雷电微力	120,207,230.16	1.13
8	002436	兴森科技	116,393,276.24	1.10
9	300567	精测电子	113,510,134.48	1.07
10	002472	双环传动	105,265,540.46	0.99
11	300068	南都电源	104,471,861.07	0.98
12	300666	江丰电子	101,044,879.79	0.95
13	002517	恺英网络	98,724,100.65	0.93
14	300613	富瀚微	97,501,923.39	0.92
15	002044	美年健康	96,085,248.98	0.91
16	002151	北斗星通	95,118,001.40	0.90
17	002558	巨人网络	93,200,937.22	0.88
18	300725	药石科技	93,126,951.93	0.88
19	300002	神州泰岳	92,388,548.00	0.87
20	000762	西藏矿业	91,658,788.09	0.86

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	194,295,528.90	1.83
2	002405	四维图新	154,717,855.67	1.46
3	300672	国科微	144,535,642.34	1.36
4	002865	钧达股份	136,735,764.41	1.29
5	002472	双环传动	134,857,076.42	1.27
6	301035	润丰股份	132,578,034.17	1.25
7	002517	恺英网络	130,885,145.46	1.23
8	002176	江特电机	128,874,684.05	1.21
9	002044	美年健康	124,381,692.64	1.17
10	002558	巨人网络	124,243,449.25	1.17



11	301050	雷电微力	122,206,722.96	1.15
12	300567	精测电子	116,135,875.55	1.09
13	000933	神火股份	113,880,164.69	1.07
14	002436	兴森科技	113,369,344.07	1.07
15	002240	盛新锂能	110,861,845.51	1.04
16	300394	天孚通信	110,021,257.36	1.04
17	300068	南都电源	109,390,989.14	1.03
18	002262	恩华药业	108,847,354.20	1.03
19	002463	沪电股份	108,598,876.75	1.02
20	300666	江丰电子	103,894,047.57	0.98

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	26,856,005,807.72
卖出股票收入（成交）总额	27,396,266,845.26

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,952,734.49	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,952,734.49	0.02

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113069	博 23 转债	10,250	1,025,067.40	0.01

2	127100	神码转债	9,266	926,667.02	0.01
3	127101	豪鹏转债	10	1,000.07	0.00

### 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

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

### 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

无。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

无。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 声明本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。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

#### 8.12.2 声明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。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

### 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（元）
1	存出保证金	24,529,144.50
2	应收清算款	38,241,915.45
3	应收股利	465.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	377,027.15
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	63,148,552.10

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300339	润和软件	7,677,090.00	0.08	转融通融出
2	002176	江特电机	7,427,700.00	0.08	转融通融出
3	601099	太平洋	6,547,520.00	0.07	转融通融出
4	002436	兴森科技	6,364,833.00	0.07	转融通融出
5	600777	新潮能源	5,698,026.00	0.06	转融通融出
6	002405	四维图新	5,322,200.00	0.06	转融通融出
7	600872	中炬高新	4,920,310.00	0.05	转融通融出
8	300573	兴齐眼药	4,886,176.00	0.05	转融通融出
9	300054	鼎龙股份	4,738,360.00	0.05	转融通融出
10	002456	欧菲光	3,954,340.00	0.04	转融通融出

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688563	航材股份	90,795.49	0.00	新股锁定期
2	688548	广钢气体	51,612.00	0.00	新股锁定期
3	301526	国际复材	43,267.35	0.00	新股锁定期
4	301487	盟固利	35,512.32	0.00	新股锁定期

5	688549	中巨芯	34,738.46	0.00	新股锁定期
---	--------	-----	-----------	------	-------

## § 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		南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
34,779	111,194.04	2,810,985,452.00	72.69%	721,801,258.00	18.66%	334,430,936.00	8.65%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	华泰证券股份有限公司	312,692,949.00	8.09%
2	中信证券股份有限公司	179,033,879.00	4.63%
3	中国银河证券股份有限公司	177,195,290.00	4.58%
4	中国人寿保险股份有限公司	153,706,587.00	3.97%
5	国信证券股份有限公司融券专用证券账户	137,947,922.00	3.57%
6	国泰君安证券股份有限公司	101,692,623.00	2.63%
7	招商证券股份有限公司融券专用证券账户	93,611,966.00	2.42%
8	中国银河证券股份有限公司融券专用证券账户	88,484,664.00	2.29%
9	北京泰铼投资管理有限公司-泰铼信铼 8 号私募证券投资基金	83,000,000.00	2.15%
10	中信证券股份有限公司融券专用证券账户	78,588,785.00	2.03%
11	招商银行股份有限公司-南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	334,430,936.00	8.65%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员 (包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理) 均未持有本基金份额。

#### 9.4 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

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年9月29日)基金份额总额	587,892,000.00
本报告期期初基金份额总额	4,226,217,646.00
本报告期基金总申购份额	12,313,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	12,672,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,867,217,646.00

### § 11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期本基金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

本报告期内，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

#### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金的审计事务所无变化,目前普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为本基金提供审计服务 8 年,本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为人民币 150,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	3	38,471,332,840.10	70.94%	3,849,062.59	70.95%	-
华泰证券	5	14,170,314,243.73	26.13%	1,417,175.07	26.12%	-
万联证券	1	1,082,732,135.42	2.00%	108,296.58	2.00%	-
国信证券	1	502,925,127.69	0.93%	50,292.56	0.93%	-
长江证券	1	1,323,450.00	0.00%	132.62	0.00%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注:交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》(证监基金字[2007]48号)的有关规定,我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序:

#### A: 选择标准

- 1、公司经营行为规范,财务状况和经营状况良好;
- 2、公司具有较强的研究能力,能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告;
- 3、公司内部管理规范,能满足基金操作的保密要求;
- 4、建立了广泛的信息网络,能及时提供准确的信息资讯服务。

B: 选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比, 并根据评比的结果选择席位:

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座;
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实, 投资建议是否准确
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C: 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

新增交易单元:

长江证券

退租交易单元:

无

### 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
招商证券	16,768,110.86	48.51%	-	-	-	-
华泰证券	17,796,790.81	51.49%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于南方基金管理股份有限公司旗下上交所ETF 申购赎回清单版本更新的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
2	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-25
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会	2023-03-01

		基金电子披露网站	
4	南方基金关于旗下部分基金增加东海证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-10
5	南方基金关于旗下部分基金增加国金证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
7	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
8	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-30
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-08
11	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
12	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
14	南方基金关于旗下部分基金增加联储证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
15	关于南方基金管理股份有限公司旗下基金调整股票估值方法的提示性公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-10
16	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
17	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21
18	南方基金关于旗下部分基金增加德邦证券为申	证券日报、基金管理	2023-07-11



	购赎回代理券商的公告	人网站、中国证监会 基金电子披露网站	
19	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-07-21
20	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-07-26
21	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-07-27
22	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-08-03
23	南方基金关于旗下部分基金增加山西证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-08-08
24	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-08-18
25	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下基金的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-08-21
26	南方基金关于旗下部分基金增加东莞证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-08-24
27	南方基金关于旗下部分基金增加西部证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-09-06
28	南方基金管理股份有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-09-07
29	南方基金管理股份有限公司关于终止南京途牛基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-09-07
30	南方基金关于旗下部分基金增加东北证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-10-31
31	南方基金管理股份有限公司关于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-11-03
32	南方基金关于旗下部分基金增加浙商证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理 人网站、中国证监会 基金电子披露网站	2023-11-16

33	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-01
34	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-13
35	南方基金关于电子直销平台相关业务费率优惠的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-15
36	南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-19
37	南方基金管理股份有限公司旗下部分 ETF 增加信达证券为一级交易商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-21
38	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-23
39	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方华泰联合证券承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-23
40	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方兴业证券承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-12-23

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 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、中国证监会批准设立南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

- 3、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告》原文。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

### 13.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>