

国海证券量化优选一年持有期股票型集合
资产管理计划
2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：国海证券股份有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。上会会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	14
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

§8 投资组合报告	68
8.1 期末基金资产组合情况	68
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	68
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.....	69
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	112
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	113
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.....	114
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.....	114
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.....	114
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.....	114
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	114
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	114
8.12 投资组合报告附注	115
§9 基金份额持有人信息	116
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	116
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	116
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	116
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	116
§10 开放式基金份额变动	117
§11 重大事件揭示	117
11.1 基金份额持有人大会决议	117
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.....	117
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	117
11.4 基金投资策略的改变	118
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	118
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.....	118
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	119
11.8 其他重大事件	119
§12 影响投资者决策的其他重要信息	121
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	121
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	121
§13 备查文件目录	122
13.1 备查文件目录	122
13.2 存放地点	122
13.3 查阅方式	122

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划	
基金简称	国海量化优选一年持有股票	
场内简称	-	
基金主代码	970041	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 23 日	
基金管理人	国海证券股份有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	341,967,652.17 份	
基金合同存续期	三年	
下属分级基金的基金简称	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	970041	970042
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	22,681,249.41 份	319,286,402.76 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保障必要流动性的前提下，谋求集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划将利用多因子策略研究框架，找到优质股票的共性（比如低估值、高成长、超预期、盈利稳定等），筛选出能持续稳定跑赢中证 500 指数的股票组合，并利用多种风险控制技术优化投资组合的收益与风险，在可控的风险承受范围内力争获取较高收益。多因子模型因子主要包括价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)等。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%
风险收益特征	本集合计划为股票型集合计划，理论上其风险收益水平高于货币市场基金和货币型集合资产管理计划、债券型基金和债券型集合计划、混合型基金和混合型集合计划。

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		国海证券股份有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈嘉斌	郭明
	联系电话	010-88576333	010-66105799
	电子邮箱	chenjb02@ghzq.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95563	95588
传真		021-60338151	010-66105798
注册地址		广西桂林市辅星路 13 号	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		何春梅	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ghzq.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	上会会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市静安区威海路 755 号 25 层
注册登记机构	国海证券股份有限公司	上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层
-	-	-

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年 8 月 23 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
本期已实现收益	902,639.24	16,309,078.89	-2,225,863.44	-11,836,450.20	-611,153.90	-8,531,118.53
本期利润	1,031,288.25	16,640,666.24	-2,529,138.73	-26,558,357.14	2,548,564.14	-12,143,449.72

加权平均基金份额本期利润	0.0416	0.0468	-0.0608	-0.0627	0.0470	-0.0341
本期加权平均净值利润率	2.36%	2.66%	-3.57%	-3.68%	2.71%	-1.97%
本期基金份额净值增长率	1.36%	1.36%	-3.89%	-3.94%	3.06%	2.98%
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	14,782,350.63	207,356,321.37	18,296,444.25	254,834,681.51	33,434,511.85	256,131,381.05
期末可供分配基金份额利润	0.6517	0.6494	0.6206	0.6184	0.6519	0.6507
期末基金资产净值	38,623,286.64	543,027,896.21	49,530,594.81	691,495,450.37	89,653,803.38	687,620,087.45
期末基金份额净值	1.7029	1.7008	1.6801	1.6779	1.7481	1.7468
3.1.3 累计期末指	2023 年末		2022 年末		2021 年末	

标						
基金份额累计净值增长率	0.40%	0.27%	-0.95%	-1.08%	3.06%	2.98%

注：1、本基金合同于 2021 年 8 月 23 日生效，本基金分设两级基金份额：A 级基金份额和 C 级基金份额。详情请参阅相关公告。

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。所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

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

国海量化优选一年持有股票 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.90%	0.84%	-4.36%	0.82%	2.46%	0.02%
过去六个月	-5.12%	0.81%	-9.01%	0.81%	3.89%	0.00%
过去一年	1.36%	0.79%	-7.01%	0.78%	8.37%	0.01%
自基金合同生效起至今	0.40%	1.09%	-20.42%	1.05%	20.82%	0.04%

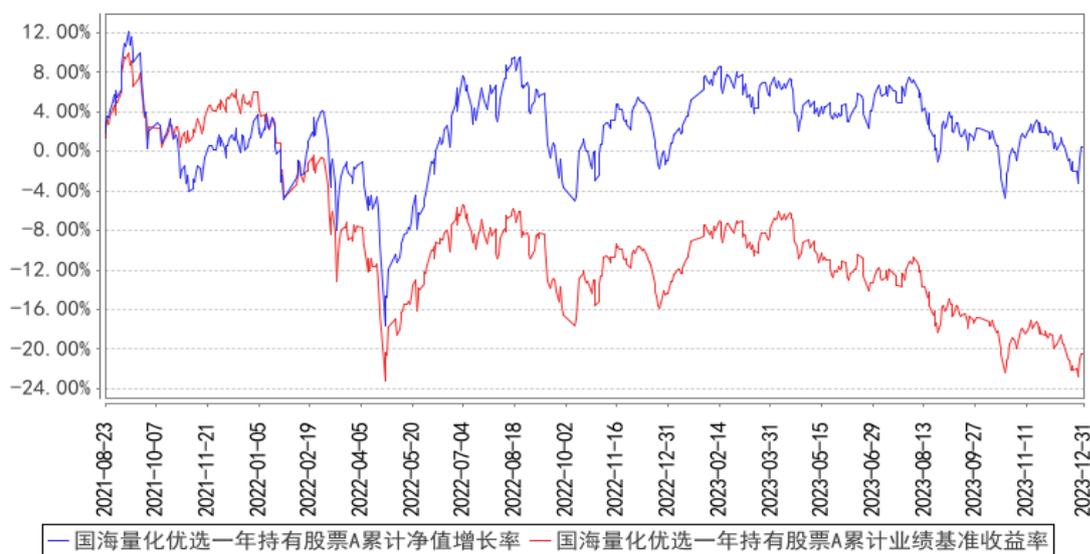
国海量化优选一年持有股票 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.90%	0.84%	-4.36%	0.82%	2.46%	0.02%
过去六个月	-5.12%	0.82%	-9.01%	0.81%	3.89%	0.01%
过去一年	1.36%	0.79%	-7.01%	0.78%	8.37%	0.01%

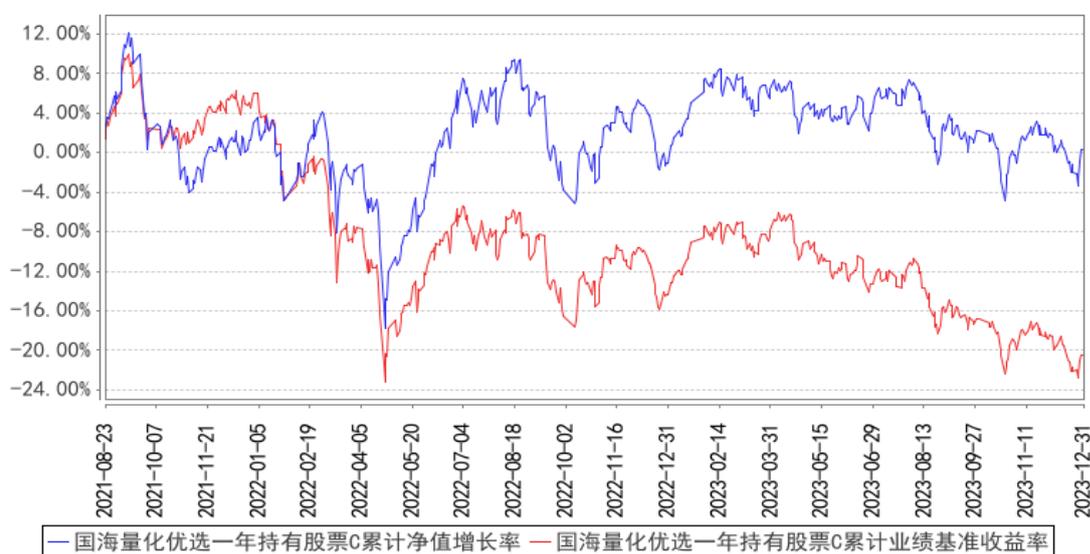
自基金合同生效 起至今	0.27%	1.10%	-20.42%	1.05%	20.69%	0.05%
----------------	-------	-------	---------	-------	--------	-------

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

国海量化优选一年持有股票A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

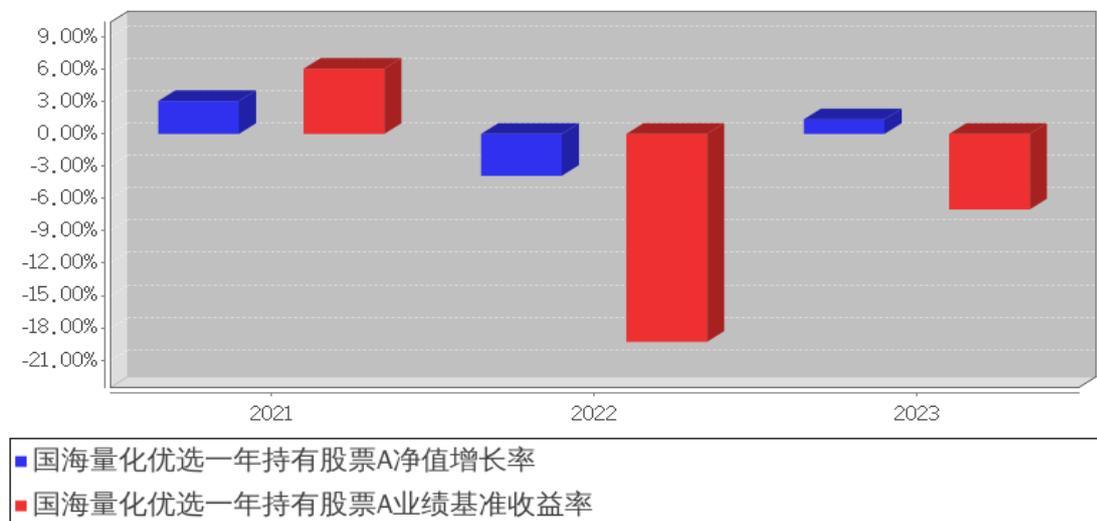


国海量化优选一年持有股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

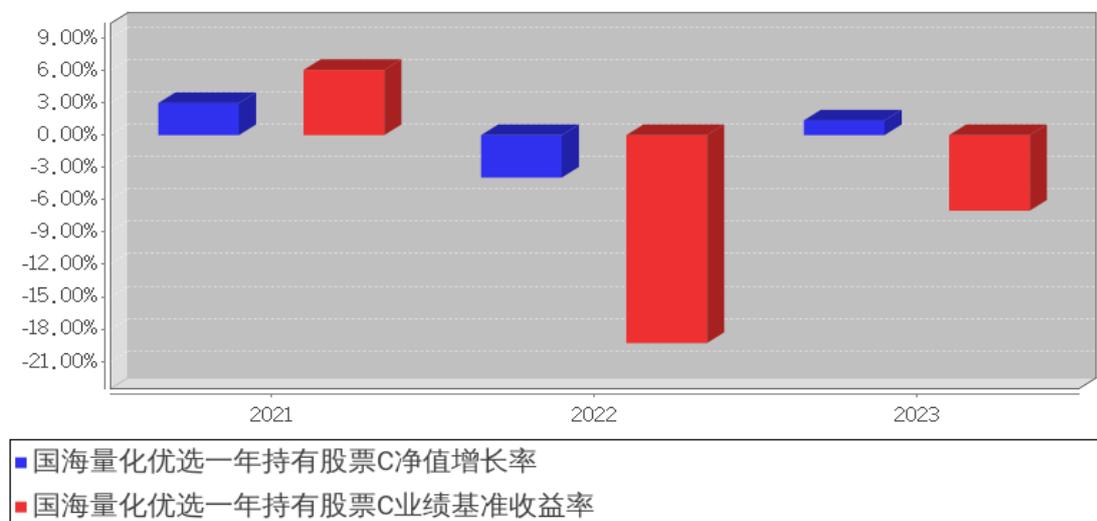


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国海量化优选一年持有股票A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



国海量化优选一年持有股票C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

单位：人民币元

其他指标	报告期（2023年1月1日至2023年12月31日）
-	-
其他指标	报告期末（2023年12月31日）
-	-

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

年度	每 10 份基金	现金形式发放	再投资形式发	年度利润分配	备注

	份额分红数	总额	放总额	合计	
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

国海量化优选一年持有股票 C

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：报告期间无利润分配。

§ 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

国海证券是一家涵盖证券、基金、期货、私募股权投资、另类投资等多元业务体系的全国性上市综合金融服务企业。公司成立于 1988 年，前身为广西证券公司，是国内首批设立也是在广西区内注册的唯一一家证券公司。2011 年 8 月，借壳桂林集琦药业股份有限公司登陆 A 股市场，成为国内第 16 家上市证券公司（股票代码：000750）。截至 2023 年 12 月 31 日止，公司在全国 21 个省级区域设有 30 家分公司、90 家营业部，控股国海富兰克林基金管理有限公司、国海良时期货有限公司，全资设立国海创新资本投资管理有限公司、国海证券投资有限公司，形成了以零售财富、企业金融、机构服务与投资、资产管理、精品研究等为支撑的业务体系，为个人、企业、机构及政府客户提供多元化金融服务。

公司控股股东、实际控制人广西投资集团为广西壮族自治区本级国有资本投资公司，同时位列世界 500 强和中国企业 500 强，公司其他重要股东为实力雄厚的国有企业和上市公司。依托多元化的股权结构，公司建立了完善的法人治理体系和市场化的经营管理机制，将党的领导与公司治理有机融合，打造了市场化的选人用人机制和激励约束机制，使公司经营管理兼具稳健和市场化特点，为公司持续健康发展提供充足动力。近年来，特别是“十三五”以来，公司经营业绩、综合实力快速成长，公司各项指标位居行业前列。

国海证券根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》的要求，截至 2023 年 12 月 31 日，旗下四只大集合产品均已完成公募化改造，为“国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“国海证券量化优选一年持有期股票型集合资

产管理计划”、“国海证券安盈债券型集合资产管理计划”、“国海证券现金宝货币型集合资产管理计划”。

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		
石雨萌	本基金的基金经理	2022年07月21日	-	6	石雨萌先生，墨尔本大学信息技术硕士，6年证券从业经验。2017年加入国海证券资产管理分公司，历任投资助理、投资经理助理。

注：对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
-	公募基金	-	-	-
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	-	-	-

注：本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理，薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或与产品业绩表现挂钩的情况。

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，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《国海证

券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，对公平交易的过程和结果进行监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《国海证券股份有限公司资产管理业务公平交易制度》的规定。

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

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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不存在超过该证券当日成交量 5% 的情况。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年，国内宏观经济整体复苏节奏未及预期。在疫情冲击影响逐渐减弱后，宏观稳增长政策积极落地，地产政策不断优化调整，整体为宏观经济进行托底，但复苏进程仍然低于市场预期。2023 年不变价 GDP 增长 5.2%，略低于年初预期。

海外方面，美国通胀见顶，经济下行风险逐步累积，美联储加息周期进入尾声。但同时，美国经济在高息环境下短期仍然具有韧性，美联储货币政策 2024 年何时转向成为当前市场主要的博弈点之一。

市场方面，A 股整体呈现哑铃型的结构性特征。年初 AI、中特估等热门板块吸引了大量资金，呈现极端分化行情。5 月以来，热点板块冲高回落，极端风格得到调整。三四季度市场未出现持续的主线行情，以板块轮动行情为主。风格层面上，红利、小市值等成为全年表现较强的风格。行业层面，通信、传媒、计算机等科技相关行情表现靠前，而美容护理、商贸零售、房地产等行业表现靠后。

运作方面，产品策略定位为中证 500 指数增强，期内维持高仓位运作。2023 年，中证 500 指数收益率为-7.42%，量化选股策略整体超额收益平稳。量化策略给我们提供了应对复杂市场环境的理论框架，通过高度分散，各行业全面配置，不追求风格极端暴露的股票组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.7029 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为 1.36%；C 类份额基金净值为 1.7008 元，本报告期份额净值增长率为 1.36%，同期业绩比较基准收益率为-7.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预期 2024 年宏观政策将持续发力支持，国内经济有望持续复苏进程。

市场流动性方面，国内货币政策预期维持稳健偏宽松，同时市场预期美联储将在 2024 年开启降息周期，全球权益市场风险偏好趋于稳定，海外资金有望回流。

投资策略方面，当前中证 500 指数在经过较长时间的调整后，估值、股债收益差均处于历史较低分位点。我们将在加强风险控制的前提下，努力创新、迭代量化策略，力争为投资者带来更好的投资回报和更稳健的持有体验。

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，管理人内部监察稽核主要开展了如下措施：

依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章对产品的投资、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时反馈，督促改进并跟踪改进效果，进一步完善公司内部控制管理机制。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本管理人严格遵守《企业会计准则》、中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等法律法规、估值指引的相关规定，以及合同对估值程序的相关约定，对所持有的投资品种进行估值。日常估值的账务处理、份额净值的计算由管理人独立完成，并与托管人进行账务核对，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作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的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人在托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参与与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本托管人依法对国海证券股份有限公司编制和披露的国海量化优选股票一年持有期集合资产管理计划 2023 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	上会师报字(2024)第 1713 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	国海量化优选一年持有股票型集合资产管理计划全体持有人
审计意见	我们审计了国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(以下简称“国海量化优选一年持有期股票型集合计划”)财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附国海量化优选一年持有期股票型集合计划的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券业投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了国海量化优选一年持有期股票型集合计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一

	<p>步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国海量化优选一年持有期股票型集合计划，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注后附财务报表附注中对编制基础的说明。同时该财务报表系国海量化优选一年持有期股票型集合计划管理人（以下简称“管理人”）根据《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》的规定为其集合计划份额持有人编制的，因此财务报表可能不适用于其他用途。本报告仅供管理人提供国海量化优选一年持有期股票型集合计划份额持有人和向中国证券监督管理委员会及其派出机构报送使用，不得用于其他目的。</p>
其他信息	<p>管理人对其他信息负责。其他信息包括国海量化优选一年持有期股票型集合计划 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人负责按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》以及中国证券监督管理委员会和中国证券投资基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人负责评估国海量化优选一年持有期股票型集合计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</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>1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>3、评价管理人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>4、对管理人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，就可能对国海量化优选一年持有期股票型集合计划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国海量化优选一年持有期股票型集合计划不能持续经营。</p> <p>5、评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人就国海量化优选一年持有期股票型集合计划的审计范围、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	上会会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈大愚 江嘉炜
会计师事务所的地址	上海市静安区威海路 755 号 25 层
审计报告日期	2024 年 03 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

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	36,446,807.69	55,699,125.18
结算备付金		4,916,042.33	10,890,187.67
存出保证金		1,642,637.03	2,100,750.78
交易性金融资产	7.4.7.2	539,200,393.92	672,548,444.77
其中：股票投资		539,200,393.92	672,548,444.77

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		14,271,522.19	6,657,888.61
应收股利		-	-
应收申购款		116,092.80	169,497.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		596,593,495.96	748,065,894.51
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,782,569.96	5,297,688.84
应付赎回款		142,747.71	201,987.08
应付管理人报酬		497,037.12	662,481.16
应付托管费		49,703.16	66,248.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	470,255.16	811,444.15
负债合计		14,942,313.11	7,039,849.33
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	341,967,652.17	441,600,125.09
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	239,683,530.68	299,425,920.09
净资产合计		581,651,182.85	741,026,045.18
负债和净资产总计		596,593,495.96	748,065,894.51

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 341,967,652.17 份，资产总净值（暂估业绩报酬前）581,651,182.85 元。其中 A 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7029 元，集合计划份额总额 22,681,249.41 份，资产净值（暂估业绩报酬前）38,623,286.64 元，相关暂估业绩报酬余额 331,084.51 元，资产净值（暂估业绩报酬后）38,292,202.13 元；C 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7008 元，集合计划份额总额 319,286,402.76 份，资产净值（暂估业绩报酬前）543,027,896.21 元，相关暂估业绩报酬 12,266.21 元，资产净值（暂估业绩报酬后）543,015,630.00 元。

暂估业绩报酬为假设本集合计划以本报告期最后一个交易日（同资产管理合同约定）为清算确认日，按照当日本集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据计划份额持有人各自持有的份额（包括未到期份额）于当日按照期末净值（计提业绩报酬前）虚拟计提业绩报酬汇总数。上述暂估金额是各计划持有人的暂估业绩报酬的合计，各计划委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

7.2 利润表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

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		25,812,293.05	-19,414,951.76
1. 利息收入		308,657.74	471,815.33
其中：存款利息收入	7.4.7.13	308,657.74	388,315.11
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		-	83,500.22
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		25,043,398.95	-4,911,127.09
其中：股票投资收益	7.4.7.14	15,602,209.21	-10,350,508.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-544,251.75	-4,241,699.78

股利收益	7.4.7.19	9,985,441.49	9,681,081.17
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	460,236.36	-15,025,182.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	49,542.23
减：二、营业总支出		8,140,338.56	9,672,544.11
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,112,948.64	8,574,825.80
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	670,515.46	790,254.42
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		189,444.65	143,403.13
8. 其他费用	7.4.7.23	167,429.81	164,060.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,671,954.49	-29,087,495.87
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,671,954.49	-29,087,495.87
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		17,671,954.49	-29,087,495.87

7.3 净资产变动表

会计主体：国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划

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	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-99,632,472.92	-	-59,742,389.41	-159,374,862.33
(一)、综合收益总额	-	-	17,671,954.49	17,671,954.49
(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)	-99,632,472.92	-	-77,414,343.90	-177,046,816.82
其中：1. 基金申购款	64,446,266.17	-	50,429,074.84	114,875,341.01
2. 基金赎回款	-164,078,739.09	-	-127,843,418.74	-291,922,157.83
(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	341,967,652.17	-	239,683,530.68	581,651,182.85
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	444,924,658.68	-	332,349,232.15	777,273,890.83
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	444,924,658.68	-	332,349,232.15	777,273,890.83

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,324,533.59	-	-32,923,312.06	-36,247,845.65
(一)、综合收益总额	-	-	-29,087,495.87	-29,087,495.87
(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)	-3,324,533.59	-	-3,835,816.19	-7,160,349.78
其中：1. 基金申购款	111,775,143.79	-	83,367,082.28	195,142,226.07
2. 基金赎回款	-115,099,677.38	-	-87,202,898.47	-202,302,575.85
(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	441,600,125.09	-	299,425,920.09	741,026,045.18

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：

何春梅

谭志华

韦海乐

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

国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)由国海金贝壳 8 号集合资产管理计划变更而来。国海金贝壳 8 号集合资产管理计划为非限定性集合资产管理计划,2012 年 4 月 13 日经中国证券监督管理委员会出具的证监许可[2012]516 号核准设立,自 2012 年 7 月 5 日起开始募集,于 2012 年 8 月 3 日结束募集工作,并于 2012 年 8 月 9 日募集成立。

根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范

金融机构资产管理业务的指导意见》操作指引》的规定，原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。

经中国证监会批准，《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“集合计划合同”）自管理人公告的生效之日起生效，原《国海金贝壳 8 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

本集合计划为契约型开放式，存续期为自集合计划变更合同生效之日起 3 年，本集合计划变更合同生效日起 3 年后，按照中国证监会有关规定执行。本集合计划管理人为国海证券股份有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和集合计划合同的有关规定，本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的 80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币，除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类本集合计划根据所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，将金融资产划分为以下三类：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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类本计划根据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融负债或权益工具。金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债、被指定为有效套期工具的衍生工具。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负债，相关的交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

(1) 金融资产的初始确认与后续计量

① 分类为以摊余成本计量的金融资产金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且管理该金融资产的商业模式是以收取合同现金流量为目标，则本集合计划将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。本集合计划对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入，按摊余成本进行后续计量，其发生减值时或终止确认、修改产生的利得或损失，计入当期损益。除下列情况外，本集合计划根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入：

1) 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，本集合计划自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入。

2) 对于购入或源生的未发生信用减值但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，本集合计划在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，本集合计划转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

② 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金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且管理该金融资产的商业模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标，则本集合计划将该金融资产分类为以公允价值计量其变动计入其他综合收益的金融资产。本集合计划对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入。除利息收入、减值损失及汇兑差额确认为当期损益外，其余公允价值变动计入其他综合收益。当该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。以公允价值计量且变动计入其他综合收益的应收票据及应收账款列报为应收款项融资，其他此类金融资产列报为其他债权投资，其中：自资产负债表日起一年内到期的其他债权投资列报为一年内到期的非流动资产，原到期日在一年以内的其他债权投资列报为其他流动资产。

③ 指定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在初始确认时，本集合计划可以单项金融资产为基础不可撤销地将非交易性权益工具投资指定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。此类金融资产的公允价值变动计入其他综合收益，不需计提减值准备。该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。本集合计划持有该权益工具投资期间，在本集合计划收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很可能流入本集合计划，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。本集合计划对此类金融资产在其他权益工具投资项目下列报。权益工具投资满足下列条件之一的，属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：取得该金融资产的目的主要是为了近期出售；初始确认时属于集中管理的可辨认金融资产工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式；属于衍生工具（符合财务担保合同定义的以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外）。

④ 分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产不符合分类为以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件、亦不指定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均分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本集合计划对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。本集合计划对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产其他非流动金融资产项目列报。

⑤ 指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在初始确认时，本集合计划为了消除或显著减少会计错配，可以单项金融资产为基础不可撤销地将金融资产指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。混合合同包含一项或多项嵌入衍生工具，且其主合同不属于以上金融资产的，本集合计划可以将其整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。但下列情况除外：

1) 嵌入衍生工具不会对混合合同的现金流量产生重大改变。

2) 在初次确定类似的混合合同是否需要分拆时，几乎不需分析就能明确其包含的嵌入衍生工具不应分拆。如嵌入贷款的提前还款权，允许持有人以接近摊余成本的金额提前偿还贷款，该提前还款权不需要分拆。本集合计划对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。本集合计划对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产、其他非流动金融资产项目列报。

(2) 金融负债的初始确认、后续计量和终止确认金融负债的后续计量取决于其分类：

① 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。满足下列条件之一的，属于交易性金融负债：承担相关金融负债的目的主要是为了在近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、符合财务担保合同的衍生工具除外。交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，所有公允价值变动均计入当期损益。在初始确认时，为了提供更相关的会计信息，本集合计划将满足下列条件之一的金融负债不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：

1) 能够消除或显著减少会计错配。

2) 根据正式书面文件载明的企险风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在本集合计划内部以此为基础向关键管理人员报告。本集合计划对此类金融负债采用公允价值进行后续计量除由本集合计划自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益之外，其他公允价值变动计入当期损益。除非由本集合计划自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益会造成或扩大损益中的会计错配，本

集合计划将所有公允价值变动（包括自身信用风险变动的影响金额）计入当期损益。

② 其他金融负债除下列各项外，本集合计划将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，对此类金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益：

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债。

3) 不属于本条前两类情形的财务担保合同，以及不属于本条第 1) 类情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。财务担保合同是指当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求发行方向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。不属于指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，在初始确认后按照损失准备金额以及初始确认金额扣除担保期内的累计摊销额后的余额孰高进行计量。

(3) 金融资产和金融负债的终止确认

① 金融资产满足下列条件之一的，终止确认金融资产，即从其账户和资产负债表内予以转销：

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，且该转移满足金融资产终止确认的规定。

② 金融负债终止确认条件金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，则终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。本计划与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，或对原金融负债（或其一部分）的合同条款做出实质性修改的，则终止确认原金融负债，同时确认一项新金融负债，账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，计入当期损益。本计划回购金融负债一部分的，按照继续确认部分和终止确认部分在回购日各自的公允价值占整体公允价值的比例，对该金融负债整体的账面价值进行分配。分配给终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，应当计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调

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

(2) 对不存在活跃市场的投资品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的，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

本集合计划持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本集合计划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，且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

实收资金为对外发行的集合计划份额总额或对应的金额。每份集合计划份额面值为人民币 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收资金的变动分别于集合计划申购确认日、赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收资金增加和转出集合计划的实收资金减少。

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本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占计划净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回本集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占计划净值比例计算的金额。损益平准金于本集合计划申购确认日或计划赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资

产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

(5) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务中，计划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扣除在适用情况下由计划管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入，将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投资收益；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本计划资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 本集合计划的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按集合计划合同约定的费率和计算方法逐日确认。

(2) 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

(3) 其他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。

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期计划费用。如果影响计划份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；

(2) 集合计划收益分配后各类集合计划份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

(3) 同一类别每一集合计划份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 外币交易

无。

7.4.4.13 分部报告

截至本期末，本集合资产管理计划仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财税[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[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号文《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、

国务院令[2005]第 448 号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、增值税

根据财税[2016]140 号文件的规定，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。

根据财税[2017]56 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日(含)起，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财税[2017]90 号文件的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：(1)提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；(2)转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本集合计划增值税的附加税费，包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等，按照实际缴纳增值税税额的适用比例计算，由管理人申报缴纳。

2、印花税

比照《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收问题的通知》(财税字[1998]55 号)和《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税[2002]128 号)文件的规定，管理人运用资产管理计划买卖股票，卖出股票按 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。

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	36,446,807.69	55,699,125.18
等于：本金	36,442,935.60	55,693,994.55
加：应计利息	3,872.09	5,130.63
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	36,446,807.69	55,699,125.18

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	551,777,783.42	-	539,200,393.92	-12,577,389.50
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	-	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	551,777,783.42	-	539,200,393.92	-12,577,389.50
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	685,674,350.63	-	672,548,444.77	-13,125,905.86
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	-	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	685,674,350.63	-	672,548,444.77	-13,125,905.86
----	----------------	---	----------------	----------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-	-	-	-	-
权益衍生工具	13,607,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	13,607,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,607,960.00	-	-	-
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	14,623,200.00	-	-	-
其中：股指期货投资	14,623,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,623,200.00	-	-	-

注：在股指期货当日无负债结算制度下，本计划所持有的股指期货合约产生的持仓损益每日通过

中国金融期货交易所结算备付金账户转入或转出。因此，衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的股指期货暂收暂付款(结算所得的持仓损益)抵销后无余额。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2403	中证 500 股指期货 2403	12.00	12,995,040.00	-612,920.00
合计				-612,920.00
减：可抵销期货暂收款				-612,920.00
净额				-

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	市值	公允价值变动
-	-	-	-	-
合计				-
减：可抵销期货暂收款				-
净额				-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

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

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日						
	债券代	债券名称	约定	估值单	数量	估值	其中：已出售

	码		返售日	价	(张)	总额	或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日						
	债券代 码	债券名称	约定 返售日	估值单 价	数量 (张)	估值 总额	其中：已出售 或再质押总额
-	-	-	-	-	-	-	-
合计					-	-	-

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

-

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日				
		初始成本	利息调整	应计利息	减：减值准备	账面价值
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-	-
其他		-	-	-	-	-
合计		-	-	-	-	-

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来 12 个月预期信用损失	整个存续期预期信用损失(未发生信用损失)	整个存续期预期信用损失(已发生信用损失)	

		用减值)	用减值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从其他阶段转入	-	-	-	-
本期转出至其他阶段	-	-	-	-
本期新增	-	-	-	-
本期转回	-	-	-	-
其他变动	-	-	-	-
期末余额	-	-	-	-

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日					
	初始成本	利息调整	应计利息	公允价值变动	账面价值	累计减值准备
债券	交易所市场	-	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-
	小计	-	-	-	-	-

资产支持证 券	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

减值准备	第一阶段	第二阶段	第三阶段	合计
	未来12个月预期信用 损失	整个存续期预期信用 损失(未发生信用减 值)	整个存续期预期信用 损失(已发生信用减 值)	
期初余额	-	-	-	-
本期从 其他阶 段转入	-	-	-	-
本期转 出至其 他阶段	-	-	-	-
本期新 增	-	-	-	-
本期转 回	-	-	-	-
其他变 动	-	-	-	-
期末余 额	-	-	-	-

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
-	-	-	-
合计	-	-	-

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日					
	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日					
	指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的原因	本期确认的股利收入	累计利得	累计损失	其他综合收益转入留存收益的金额	其他综合收益转入留存收益的原因
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

7.4.7.8 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	-	-
待摊费用	-	-
-	-	-
合计	-	-

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	310,255.16	651,444.15
其中：交易所市场	310,255.16	651,444.15
银行间市场	-	-
-	-	-

应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	160,000.00
合计	470,255.16	811,444.15

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

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	29,481,316.46	29,481,316.46
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-6,800,067.05	-6,800,067.05
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	22,681,249.41	22,681,249.41

国海量化优选一年持有股票 C

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	412,118,808.63	412,118,808.63
本期申购	64,446,266.17	64,446,266.17
本期赎回（以“-”号填列）	-157,278,672.04	-157,278,672.04
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	319,286,402.76	319,286,402.76

7.4.7.11 其他综合收益

单位：人民币元

项目	期初余额	本期发生金额				期末余额
		本期所得税 前发生额	减：前期计入 其他综合收 益当期转入 损益	减：前期计入 其他综合收 益当期转入 留存收益	减：所得税费 用	
一、不能重分类 进损益的其他 综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他权益 工具投资公允 价值变动	-	-	-	-	-	-
	-	-	-	-	-	-

二、将重分类进损益的其他综合收益	-	-	-	-	-	-
其中：其他债权投资公允价值变动	-	-	-	-	-	-
其他债权投资信用减值准备	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	18,296,444.25	1,752,834.10	20,049,278.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	18,296,444.25	1,752,834.10	20,049,278.35
本期利润	902,639.24	128,649.01	1,031,288.25
本期基金份额交易产生的变动数	-4,416,732.86	-721,796.51	-5,138,529.37
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-4,416,732.86	-721,796.51	-5,138,529.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,782,350.63	1,159,686.60	15,942,037.23

国海量化优选一年持有股票 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	254,834,681.51	24,541,960.23	279,376,641.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	254,834,681.51	24,541,960.23	279,376,641.74
本期利润	16,309,078.89	331,587.35	16,640,666.24
本期基金份额交易产生的变动数	-63,787,439.03	-8,488,375.50	-72,275,814.53
其中：基金申购款	44,861,984.69	5,567,090.15	50,429,074.84
基金赎回款	-108,649,423.72	-14,055,465.65	-122,704,889.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	207,356,321.37	16,385,172.08	223,741,493.45

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	150,597.72	201,414.60
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	155,509.98	183,833.00
其他	2,550.04	3,067.51
合计	308,657.74	388,315.11

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	15,602,209.21	-10,350,508.48
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	15,602,209.21	-10,350,508.48

注：股票投资收益中扣除了增值税的影响

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	9,195,587,923.34	10,071,134,184.04
减：卖出股票成本总额	9,164,293,662.53	10,063,096,878.41
减：交易费用	15,692,051.60	18,387,814.11
买卖股票差价收入	15,602,209.21	-10,350,508.48

注：卖出股票成交总额中扣除了增值税的影响。

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

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
出借证券现金清偿总额	-	-
减：出借证券成本总额	-	-
减：应收证券出借利息	-	-
减：交易费用	-	-
证券出借差价收入	-	-

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

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

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	-
减：应计利息总额	-	-
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-	-

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
赎回基金份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回债券成本总额	-	-
减：赎回债券应计利息总额	-	-
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-	-

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

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
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购债券成本总额	-	-
减：申购债券应计利息总额	-	-
减：交易费用	-	-
-	-	-
申购差价收入	-	-

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

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
资产支持证券投资收益——利息收入	-	-
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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
卖出资产支持证券成交总额	-	-
减：卖出资产支持证券成本总额	-	-
减：应计利息总额	-	-
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——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	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回资产支持证券成本总额	-	-
减：赎回资产支持证券应计利息总额	-	-
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-	-

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

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
申购基金份额对价总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购资产支持证券成本总额	-	-
减：申购资产支持证券应计利息总额	-	-
减：交易费用	-	-
-	-	-
申购差价收入	-	-

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月
----	--------------------------	-------------------------------

	31 日	31 日
贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入	-	-
贵金属投资收益——赎回差价收入	-	-
贵金属投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	-

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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
卖出贵金属成交总额	-	-
减：卖出贵金属成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
减：买卖贵金属差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖贵金属差价收入	-	-

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

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
赎回贵金属份额对价总额	-	-
减：现金支付赎回款总额	-	-
减：赎回贵金属成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-	-

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

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
申购贵金属份额总额	-	-
减：现金支付申购款总额	-	-
减：申购贵金属成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
-	-	-

申购差价收入	-	-
--------	---	---

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出权证成交总额	-	-
减：卖出权证成本总额	-	-
减：交易费用	-	-
减：买卖权证差价收入应缴纳增值税额	-	-
买卖权证差价收入	-	-

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股指期货投资收益	-544,251.75	-4,241,699.78

注：衍生工具投资收益中扣除了增值税的影响

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	9,985,441.49	9,681,081.17
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	9,985,441.49	9,681,081.17

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	548,516.36	-14,191,782.23
股票投资	548,516.36	-14,191,782.23
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-

基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-88,280.00	-833,400.00
权证投资	-	-
期货投资	-88,280.00	-833,400.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	460,236.36	-15,025,182.23

7.4.7.21 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	-	49,542.23
-	-	-
合计	-	49,542.23

7.4.7.22 信用减值损失

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
银行存款	-	-
买入返售金融资产	-	-
债权投资	-	-
其他债权投资	-	-
其他	-	-
-	-	-
合计	-	-

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	7,429.81	4,060.76
合计	167,429.81	164,060.76

7.4.7.24 分部报告

截至本期末，本资产管理计划无需作披露的分部报告。

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，本资产管理计划无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本资产管理计划无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国海证券股份有限公司	基金管理人、基金销售机构
广西投资集团有限公司	基金管理人的股东
广西产投资本运营集团有限公司（原名：广西融桂物流集团有限公司）	基金管理人的股东
广西梧州中恒集团股份有限公司	基金管理人的股东
广西投资集团金融控股有限公司	基金管理人的股东
广西能源股份有限公司（2023年6月1日更名，原名：广西桂东电力股份有限公司）	基金管理人的股东
广西永盛石油化工有限公司	基金管理人的股东
广西金融投资集团有限公司	基金管理人的股东
国海富兰克林基金管理有限公司	基金管理人的子公司
国海富兰克林资产管理（上海）有限公司	基金管理人的子公司
国海良时期货有限公司	基金管理人的子公司
国海良时资本管理有限公司	基金管理人的子公司
国海创新资本投资管理有限公司	基金管理人的子公司
西安国海景恒创业投资有限公司	基金管理人的子公司
深圳市国海贰号投资发展合伙企业（有限合伙）	基金管理人的子公司
深圳市国海叁号投资发展合伙企业（有限合伙）	基金管理人的子公司
国海证券投资有限公司	基金管理人的子公司
中国工商银行股份有限公司	托管人

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（%）

国海证券	18,227,556,144.31	100.00	20,096,701,536.13	100.00
------	-------------------	--------	-------------------	--------

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 (%)
-	-	-	-	-

7.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回购 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 (%)
国海证券	-	-	1,480,000,000.00	100.00

7.4.10.1.4 权证交易

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	占当期权证 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证 成交总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：本基金本报告期未发生权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国海证券	6,095,493.02	100.00	310,255.16	100.00
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 (%)
国海证券	6,665,463.61	100.00	651,444.15	100.00

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	7,112,948.64	8,574,825.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,737,148.94	-
应支付基金管理人的净管理费	4,375,799.70	8,574,825.80

注：

①集合计划管理费计提方法：A类、C类份额的管理费率均为1.0%，本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的1.0%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

②集合计划管理费计算公式为：每日应计提的集合计划管理费=前一日集合计划资产净值×管理费率÷当年天数；

③管理人业绩报酬计提方法：

1)A类份额业绩报酬计提方法：管理人对A类份额持有人每笔认/申购份额年化收益率在5%（不含）至25%（含）的部分提取20%作为业绩报酬；对A类份额持有人每笔认/申购份额年化收益率超过25%（不含）的部分提取30%作为业绩报酬；业绩报酬在集合计划分红日、集合计划份额持有人赎回确认日和集合计划终止日计提；

2)C类份额业绩报酬计提方法：在C类份额持有人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据集合计划份额持有人持有本集合计划的期间年化收益率（R），对本集合计划份额期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。

④此处的管理费包含管理费6,705,155.41元，管理人业绩报酬407,793.23元。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	670,515.46	790,254.42

注：①本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

②集合计划托管费计算公式为：每日应计提的集合计划托管费=前一日集合计划资产净值×年托管费率÷当年天数；

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C	合计
-	-	-	-
合计	-	-	-

注：本基金无销售服务费。

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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

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	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

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
-	-	-	-	-

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 23 日）持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期初持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,000,000.00	1,000,000.00
报告期末持有的基金份额	1,131,926.77	12,425,702.16

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.99%	3.89%
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日（2021年8月23日）持有的基金份额	2,131,926.77	-
报告期初持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,131,926.77	13,425,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.23%	3.26%

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

国海量化优选一年持有股票 A

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 (%)
-	-	-	-	-

份额单位：份

国海量化优选一年持有股票 C

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 (%)
-	-	-	-	-

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	36,446,807.69	150,597.72	55,699,125.18	201,414.60

注：本集合计划的银行存款由集合计划托管人保管，按银行同业利率计息。本集合计划用于证券交易结算的资金通过托管人托管结算资金专用存款账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：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
-	-	-	-	-	-
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
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

国海量化优选一年持有股票 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总 额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-
国海量化优选一年持有股票 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总 额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内无利润分配。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券										
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
7.4.12.1.4 受限证券类别：权证										
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：份）	期末成本总额	期末估值总额	备注
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
300096	易联众	2024 年 1 月 2 日	重大事项停牌	6.82	-	-	26,400	184,954.87	180,048.00	-

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

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
-	-	-	-	-	-

合计					-	-
----	--	--	--	--	---	---

注：本基金本期末未开展银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未开展交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

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
-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-

注：本基金本期末未参与转融通证券出借业务。

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

本集合计划在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立了由公司投资决策与风险控制委员会、资产管理业务发展与风险管理委员会、资管分公司产品评审与投资决策委员会、资管分公司公募产品投资决策与风险管理委员会组成的四级风险管理体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指集合计划在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者集合计划所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。本集合计划均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划投资于一家上市公司发行的证券市值不超过集合计划资产净值的 10%，且本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他公开募集性质的集合计划共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。本集合计划在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；集合计划在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本集合计划本报告期末未持有债券投资、同业存单投资、资产支持证券投资，无重大信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
-	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本基金本期末未持有同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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	合计
资产				
-	-	-	-	-
资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	合计
资产				
-	-	-	-	-

资产总计	-	-	-	-
负债				
-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-
流动性净额	-	-	-	-

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金所持证券主要在证券交易所上市，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12（如有）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金本报告期末无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合中利率敏感性金融工具配置比例等方法对上述利率风险进行管理。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	36,446,807.69	-	-	-	36,446,807.69
结算备付金	4,916,042.33	-	-	-	4,916,042.33
存出保证金	1,642,637.03	-	-	-	1,642,637.03
交易性金融资产	-	-	-	539,200,393.92	539,200,393.92
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	116,092.80	116,092.80
应收清算款	-	-	-	14,271,522.19	14,271,522.19
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	43,005,487.05	-	-	553,588,008.91	596,593,495.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	142,747.71	142,747.71
应付管理人报酬	-	-	-	497,037.12	497,037.12
应付托管费	-	-	-	49,703.16	49,703.16
应付清算款	-	-	-	13,782,569.96	13,782,569.96
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	470,255.16	470,255.16
负债总计	-	-	-	14,942,313.11	14,942,313.11
利率敏感度缺口	43,005,487.05	-	-	538,645,695.80	581,651,182.85
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
货币资金	55,699,125.18	-	-	-	55,699,125.18
结算备付金	10,890,187.67	-	-	-	10,890,187.67
存出保证金	2,100,750.78	-	-	-	2,100,750.78
交易性金融资产	-	-	-	672,548,444.77	672,548,444.77
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	169,497.50	169,497.50
应收清算款	-	-	-	6,657,888.61	6,657,888.61
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	68,690,063.63	-	-679,375,830.88	748,065,894.51
负债				
应付赎回款	-	-	201,987.08	201,987.08
应付管理人报酬	-	-	662,481.16	662,481.16
应付托管费	-	-	66,248.10	66,248.10
应付清算款	-	-	5,297,688.84	5,297,688.84
卖出回购金融资产款	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-
其他负债	-	-	811,444.15	811,444.15
负债总计	-	-	7,039,849.33	7,039,849.33
利率敏感度缺口	68,690,063.63	-	-672,335,981.55	741,026,045.18

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
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）
	-	-	-

注：本集合计划本期末未持有债券资产（不含可转债），因此市场利率的变动对于本集合计划净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			合计
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-

存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	-	-	-
	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
银行存款	-	-	-	-
结算备付金	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-

交易性金融资产	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
应付清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-
应付托管费	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	-		
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）
	-	-	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本

集合计划的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票等资产损失的可能性。

本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	539,200,393.92	92.70	672,548,444.77	90.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	539,200,393.92	92.70	672,548,444.77	90.76

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）
	业绩比较基准上升5%	27,887,896.29	36,672,449.06
	业绩比较基准下降5%	-27,887,896.29	-36,672,449.06

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	-
	-
	-

分析	风险价值 (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)
	-	-	-
	合计	-	-

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	539,020,345.92	672,173,684.77
第二层次	180,048.00	374,760.00
第三层次	-	-
合计	539,200,393.92	672,548,444.77

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位: 人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
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	-	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本集合计划持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，除债权投资外，其余金融工具因其剩余期限较短，因此账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、暂估业绩报酬对集合计划份额净值的影响

报告截止日 2023 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 341,967,652.17 份，资产总净值（暂估业绩报酬前）581,651,182.85 元。其中 A 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7029 元，集合计划份额总额 22,681,249.41 份，资产净值（暂估业绩报酬前）38,623,286.64 元，相关暂估业绩报酬余额 331,084.51 元，资产净值（暂估业绩报酬后）38,292,202.13 元；C 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7008 元，集合计划份额总额 319,286,402.76 份，资产净值（暂估业绩报酬前）543,027,896.21 元，相关暂估业绩报酬 12,266.21 元，资产净值（暂估业绩报酬后）543,015,630.00 元。

暂估业绩报酬为假设本集合计划以本报告期最后一个交易日（同资产管理合同约定）为清算确认日，按照当日本集合计划份额净值（计提业绩报酬前）清算，根据计划份额持有人各自持有的份额（包括未到期份额）于当日按照期末净值（计提业绩报酬前）虚拟计提业绩报酬汇总数。上述暂估金额是各计划持有人的暂估业绩报酬的合计，各计划委托人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

2、除暂估业绩报酬外，截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	539,200,393.92	90.38
	其中：股票	539,200,393.92	90.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	41,362,850.02	6.93
-	-	-	-
8	其他各项资产	16,030,252.02	2.69
9	合计	596,593,495.96	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,086,385.00	0.36
B	采矿业	17,541,506.94	3.02
C	制造业	362,674,289.17	62.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,699,225.34	3.21
E	建筑业	10,690,548.90	1.84
F	批发和零售业	14,125,025.28	2.43
G	交通运输、仓储和邮政业	15,215,175.29	2.62
H	住宿和餐饮业	377,514.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,320,106.75	5.21
J	金融业	18,973,647.27	3.26
K	房地产业	15,412,706.25	2.65
L	租赁和商务服务业	4,632,195.50	0.80
M	科学研究和技术服务业	9,229,313.46	1.59
N	水利、环境和公共设施管理业	9,820,429.25	1.69
O	居民服务、修理和其他服务业	83,005.00	0.01

P	教育	504,526.14	0.09
Q	卫生和社会工作	3,339,116.92	0.57
R	文化、体育和娱乐业	5,138,511.46	0.88
S	综合	337,166.00	0.06
	合计	539,200,393.92	92.70

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
能源	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
可选消费	-	-
主要消费	-	-
医药卫生	-	-
金融	-	-
信息技术	-	-
通信服务	-	-
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	-	-

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300782	卓胜微	15,200	2,143,200.00	0.37
2	300274	阳光电源	23,300	2,040,847.00	0.35
3	300136	信维通信	86,326	2,037,293.60	0.35
4	600188	兖矿能源	101,126	2,003,306.06	0.34
5	300122	智飞生物	31,323	1,914,148.53	0.33
6	300724	捷佳伟创	24,992	1,849,657.92	0.32
7	300033	同花顺	11,709	1,836,790.83	0.32
8	300003	乐普医疗	113,032	1,826,597.12	0.31
9	300115	长盈精密	133,100	1,763,575.00	0.30
10	300316	晶盛机电	39,915	1,759,852.35	0.30
11	300450	先导智能	67,660	1,732,096.00	0.30
12	300207	欣旺达	116,647	1,721,709.72	0.30
13	300496	中科创达	21,500	1,721,290.00	0.30
14	300751	迈为股份	13,040	1,688,810.40	0.29
15	300601	康泰生物	61,339	1,665,353.85	0.29
16	300760	迈瑞医疗	5,700	1,656,420.00	0.28
17	300896	爱美客	5,600	1,648,248.00	0.28
18	300015	爱尔眼科	103,906	1,643,792.92	0.28
19	300433	蓝思科技	122,907	1,622,372.40	0.28
20	300408	三环集团	53,900	1,587,355.00	0.27

21	300413	芒果超媒	62,730	1,580,796.00	0.27
22	000544	中原环保	226,350	1,570,869.00	0.27
23	300750	宁德时代	9,620	1,570,561.20	0.27
24	300124	汇川技术	24,837	1,568,208.18	0.27
25	300037	新宙邦	32,780	1,550,494.00	0.27
26	300088	长信科技	229,500	1,535,355.00	0.26
27	000589	贵州轮胎	246,770	1,510,232.40	0.26
28	300363	博腾股份	58,000	1,458,700.00	0.25
29	600325	华发股份	197,900	1,426,859.00	0.25
30	300253	卫宁健康	197,140	1,417,436.60	0.24
31	300383	光环新网	145,700	1,416,204.00	0.24
32	300058	蓝色光标	196,200	1,408,716.00	0.24
33	600153	建发股份	145,300	1,399,239.00	0.24
34	300677	英科医疗	59,780	1,396,460.80	0.24
35	300661	圣邦股份	15,454	1,375,560.54	0.24
36	000404	长虹华意	229,700	1,352,933.00	0.23
37	600023	浙能电力	292,400	1,347,964.00	0.23
38	002732	燕塘乳业	69,500	1,334,400.00	0.23
39	300568	星源材质	85,589	1,319,782.38	0.23
40	300001	特锐德	65,358	1,313,695.80	0.23
41	300763	锦浪科技	18,700	1,307,130.00	0.22
42	300418	昆仑万维	34,700	1,297,780.00	0.22
43	600348	华阳股份	132,750	1,295,640.00	0.22
44	002452	长高电新	180,900	1,284,390.00	0.22
45	300296	利亚德	213,786	1,282,716.00	0.22
46	600327	大东方	254,723	1,278,709.46	0.22
47	002158	汉钟精机	57,293	1,275,342.18	0.22
48	300014	亿纬锂能	30,100	1,270,220.00	0.22
49	300142	沃森生物	53,653	1,261,382.03	0.22
50	300618	寒锐钴业	44,175	1,249,710.75	0.21
51	000937	冀中能源	174,532	1,246,158.48	0.21
52	300073	当升科技	32,600	1,245,320.00	0.21
53	002334	英威腾	142,100	1,240,533.00	0.21
54	300676	华大基因	25,745	1,235,760.00	0.21
55	300595	欧普康视	54,650	1,233,997.00	0.21
56	300059	东方财富	87,661	1,230,760.44	0.21
57	601088	中国神华	39,240	1,230,174.00	0.21
58	300223	北京君正	19,000	1,228,350.00	0.21
59	300759	康龙化成	42,282	1,225,332.36	0.21
60	300390	天华新能	48,300	1,224,405.00	0.21
61	300373	扬杰科技	33,300	1,222,110.00	0.21
62	300482	万孚生物	40,500	1,221,885.00	0.21
63	300748	金力永磁	59,960	1,212,391.20	0.21

64	300347	泰格医药	22,000	1,209,340.00	0.21
65	600066	宇通客车	91,000	1,205,750.00	0.21
66	000550	江铃汽车	63,003	1,198,947.09	0.21
67	300769	德方纳米	19,552	1,193,258.56	0.21
68	601137	博威合金	76,000	1,180,280.00	0.20
69	000528	柳工	173,100	1,166,694.00	0.20
70	002329	皇氏集团	174,300	1,129,464.00	0.19
71	002303	美盈森	314,900	1,105,299.00	0.19
72	600985	淮北矿业	64,700	1,075,961.00	0.18
73	300308	中际旭创	9,500	1,072,645.00	0.18
74	601666	平煤股份	91,500	1,057,740.00	0.18
75	601126	四方股份	74,463	1,054,396.08	0.18
76	002478	常宝股份	193,100	1,052,395.00	0.18
77	002367	康力电梯	139,700	1,050,544.00	0.18
78	600389	江山股份	60,309	1,049,376.60	0.18
79	002627	三峡旅游	195,800	1,045,572.00	0.18
80	603699	纽威股份	75,300	1,043,658.00	0.18
81	002381	双箭股份	136,900	1,037,702.00	0.18
82	600873	梅花生物	108,322	1,034,475.10	0.18
83	300622	博士眼镜	51,600	1,023,228.00	0.18
84	000090	天健集团	217,199	999,115.40	0.17
85	000338	潍柴动力	70,900	967,785.00	0.17
86	603567	珍宝岛	78,930	959,788.80	0.17
87	600425	青松建化	241,400	953,530.00	0.16
88	002737	葵花药业	36,600	950,868.00	0.16
89	601169	北京银行	209,300	948,129.00	0.16
90	603197	保隆科技	16,800	947,520.00	0.16
91	601000	唐山港	270,200	945,700.00	0.16
92	000034	神州数码	31,600	945,156.00	0.16
93	002296	辉煌科技	114,100	941,325.00	0.16
94	600642	申能股份	146,300	939,246.00	0.16
95	002372	伟星新材	64,900	939,103.00	0.16
96	000888	峨眉山 A	105,100	938,543.00	0.16
97	605377	华旺科技	49,100	937,319.00	0.16
98	000036	华联控股	240,830	936,828.70	0.16
99	600054	黄山旅游	86,025	935,952.00	0.16
100	601225	陕西煤业	44,800	935,872.00	0.16
101	301257	普蕊斯	14,700	933,450.00	0.16
102	601058	赛轮轮胎	78,200	918,850.00	0.16
103	000543	皖能电力	146,600	917,716.00	0.16
104	688556	高测科技股份	23,314	909,012.86	0.16
105	600094	大名城	301,500	904,500.00	0.16
106	300638	广和通	47,140	897,074.20	0.15

107	000623	吉林敖东	59,011	893,426.54	0.15
108	600737	中粮糖业	107,800	888,272.00	0.15
109	300217	东方电热	165,000	887,700.00	0.15
110	300066	三川智慧	174,500	881,225.00	0.15
111	000973	佛塑科技	180,200	881,178.00	0.15
112	600729	重庆百货	31,162	878,768.40	0.15
113	603878	武进不锈	115,898	875,029.90	0.15
114	000521	长虹美菱	154,000	867,020.00	0.15
115	601500	通用股份	207,500	859,050.00	0.15
116	002003	伟星股份	78,430	850,965.50	0.15
117	600502	安徽建工	180,100	837,465.00	0.14
118	002392	北京利尔	221,493	837,243.54	0.14
119	000680	山推股份	163,595	808,159.30	0.14
120	002763	汇洁股份	95,300	801,473.00	0.14
121	600048	保利发展	80,600	797,940.00	0.14
122	601689	拓普集团	10,800	793,800.00	0.14
123	601890	亚星锚链	79,200	784,080.00	0.13
124	603063	禾望电气	31,300	782,500.00	0.13
125	600350	山东高速	112,610	781,513.40	0.13
126	601006	大秦铁路	108,200	780,122.00	0.13
127	600028	中国石化	139,670	779,358.60	0.13
128	002088	鲁阳节能	54,358	774,601.50	0.13
129	000055	方大集团	170,700	771,564.00	0.13
130	600027	华电国际	150,100	771,514.00	0.13
131	600971	恒源煤电	69,080	770,242.00	0.13
132	000869	张裕 A	31,700	765,238.00	0.13
133	000789	万年青	111,273	763,332.78	0.13
134	600395	盘江股份	123,400	761,378.00	0.13
135	600383	金地集团	173,982	758,561.52	0.13
136	600479	千金药业	70,400	758,208.00	0.13
137	002073	软控股份	115,100	756,207.00	0.13
138	603179	新泉股份	14,900	755,579.00	0.13
139	002739	万达电影	57,500	748,650.00	0.13
140	300687	赛意信息	34,200	744,876.00	0.13
141	002891	中宠股份	28,100	740,435.00	0.13
142	002533	金杯电工	91,234	737,170.72	0.13
143	600535	天士力	43,209	735,417.18	0.13
144	600019	宝钢股份	123,900	734,727.00	0.13
145	601328	交通银行	127,900	734,146.00	0.13
146	688036	传音控股	5,252	726,876.80	0.12
147	002238	天威视讯	46,801	726,819.53	0.12
148	603298	杭叉集团	29,160	725,500.80	0.12
149	600282	南钢股份	195,500	723,350.00	0.12

150	002920	德赛西威	5,500	712,305.00	0.12
151	002138	顺络电子	26,290	710,092.90	0.12
152	002223	鱼跃医疗	20,400	705,432.00	0.12
153	600707	彩虹股份	104,500	705,375.00	0.12
154	603886	元祖股份	38,600	703,678.00	0.12
155	603568	伟明环保	43,890	702,240.00	0.12
156	600897	厦门空港	56,120	700,938.80	0.12
157	002743	富煌钢构	116,400	696,072.00	0.12
158	603808	歌力思	75,800	695,086.00	0.12
159	600398	海澜之家	92,900	689,318.00	0.12
160	600845	宝信软件	14,100	688,080.00	0.12
161	603688	石英股份	7,908	687,047.04	0.12
162	000661	长春高新	4,700	685,260.00	0.12
163	603238	诺邦股份	49,800	684,750.00	0.12
164	002565	顺灏股份	201,800	684,102.00	0.12
165	002266	浙富控股	199,700	678,980.00	0.12
166	300625	三雄极光	45,700	677,274.00	0.12
167	002475	立讯精密	19,500	671,775.00	0.12
168	603758	秦安股份	58,700	671,528.00	0.12
169	002662	京威股份	191,300	671,463.00	0.12
170	600760	中航沈飞	15,900	670,662.00	0.12
171	600531	豫光金铅	110,300	667,315.00	0.11
172	601107	四川成渝	151,900	666,841.00	0.11
173	300476	胜宏科技	36,008	664,347.60	0.11
174	002645	华宏科技	58,700	663,310.00	0.11
175	601988	中国银行	166,000	662,340.00	0.11
176	601098	中南传媒	65,001	661,060.17	0.11
177	002753	永东股份	80,000	660,000.00	0.11
178	000597	东北制药	122,800	656,980.00	0.11
179	600376	首开股份	215,900	656,336.00	0.11
180	300251	光线传媒	80,500	656,075.00	0.11
181	002860	星帅尔	50,520	654,234.00	0.11
182	601567	三星医疗	31,800	651,900.00	0.11
183	600480	凌云股份	71,540	651,729.40	0.11
184	601113	华鼎股份	189,400	649,642.00	0.11
185	600163	中闽能源	147,600	645,012.00	0.11
186	000059	华锦股份	117,400	644,526.00	0.11
187	600510	黑牡丹	114,000	644,100.00	0.11
188	300143	盈康生命	60,400	642,052.00	0.11
189	000949	新乡化纤	198,500	641,155.00	0.11
190	002028	思源电气	12,300	640,092.00	0.11
191	000791	甘肃能源	114,700	638,879.00	0.11
192	002062	宏润建设	143,700	636,591.00	0.11

193	301207	华兰疫苗	22,894	636,453.20	0.11
194	600866	星湖科技	136,200	634,692.00	0.11
195	600251	冠农股份	73,000	634,370.00	0.11
196	002714	牧原股份	15,400	634,172.00	0.11
197	601608	中信重工	164,200	633,812.00	0.11
198	300453	三鑫医疗	82,900	632,527.00	0.11
199	002738	中矿资源	16,900	630,539.00	0.11
200	300107	建新股份	118,100	629,473.00	0.11
201	000058	深赛格	87,400	626,658.00	0.11
202	000581	威孚高科	41,466	624,892.62	0.11
203	002833	弘亚数控	35,200	624,448.00	0.11
204	300272	开能健康	100,700	624,340.00	0.11
205	601163	三角轮胎	43,300	623,953.00	0.11
206	002986	宇新股份	39,992	623,875.20	0.11
207	600035	楚天高速	163,176	623,332.32	0.11
208	688132	邦彦技术股份	29,079	623,162.97	0.11
209	300219	鸿利智汇	73,900	622,238.00	0.11
210	002273	水晶光电	45,900	621,486.00	0.11
211	601958	金钼股份	65,700	620,865.00	0.11
212	601216	君正集团	165,600	619,344.00	0.11
213	000988	华工科技	20,800	619,008.00	0.11
214	605300	佳禾食品	39,500	618,570.00	0.11
215	300679	电连技术	14,900	618,350.00	0.11
216	600211	西藏药业	12,664	618,003.20	0.11
217	600129	太极集团	13,300	617,918.00	0.11
218	601009	南京银行	83,700	617,706.00	0.11
219	002097	山河智能	100,700	617,291.00	0.11
220	601633	长城汽车	24,400	615,368.00	0.11
221	002371	北方华创	2,500	614,275.00	0.11
222	002262	恩华药业	22,600	612,912.00	0.11
223	002436	兴森科技	41,600	612,768.00	0.11
224	603611	诺力股份	32,340	612,196.20	0.11
225	300117	嘉寓股份	210,200	609,580.00	0.10
226	002384	东山精密	33,400	607,212.00	0.10
227	002422	科伦药业	20,900	607,145.00	0.10
228	600062	华润双鹤	32,600	606,360.00	0.10
229	300394	天孚通信	6,600	604,032.00	0.10
230	600150	中国船舶	20,500	603,520.00	0.10
231	603596	伯特利	8,700	602,910.00	0.10
232	600458	时代新材	65,300	601,413.00	0.10
233	603160	汇顶科技	8,700	601,170.00	0.10
234	600594	益佰制药	105,502	600,306.38	0.10
235	603303	得邦照明	46,700	600,095.00	0.10

236	000999	华润三九	12,000	596,760.00	0.10
237	002859	洁美科技	23,900	596,305.00	0.10
238	601686	友发集团	96,900	595,935.00	0.10
239	300111	向日葵	195,700	594,928.00	0.10
240	002594	比亚迪	3,000	594,000.00	0.10
241	002563	森马服饰	102,817	593,254.09	0.10
242	300532	今天国际	36,100	592,762.00	0.10
243	000568	泸州老窖	3,300	592,086.00	0.10
244	600867	通化东宝	54,500	590,235.00	0.10
245	600570	恒生电子	20,513	589,953.88	0.10
246	603167	渤海轮渡	66,400	589,632.00	0.10
247	002320	海峡股份	100,800	587,664.00	0.10
248	601688	华泰证券	42,100	587,295.00	0.10
249	002608	江苏国信	89,300	586,701.00	0.10
250	002449	国星光电	61,800	585,246.00	0.10
251	603920	世运电路	31,900	583,132.00	0.10
252	603859	能科科技	15,400	581,042.00	0.10
253	002297	博云新材	72,500	577,825.00	0.10
254	600261	阳光照明	176,425	576,909.75	0.10
255	603093	南华期货	48,000	576,000.00	0.10
256	300501	海顺新材	39,900	575,757.00	0.10
257	600016	民生银行	153,800	575,212.00	0.10
258	603511	爱慕股份	36,800	569,664.00	0.10
259	601619	嘉泽新能	161,000	568,330.00	0.10
260	002236	大华股份	30,700	566,415.00	0.10
261	600217	中再资环	129,000	565,020.00	0.10
262	603345	安井食品	5,400	564,894.00	0.10
263	600623	华谊集团	87,600	564,144.00	0.10
264	601288	农业银行	154,600	562,744.00	0.10
265	600201	生物股份	52,000	560,040.00	0.10
266	301278	快可电子	9,600	559,200.00	0.10
267	601218	吉鑫科技	139,500	558,000.00	0.10
268	600674	川投能源	36,900	557,928.00	0.10
269	603833	欧派家居	8,000	556,880.00	0.10
270	002668	奥马电器	84,200	556,562.00	0.10
271	300145	中金环境	183,800	555,076.00	0.10
272	600675	中华企业	175,800	553,770.00	0.10
273	000921	海信家电	27,100	552,840.00	0.10
274	002674	兴业科技	45,400	552,518.00	0.09
275	300621	维业股份	48,000	551,520.00	0.09
276	600177	雅戈尔	83,852	549,230.60	0.09
277	002884	凌霄泵业	31,368	544,548.48	0.09
278	002126	银轮股份	29,110	543,483.70	0.09

279	600346	恒力石化	41,200	542,604.00	0.09
280	601222	林洋能源	84,300	538,677.00	0.09
281	002803	吉宏股份	26,100	536,616.00	0.09
282	601818	光大银行	184,900	536,210.00	0.09
283	600761	安徽合力	29,400	535,374.00	0.09
284	603858	步长制药	31,461	535,151.61	0.09
285	600377	宁沪高速	51,945	532,436.25	0.09
286	688169	石头科技	1,880	531,946.00	0.09
287	601939	建设银行	81,700	531,867.00	0.09
288	300441	鲍斯股份	77,000	530,530.00	0.09
289	601003	柳钢股份	167,188	529,985.96	0.09
290	300839	博汇股份	51,782	529,729.86	0.09
291	603100	川仪股份	19,100	529,452.00	0.09
292	300535	达威股份	30,200	528,802.00	0.09
293	601668	中国建筑	109,700	527,657.00	0.09
294	601021	春秋航空	10,500	527,100.00	0.09
295	600418	江淮汽车	32,600	526,490.00	0.09
296	002419	天虹股份	95,200	526,456.00	0.09
297	002572	索菲亚	32,600	519,970.00	0.09
298	603355	莱克电气	23,302	519,634.60	0.09
299	002373	千方科技	46,300	519,023.00	0.09
300	601888	中国中免	6,200	518,878.00	0.09
301	688516	奥特维科技	5,686	514,583.00	0.09
302	601827	三峰环境	68,000	510,680.00	0.09
303	000402	金融街	140,669	510,628.47	0.09
304	600548	深高速	56,798	510,614.02	0.09
305	002060	粤水电	103,797	509,643.27	0.09
306	600606	绿地控股	221,500	509,450.00	0.09
307	601998	中信银行	96,200	508,898.00	0.09
308	603111	康尼机电	91,100	507,427.00	0.09
309	600469	风神股份	81,800	504,706.00	0.09
310	600900	长江电力	21,600	504,144.00	0.09
311	605167	利柏特	53,100	503,919.00	0.09
312	000997	新大陆	25,600	502,016.00	0.09
313	002498	汉缆股份	125,500	502,000.00	0.09
314	300389	艾比森	28,900	501,126.00	0.09
315	300566	激智科技	26,700	498,756.00	0.09
316	688398	赛特新材	15,754	497,826.40	0.09
317	000157	中联重科	76,100	496,933.00	0.09
318	000656	金科股份	273,800	495,578.00	0.09
319	601166	兴业银行	30,400	492,784.00	0.08
320	600875	东方电气	33,700	492,694.00	0.08
321	300279	和晶科技	76,100	492,367.00	0.08

322	000533	顺钠股份	104,200	488,698.00	0.08
323	000425	徐工机械	89,200	487,032.00	0.08
324	000862	银星能源	79,900	486,591.00	0.08
325	600909	华安证券	99,700	486,536.00	0.08
326	603816	顾家家居	13,900	486,500.00	0.08
327	002991	甘源食品	6,800	485,928.00	0.08
328	601989	中国重工	117,600	485,688.00	0.08
329	000035	中国天楹	98,300	485,602.00	0.08
330	601677	明泰铝业	42,800	485,352.00	0.08
331	603520	司太立	34,400	484,352.00	0.08
332	600497	驰宏锌锗	95,900	484,295.00	0.08
333	002472	双环传动	18,600	483,972.00	0.08
334	002516	旷达科技	98,100	483,633.00	0.08
335	000777	中核科技	33,200	482,728.00	0.08
336	300572	安车检测	26,700	482,469.00	0.08
337	688626	翔宇医疗	9,025	480,942.25	0.08
338	002065	东华软件	77,800	480,026.00	0.08
339	600115	中国东航	123,600	479,568.00	0.08
340	300451	创业慧康	72,900	477,495.00	0.08
341	300936	中英科技	11,200	477,456.00	0.08
342	601211	国泰君安	32,000	476,160.00	0.08
343	002555	三七互娱	25,300	475,893.00	0.08
344	603871	嘉友国际	29,900	474,214.00	0.08
345	600854	春兰股份	89,800	473,246.00	0.08
346	603156	养元饮品	22,240	472,822.40	0.08
347	600488	津药药业	96,400	472,360.00	0.08
348	002083	孚日股份	93,700	472,248.00	0.08
349	600353	旭光电子	51,580	471,441.20	0.08
350	301227	森鹰窗业	17,300	468,311.00	0.08
351	002469	三维化学	77,100	467,226.00	0.08
352	002233	塔牌集团	65,949	466,918.92	0.08
353	603712	七一二	14,800	466,348.00	0.08
354	300420	五洋停车	153,400	466,336.00	0.08
355	603099	长白山	31,100	465,878.00	0.08
356	600710	苏美达	65,600	465,104.00	0.08
357	002611	东方精工	93,700	464,752.00	0.08
358	002641	公元股份	92,300	464,269.00	0.08
359	000961	中南建设	356,100	462,930.00	0.08
360	000963	华东医药	11,100	460,206.00	0.08
361	601588	北辰实业	242,100	459,990.00	0.08
362	002491	通鼎互联	87,500	458,500.00	0.08
363	605189	富春染织	28,200	456,840.00	0.08
364	605196	华通线缆	59,300	456,610.00	0.08

365	603927	中科软	15,200	455,696.00	0.08
366	300632	光莆股份	36,100	455,582.00	0.08
367	600787	中储股份	89,100	454,410.00	0.08
368	300963	中洲特材	34,500	452,640.00	0.08
369	600886	国投电力	34,200	450,756.00	0.08
370	600558	大西洋	110,500	449,735.00	0.08
371	603165	荣晟环保	37,500	449,250.00	0.08
372	300558	贝达药业	8,700	448,485.00	0.08
373	002165	红宝丽	105,800	447,534.00	0.08
374	002489	浙江永强	146,800	446,272.00	0.08
375	000895	双汇发展	16,700	446,057.00	0.08
376	600894	广日股份	60,658	445,836.30	0.08
377	300067	安诺其	143,200	445,352.00	0.08
378	002601	龙佰集团	25,992	445,242.96	0.08
379	300990	同飞股份	10,000	445,100.00	0.08
380	000751	锌业股份	136,750	444,437.50	0.08
381	002204	大连重工	97,100	443,747.00	0.08
382	688777	中控技术	9,779	443,477.65	0.08
383	603283	赛腾股份	6,100	442,616.00	0.08
384	603333	尚纬股份	76,900	439,099.00	0.08
385	605066	天正电气	47,778	438,602.04	0.08
386	603027	千禾味业	27,100	438,207.00	0.08
387	601609	金田股份	64,700	438,019.00	0.08
388	603515	欧普照明	25,200	437,976.00	0.08
389	600717	天津港	106,500	437,715.00	0.08
390	000733	振华科技	7,400	435,416.00	0.07
391	603319	湘油泵	24,800	434,992.00	0.07
392	601326	秦港股份	152,600	434,910.00	0.07
393	600481	双良节能	51,400	434,844.00	0.07
394	000598	兴蓉环境	76,400	434,716.00	0.07
395	002947	恒铭达	13,500	434,430.00	0.07
396	600749	西藏旅游	36,900	433,944.00	0.07
397	000625	长安汽车	25,700	432,531.00	0.07
398	300898	熊猫乳品	17,900	432,464.00	0.07
399	002913	奥士康	14,100	432,165.00	0.07
400	605116	奥锐特	16,700	431,194.00	0.07
401	688510	航亚科技	24,442	430,668.04	0.07
402	603590	康辰药业	11,300	430,304.00	0.07
403	003012	东鹏控股	52,000	429,000.00	0.07
404	002483	润邦股份	82,100	428,562.00	0.07
405	600887	伊利股份	16,000	428,000.00	0.07
406	301266	宇邦新材	7,700	426,349.00	0.07
407	002393	力生制药	16,300	425,430.00	0.07

408	300866	安克创新	4,800	425,280.00	0.07
409	002146	荣盛发展	248,100	424,251.00	0.07
410	301339	通行宝	21,000	423,780.00	0.07
411	300815	玉禾田	29,004	423,458.40	0.07
412	301004	嘉益股份	9,300	422,685.00	0.07
413	002206	海利得	83,997	421,664.94	0.07
414	300193	佳士科技	53,806	418,072.62	0.07
415	600505	西昌电力	49,100	416,859.00	0.07
416	300319	麦捷科技	43,200	416,448.00	0.07
417	000002	万科 A	39,800	416,308.00	0.07
418	688380	中微半导	17,441	416,142.26	0.07
419	002110	三钢闽光	102,114	413,561.70	0.07
420	002159	三特索道	27,100	413,546.00	0.07
421	603950	长源东谷	26,820	413,028.00	0.07
422	605599	菜百股份	27,700	412,453.00	0.07
423	002960	青鸟消防	29,800	412,432.00	0.07
424	300573	兴齐眼药	2,260	412,043.20	0.07
425	300303	聚飞光电	69,300	410,949.00	0.07
426	600637	东方明珠	54,500	409,840.00	0.07
427	601138	工业富联	27,000	408,240.00	0.07
428	300919	中伟股份	8,300	407,779.00	0.07
429	002439	启明星辰	15,100	407,700.00	0.07
430	301153	中科江南	5,200	407,004.00	0.07
431	002948	青岛银行	133,200	406,260.00	0.07
432	301109	军信股份	25,700	406,060.00	0.07
433	601956	东贝集团	68,000	405,960.00	0.07
434	300468	四方精创	37,400	405,790.00	0.07
435	300872	天阳科技	29,600	404,928.00	0.07
436	688127	蓝特光学	17,284	402,544.36	0.07
437	002899	英派斯	24,300	402,165.00	0.07
438	300194	福安药业	91,800	402,084.00	0.07
439	002228	合兴包装	117,000	401,310.00	0.07
440	300348	长亮科技	38,900	401,059.00	0.07
441	000539	粤电力 A	81,900	400,491.00	0.07
442	300674	宇信科技	24,600	400,488.00	0.07
443	601965	中国汽研	18,100	399,286.00	0.07
444	601128	常熟银行	62,400	398,736.00	0.07
445	600577	精达股份	96,300	398,682.00	0.07
446	300378	鼎捷软件	18,700	398,497.00	0.07
447	002007	华兰生物	18,000	398,340.00	0.07
448	600276	恒瑞医药	8,800	398,024.00	0.07
449	600098	广州发展	74,000	397,380.00	0.07
450	002283	天润工业	67,900	397,215.00	0.07

451	000063	中兴通讯	15,000	397,200.00	0.07
452	600166	福田汽车	145,300	396,669.00	0.07
453	000563	陕国投 A	130,470	396,628.80	0.07
454	300457	赢合科技	21,500	396,460.00	0.07
455	600361	创新新材	79,100	396,291.00	0.07
456	600664	哈药股份	118,100	395,635.00	0.07
457	300589	江龙船艇	28,500	395,580.00	0.07
458	603799	华友钴业	12,000	395,160.00	0.07
459	603456	九洲药业	16,300	394,623.00	0.07
460	300514	友讯达	24,200	394,460.00	0.07
461	603338	浙江鼎力	7,700	394,009.00	0.07
462	600030	中信证券	19,300	393,141.00	0.07
463	000858	五粮液	2,800	392,868.00	0.07
464	002649	博彦科技	32,000	392,640.00	0.07
465	603801	志邦家居	23,400	392,418.00	0.07
466	300602	飞荣达	21,700	392,119.00	0.07
467	600704	物产中大	88,400	391,612.00	0.07
468	600498	烽火通信	23,500	391,040.00	0.07
469	603019	中科曙光	9,900	390,951.00	0.07
470	600300	维维股份	125,500	390,305.00	0.07
471	002226	江南化工	89,080	390,170.40	0.07
472	002222	福晶科技	13,200	389,796.00	0.07
473	300456	赛微电子	16,200	389,448.00	0.07
474	601636	旗滨集团	56,900	389,196.00	0.07
475	300634	彩讯股份	19,000	388,930.00	0.07
476	600933	爱柯迪	17,700	388,338.00	0.07
477	600526	菲达环保	78,600	388,284.00	0.07
478	301186	超达装备	9,800	387,394.00	0.07
479	601568	北元集团	81,500	386,310.00	0.07
480	300715	凯伦股份	33,100	385,946.00	0.07
481	603885	吉祥航空	32,100	385,200.00	0.07
482	600011	华能国际	50,000	385,000.00	0.07
483	603279	景津装备	17,400	384,714.00	0.07
484	603501	韦尔股份	3,600	384,156.00	0.07
485	600628	新世界	54,800	384,148.00	0.07
486	002081	金螳螂	102,100	383,896.00	0.07
487	600939	重庆建工	116,900	383,432.00	0.07
488	600382	广东明珠	84,800	383,296.00	0.07
489	601068	中铝国际	82,954	383,247.48	0.07
490	601018	宁波港	107,100	381,276.00	0.07
491	600585	海螺水泥	16,900	381,264.00	0.07
492	000785	居然之家	115,500	381,150.00	0.07
493	002225	濮耐股份	100,800	381,024.00	0.07

494	601187	厦门银行	75,100	380,757.00	0.07
495	600368	五洲交通	96,310	380,424.50	0.07
496	002870	香山股份	10,600	380,222.00	0.07
497	600033	福建高速	122,500	379,750.00	0.07
498	601908	京运通	82,900	378,853.00	0.07
499	603986	兆易创新	4,100	378,799.00	0.07
500	300230	永利股份	93,960	378,658.80	0.07
501	603259	药明康德	5,200	378,352.00	0.07
502	300017	网宿科技	48,100	377,585.00	0.06
503	688226	威腾电气集团 股份	20,045	376,846.00	0.06
504	600928	西安银行	112,800	375,624.00	0.06
505	002537	海联金汇	56,300	374,958.00	0.06
506	000060	中金岭南	86,700	374,544.00	0.06
507	603680	今创集团	39,620	374,409.00	0.06
508	000928	中钢国际	64,200	374,286.00	0.06
509	600751	海航科技	142,500	373,350.00	0.06
510	603676	卫信康	35,700	372,351.00	0.06
511	002033	丽江股份	46,000	372,140.00	0.06
512	002987	京北方	20,000	371,600.00	0.06
513	603187	海容冷链	24,500	371,420.00	0.06
514	002140	东华科技	43,688	371,348.00	0.06
515	688186	张家港广大特 材	20,528	369,914.56	0.06
516	002628	成都路桥	111,700	368,610.00	0.06
517	603683	晶华新材	32,700	368,202.00	0.06
518	002479	富春环保	76,800	366,336.00	0.06
519	600269	赣粤高速	89,100	366,201.00	0.06
520	000822	山东海化	53,500	365,940.00	0.06
521	688012	中微半导体设 备	2,375	364,800.00	0.06
522	600966	博汇纸业	58,700	364,527.00	0.06
523	000089	深圳机场	56,600	363,938.00	0.06
524	600587	新华医疗	14,100	363,639.00	0.06
525	600320	振华重工	109,500	363,540.00	0.06
526	002823	凯中精密	28,600	363,220.00	0.06
527	301383	C天键	5,575	362,375.00	0.06
528	002163	海南发展	39,900	362,292.00	0.06
529	300376	易事特	56,500	359,905.00	0.06
530	002072	凯瑞德	58,600	359,804.00	0.06
531	603551	奥普家居	33,800	357,942.00	0.06
532	688235	百济神州	2,560	355,942.40	0.06
533	600584	长电科技	11,900	355,334.00	0.06
534	300857	协创数据	6,700	355,033.00	0.06

535	600517	国网英大	74,200	353,934.00	0.06
536	688279	峰岬科技	2,800	353,136.00	0.06
537	688281	华秦科技	2,600	352,716.00	0.06
538	603681	永冠新材	23,256	351,165.60	0.06
539	300036	超图软件	16,800	351,120.00	0.06
540	301330	熵基科技	10,600	350,860.00	0.06
541	688581	安杰思医学	2,800	349,468.00	0.06
542	301283	聚胶股份	10,600	348,528.00	0.06
543	601702	华峰铝业	19,400	348,230.00	0.06
544	603658	安图生物	6,100	347,761.00	0.06
545	688580	伟思医疗	5,437	347,587.41	0.06
546	300396	迪瑞医疗	11,800	347,510.00	0.06
547	300265	通光线缆	37,500	347,250.00	0.06
548	002254	泰和新材	23,200	347,072.00	0.06
549	601966	玲珑轮胎	18,000	346,140.00	0.06
550	300735	光弘科技	14,700	346,038.00	0.06
551	603899	晨光股份	9,200	345,460.00	0.06
552	002212	天融信	35,300	345,234.00	0.06
553	002653	海思科	14,900	344,935.00	0.06
554	002773	康弘药业	18,700	344,828.00	0.06
555	300350	华鹏飞	67,200	344,736.00	0.06
556	300771	智莱科技	31,700	344,579.00	0.06
557	600536	中国软件	9,500	344,470.00	0.06
558	688391	钜泉科技	6,940	344,224.00	0.06
559	002730	电光科技	36,300	344,124.00	0.06
560	600285	羚锐制药	20,100	343,911.00	0.06
561	688433	华曙高科	10,999	343,718.75	0.06
562	300817	双飞股份	20,300	343,679.00	0.06
563	603337	杰克股份	15,900	343,440.00	0.06
564	002394	联发股份	41,300	343,203.00	0.06
565	002437	誉衡药业	136,700	343,117.00	0.06
566	300409	道氏技术	30,800	343,112.00	0.06
567	600183	生益科技	18,700	342,397.00	0.06
568	002534	西子洁能	27,400	342,226.00	0.06
569	000530	冰山冷热	64,000	341,760.00	0.06
570	002019	亿帆医药	23,100	341,418.00	0.06
571	603369	今世缘	7,000	341,250.00	0.06
572	300562	乐心医疗	29,900	341,159.00	0.06
573	002249	大洋电机	68,600	340,942.00	0.06
574	600876	凯盛新能	24,300	340,929.00	0.06
575	300421	力星股份	26,400	340,824.00	0.06
576	300624	万兴科技	3,600	340,560.00	0.06
577	003816	中国广核	109,400	340,234.00	0.06

578	600388	龙净环保	26,600	340,214.00	0.06
579	600580	卧龙电驱	29,000	340,170.00	0.06
580	600893	航发动力	9,100	340,158.00	0.06
581	300628	亿联网络	11,500	339,825.00	0.06
582	600644	乐山电力	48,800	339,648.00	0.06
583	603638	艾迪精密	20,900	339,625.00	0.06
584	603229	奥翔药业	25,700	339,497.00	0.06
585	600230	沧州大化	25,200	339,444.00	0.06
586	600426	华鲁恒升	12,300	339,357.00	0.06
587	603305	旭升集团	17,200	339,356.00	0.06
588	603601	再升科技	78,900	339,270.00	0.06
589	600223	福瑞达	35,200	338,976.00	0.06
590	601899	紫金矿业	27,200	338,912.00	0.06
591	600169	太原重工	143,600	338,896.00	0.06
592	601969	海南矿业	51,400	338,726.00	0.06
593	301269	华大九天	3,200	338,720.00	0.06
594	000938	紫光股份	17,500	338,625.00	0.06
595	601665	齐鲁银行	86,600	338,606.00	0.06
596	600745	闻泰科技	8,000	338,480.00	0.06
597	603367	辰欣药业	23,113	338,374.32	0.06
598	601369	陕鼓动力	42,400	338,352.00	0.06
599	000828	东莞控股	31,500	338,310.00	0.06
600	301201	诚达药业	13,300	338,219.00	0.06
601	300259	新天科技	93,100	337,953.00	0.06
602	600754	锦江酒店	11,300	337,870.00	0.06
603	002459	晶澳科技	16,300	337,736.00	0.06
604	001203	大中矿业	33,200	337,644.00	0.06
605	001979	招商蛇口	35,400	337,362.00	0.06
606	601991	大唐发电	139,400	337,348.00	0.06
607	002353	杰瑞股份	12,000	337,320.00	0.06
608	300146	汤臣倍健	19,800	337,194.00	0.06
609	300891	惠云钛业	34,700	336,590.00	0.06
610	600835	上海机电	28,300	335,921.00	0.06
611	603043	广州酒家	17,200	335,916.00	0.06
612	002061	浙江交科	92,015	335,854.75	0.06
613	688120	华海清科	1,789	335,795.30	0.06
614	002458	益生股份	31,200	335,712.00	0.06
615	300529	健帆生物	15,100	335,673.00	0.06
616	600195	中牧股份	28,300	335,638.00	0.06
617	688072	拓荆科技	1,450	335,385.00	0.06
618	600061	国投资本	49,700	334,978.00	0.06
619	000627	天茂集团	117,900	334,836.00	0.06
620	688570	天玛智控	12,300	334,683.00	0.06

621	601318	中国平安	8,300	334,490.00	0.06
622	688223	晶科能源	37,730	334,287.80	0.06
623	301268	铭利达	11,200	334,096.00	0.06
624	002271	东方雨虹	17,400	334,080.00	0.06
625	688231	隆达超合金股份	15,178	334,067.78	0.06
626	300957	贝泰妮	4,900	334,033.00	0.06
627	688375	国博电子	4,200	334,026.00	0.06
628	002142	宁波银行	16,600	333,826.00	0.06
629	300695	兆丰股份	6,300	333,648.00	0.06
630	600489	中金黄金	33,480	333,460.80	0.06
631	601077	渝农商行	81,700	333,336.00	0.06
632	000883	湖北能源	78,800	333,324.00	0.06
633	603806	福斯特	13,700	332,499.00	0.06
634	688409	富创精密	4,240	332,034.40	0.06
635	001872	招商港口	20,800	331,968.00	0.06
636	300776	帝尔激光	5,500	331,430.00	0.06
637	600309	万华化学	4,300	330,326.00	0.06
638	603929	亚翔集成	13,800	330,096.00	0.06
639	000519	中兵红箭	23,500	329,940.00	0.06
640	002850	科达利	3,900	329,394.00	0.06
641	002027	分众传媒	52,100	329,272.00	0.06
642	300787	海能实业	19,500	327,990.00	0.06
643	300773	拉卡拉	20,400	327,216.00	0.06
644	002016	世荣兆业	51,900	326,451.00	0.06
645	300697	电工合金	25,200	325,584.00	0.06
646	688147	微导纳米科技	8,349	325,527.51	0.06
647	600312	平高电气	25,600	324,864.00	0.06
648	000016	深康佳 A	77,700	324,009.00	0.06
649	600161	天坛生物	10,400	321,776.00	0.06
650	300729	乐歌股份	17,962	321,699.42	0.06
651	600104	上汽集团	23,754	321,391.62	0.06
652	000910	大亚圣象	39,900	319,200.00	0.05
653	002558	巨人网络	28,600	318,604.00	0.05
654	300719	安达维尔	23,900	318,587.00	0.05
655	002970	锐明技术	10,400	318,344.00	0.05
656	002434	万里扬	42,700	318,115.00	0.05
657	600429	三元股份	71,100	317,106.00	0.05
658	002648	卫星化学	21,460	316,535.00	0.05
659	300550	和仁科技	21,100	316,289.00	0.05
660	688252	天德钰科技	15,828	315,926.88	0.05
661	603067	振华股份	31,000	315,890.00	0.05
662	002160	常铝股份	75,101	314,673.19	0.05
663	002554	惠博普	100,400	314,252.00	0.05

664	603989	艾华集团	14,600	314,192.00	0.05
665	601601	中国太保	13,200	313,896.00	0.05
666	601528	瑞丰银行	63,100	312,345.00	0.05
667	300130	新国都	12,900	312,180.00	0.05
668	688271	联影医疗	2,274	311,560.74	0.05
669	300498	温氏股份	15,500	310,930.00	0.05
670	002622	皓宸医疗	94,800	309,996.00	0.05
671	600529	山东药玻	12,100	309,760.00	0.05
672	600323	瀚蓝环境	17,800	308,474.00	0.05
673	603086	先达股份	52,441	308,353.08	0.05
674	600808	马钢股份	113,240	308,012.80	0.05
675	002314	南山控股	106,200	307,980.00	0.05
676	002688	金河生物	64,000	307,840.00	0.05
677	000698	沈阳化工	72,700	306,794.00	0.05
678	300040	九洲集团	54,600	305,760.00	0.05
679	002053	云南能投	31,700	304,954.00	0.05
680	300575	中旗股份	39,900	304,836.00	0.05
681	605090	九丰能源	10,900	304,437.00	0.05
682	688578	艾力斯医药科技	7,307	304,409.62	0.05
683	600649	城投控股	82,200	304,140.00	0.05
684	600795	国电电力	73,100	304,096.00	0.05
685	688067	爱威科技	12,689	302,125.09	0.05
686	600686	金龙汽车	39,900	302,043.00	0.05
687	000573	粤宏远 A	89,300	301,834.00	0.05
688	000886	海南高速	73,600	301,760.00	0.05
689	300110	华仁药业	71,400	301,308.00	0.05
690	300080	易成新能	62,200	301,048.00	0.05
691	301160	翔楼新材	7,116	300,508.68	0.05
692	300021	大禹节水	63,100	300,356.00	0.05
693	300018	中元股份	49,034	299,597.74	0.05
694	000561	烽火电子	35,600	299,040.00	0.05
695	601330	绿色动力	45,000	298,800.00	0.05
696	688276	长春百克生物科技	5,442	298,276.02	0.05
697	002132	恒星科技	95,200	297,976.00	0.05
698	002595	豪迈科技	10,000	297,700.00	0.05
699	002057	中钢天源	36,900	296,676.00	0.05
700	002219	新里程	97,400	295,122.00	0.05
701	001207	联科科技	17,300	294,965.00	0.05
702	600210	紫江企业	62,600	294,220.00	0.05
703	600339	中油工程	97,100	294,213.00	0.05
704	600493	凤竹纺织	43,700	293,664.00	0.05
705	600990	四创电子	14,700	293,559.00	0.05

706	000612	焦作万方	51,020	293,365.00	0.05
707	301239	普瑞眼科	3,400	292,400.00	0.05
708	600490	鹏欣资源	97,600	291,824.00	0.05
709	688663	新风光科技	10,394	291,447.76	0.05
710	003038	鑫铂股份	8,400	288,540.00	0.05
711	000100	TCL 科技	67,100	288,530.00	0.05
712	600984	建设机械	76,900	288,375.00	0.05
713	600741	华域汽车	17,700	288,156.00	0.05
714	300323	华灿光电	39,300	287,676.00	0.05
715	603619	中曼石油	15,500	287,060.00	0.05
716	002486	嘉麟杰	98,300	287,036.00	0.05
717	000426	兴业矿业	31,500	286,020.00	0.05
718	601857	中国石油	40,300	284,518.00	0.05
719	300855	图南股份	9,380	283,276.00	0.05
720	002687	乔治白	52,992	282,447.36	0.05
721	600212	绿能慧充	39,300	282,174.00	0.05
722	300185	通裕重工	117,400	281,760.00	0.05
723	300973	立高食品	5,800	281,590.00	0.05
724	688336	三生国健	12,506	281,510.06	0.05
725	002865	钧达股份	3,629	281,174.92	0.05
726	002015	协鑫能科	22,700	281,026.00	0.05
727	600297	广汇汽车	163,200	280,704.00	0.05
728	300850	新强联	8,700	276,921.00	0.05
729	600977	中国电影	22,600	276,624.00	0.05
730	688129	东来涂料技术 股份	16,505	273,157.75	0.05
731	002045	国光电器	16,400	273,060.00	0.05
732	300567	精测电子	3,100	271,622.00	0.05
733	002600	领益智造	40,100	271,076.00	0.05
734	603208	江山欧派	9,100	270,179.00	0.05
735	002332	仙琚制药	21,100	269,447.00	0.05
736	002958	青农商行	102,700	269,074.00	0.05
737	601996	丰林集团	94,400	269,040.00	0.05
738	002465	海格通信	20,900	268,565.00	0.05
739	002335	科华数据	9,700	268,496.00	0.05
740	688660	电气风电	51,921	266,873.94	0.05
741	002130	沃尔核材	35,330	266,741.50	0.05
742	601199	江南水务	53,600	265,856.00	0.05
743	603050	科林电气	14,800	265,660.00	0.05
744	002446	盛路通信	32,000	265,600.00	0.05
745	688772	珠海冠宇电池	12,039	264,978.39	0.05
746	000682	东方电子	32,900	264,845.00	0.05
747	002037	保利联合	30,700	264,327.00	0.05
748	001215	千味央厨	5,000	264,050.00	0.05

749	002675	东诚药业	14,400	263,952.00	0.05
750	000983	山西焦煤	26,700	263,796.00	0.05
751	688148	芳源股份	34,376	263,663.92	0.05
752	000531	穗恒运 A	39,300	262,917.00	0.05
753	002051	中工国际	32,300	262,276.00	0.05
754	600935	华塑股份	77,800	262,186.00	0.05
755	300604	长川科技	6,900	262,131.00	0.05
756	600248	陕建股份	65,100	261,702.00	0.04
757	603588	高能环境	40,000	261,600.00	0.04
758	300382	斯莱克	26,300	261,159.00	0.04
759	688017	绿的谐波	1,697	260,489.50	0.04
760	002398	垒知集团	54,600	260,442.00	0.04
761	000933	神火股份	15,500	260,400.00	0.04
762	603708	家家悦	19,900	260,093.00	0.04
763	688133	泰坦股份	5,588	259,003.80	0.04
764	688007	光峰科技	10,000	258,800.00	0.04
765	002302	西部建设	39,900	258,552.00	0.04
766	688116	天奈科技	8,879	257,846.16	0.04
767	600400	红豆股份	92,400	257,796.00	0.04
768	600746	江苏索普	35,200	257,664.00	0.04
769	300497	富祥药业	27,500	257,400.00	0.04
770	600617	国新能源	66,600	257,076.00	0.04
771	603979	金诚信	6,800	256,768.00	0.04
772	000965	天保基建	82,000	256,660.00	0.04
773	002409	雅克科技	4,600	256,358.00	0.04
774	300511	雪榕生物	47,900	256,265.00	0.04
775	688277	天智航医疗	19,422	255,981.96	0.04
776	600284	浦东建设	40,600	255,780.00	0.04
777	300856	科思股份	4,110	255,765.30	0.04
778	002344	海宁皮城	62,365	255,696.50	0.04
779	300101	振芯科技	11,200	255,696.00	0.04
780	600399	抚顺特钢	26,300	255,636.00	0.04
781	688041	海光信息	3,600	255,528.00	0.04
782	300298	三诺生物	8,400	255,360.00	0.04
783	601139	深圳燃气	37,000	254,930.00	0.04
784	000906	浙商中拓	34,800	254,388.00	0.04
785	300132	青松股份	48,700	254,214.00	0.04
786	688221	前沿生物	25,622	254,170.24	0.04
787	601699	潞安环能	11,600	254,156.00	0.04
788	600815	厦工股份	94,400	253,936.00	0.04
789	002984	森麒麟	8,800	253,880.00	0.04
790	300082	奥克股份	36,400	253,708.00	0.04
791	600744	华银电力	78,300	253,692.00	0.04

792	002967	广电计量	16,900	253,669.00	0.04
793	000031	大悦城	85,400	253,638.00	0.04
794	688066	北京航天宏图	6,000	253,440.00	0.04
795	301156	美农生物	13,400	252,724.00	0.04
796	300358	楚天科技	23,600	252,520.00	0.04
797	301175	中科环保	50,600	252,494.00	0.04
798	600965	福成股份	40,000	252,400.00	0.04
799	603606	东方电缆	5,900	252,225.00	0.04
800	002463	沪电股份	11,400	252,168.00	0.04
801	000852	石化机械	41,000	252,150.00	0.04
802	601127	赛力斯	3,300	251,460.00	0.04
803	002152	广电运通	20,500	251,330.00	0.04
804	600756	浪潮软件	18,100	251,047.00	0.04
805	605589	圣泉集团	11,200	250,656.00	0.04
806	300203	聚光科技	15,800	250,430.00	0.04
807	600495	晋西车轴	58,500	250,380.00	0.04
808	300832	新产业	3,200	250,240.00	0.04
809	002050	三花智控	8,500	249,900.00	0.04
810	002091	江苏国泰	31,900	249,777.00	0.04
811	300294	博雅生物	7,400	249,232.00	0.04
812	003002	壶化股份	16,400	249,116.00	0.04
813	600639	浦东金桥	24,600	248,706.00	0.04
814	300586	美联新材	30,700	248,363.00	0.04
815	002125	湘潭电化	23,200	248,008.00	0.04
816	300415	伊之密	14,054	247,772.02	0.04
817	002444	巨星科技	11,000	247,720.00	0.04
818	300119	瑞普生物	15,100	247,489.00	0.04
819	002100	天康生物	28,200	247,314.00	0.04
820	300803	指南针	4,100	247,066.00	0.04
821	002448	中原内配	37,200	247,008.00	0.04
822	688387	中信科移动	34,200	246,582.00	0.04
823	600888	新疆众和	34,000	246,160.00	0.04
824	002949	华阳国际	17,600	245,872.00	0.04
825	603330	天洋新材	32,393	245,538.94	0.04
826	600874	创业环保	44,200	245,310.00	0.04
827	600758	辽宁能源	67,700	245,074.00	0.04
828	600533	栖霞建设	83,500	244,655.00	0.04
829	300726	宏达电子	8,100	244,539.00	0.04
830	000758	中色股份	54,312	244,404.00	0.04
831	603222	济民医疗	30,500	244,305.00	0.04
832	000601	韶能股份	57,000	243,960.00	0.04
833	000720	新能泰山	58,900	243,846.00	0.04
834	603916	苏博特	23,900	243,541.00	0.04

835	300725	药石科技	6,200	243,474.00	0.04
836	002481	双塔食品	55,200	243,432.00	0.04
837	605366	宏柏新材	29,400	243,138.00	0.04
838	000672	上峰水泥	30,100	242,606.00	0.04
839	000959	首钢股份	69,800	241,508.00	0.04
840	600507	方大特钢	52,349	241,328.89	0.04
841	603992	松霖科技	13,300	241,262.00	0.04
842	000952	广济药业	30,100	240,499.00	0.04
843	603609	禾丰股份	28,000	239,680.00	0.04
844	603227	雪峰科技	34,700	239,430.00	0.04
845	600215	派斯林	28,000	239,120.00	0.04
846	300055	万邦达	38,700	238,779.00	0.04
847	300349	金卡智能	19,000	235,980.00	0.04
848	300246	宝莱特	22,850	235,355.00	0.04
849	688052	纳芯微电子	1,409	235,091.65	0.04
850	300900	广联航空	9,500	234,460.00	0.04
851	002752	昇兴股份	45,250	234,395.00	0.04
852	002044	美年健康	38,800	233,188.00	0.04
853	600688	上海石化	81,400	232,804.00	0.04
854	601595	上海电影	9,000	232,470.00	0.04
855	002615	哈尔斯	31,400	230,162.00	0.04
856	300284	苏交科	42,200	229,990.00	0.04
857	600727	鲁北化工	34,900	229,642.00	0.04
858	300369	绿盟科技	24,325	229,384.75	0.04
859	002276	万马股份	22,400	228,928.00	0.04
860	688188	上海柏楚电子科技	904	228,811.44	0.04
861	688002	睿创微纳	5,173	228,750.06	0.04
862	600372	中航机载	17,287	227,842.66	0.04
863	688499	广东利元亨	5,933	225,928.64	0.04
864	688589	力合微电子	5,653	225,611.23	0.04
865	000651	格力电器	7,000	225,190.00	0.04
866	002749	国光股份	18,704	224,073.92	0.04
867	301149	隆华新材	18,100	223,897.00	0.04
868	002441	众业达	23,531	222,838.57	0.04
869	301373	凌玮科技	7,500	222,375.00	0.04
870	300808	久量股份	14,200	221,236.00	0.04
871	688518	联赢激光股份	10,600	217,088.00	0.04
872	300099	精准信息	35,000	216,650.00	0.04
873	002922	伊戈尔	14,500	215,325.00	0.04
874	000788	北大医药	32,000	214,720.00	0.04
875	688439	振华风光	2,400	213,864.00	0.04
876	002215	诺普信	25,800	213,108.00	0.04
877	000631	顺发恒业	64,000	212,480.00	0.04

878	600694	大商股份	12,557	212,087.73	0.04
879	300842	帝科股份	3,000	211,650.00	0.04
880	003041	真爱美家	12,700	211,455.00	0.04
881	688006	浙江杭可科技	8,960	210,380.80	0.04
882	300292	吴通控股	55,700	207,204.00	0.04
883	688173	希荻微电子	11,720	206,154.80	0.04
884	002467	二六三	44,300	205,552.00	0.04
885	300201	*ST 海伦	40,500	204,120.00	0.04
886	600085	同仁堂	3,800	204,060.00	0.04
887	001323	慕思股份	6,686	203,923.00	0.04
888	301043	绿岛风	6,200	202,926.00	0.03
889	603848	好太太	13,100	202,788.00	0.03
890	000811	冰轮环境	14,936	202,681.52	0.03
891	603060	国检集团	24,060	202,104.00	0.03
892	601788	光大证券	13,100	202,002.00	0.03
893	600052	东望时代	40,171	200,453.29	0.03
894	601028	玉龙股份	18,600	199,206.00	0.03
895	301301	川宁生物	23,600	198,240.00	0.03
896	300818	耐普矿机	6,000	198,060.00	0.03
897	603028	赛福天	17,700	197,355.00	0.03
898	300053	欧比特	16,100	196,903.00	0.03
899	688505	复旦张江股份	21,274	196,359.02	0.03
900	300355	蒙草生态	52,200	195,750.00	0.03
901	688181	八亿时空液晶 股份	7,200	194,400.00	0.03
902	603112	华翔股份	15,800	191,970.00	0.03
903	300043	星辉娱乐	51,600	191,436.00	0.03
904	002689	远大智能	43,000	191,350.00	0.03
905	002378	章源钨业	33,690	190,685.40	0.03
906	002402	和而泰	13,300	190,057.00	0.03
907	002715	登云股份	11,700	189,891.00	0.03
908	603173	福斯达深冷	8,400	189,168.00	0.03
909	603225	新凤鸣	13,292	188,746.40	0.03
910	605286	同力日升	6,300	188,118.00	0.03
911	002358	森源电气	43,200	187,920.00	0.03
912	000538	云南白药	3,800	186,770.00	0.03
913	600691	阳煤化工	58,000	186,180.00	0.03
914	301267	华夏眼科	5,800	186,122.00	0.03
915	002672	东江环保	36,200	185,706.00	0.03
916	688607	康众数字医疗 科技	9,077	184,989.26	0.03
917	002589	瑞康医药	56,100	183,447.00	0.03
918	688016	心脉医疗	942	183,341.46	0.03
919	000417	合肥百货	36,700	183,133.00	0.03

920	688617	惠泰医疗	471	182,983.50	0.03
921	688208	道通科技	7,612	180,785.00	0.03
922	300823	建科机械	8,400	180,684.00	0.03
923	002529	海源复材	14,200	180,056.00	0.03
924	300096	易联众	26,400	180,048.00	0.03
925	601002	晋亿实业	37,200	180,048.00	0.03
926	605077	华康股份	8,300	179,612.00	0.03
927	300269	联建光电	32,500	179,400.00	0.03
928	002522	浙江众成	37,200	178,932.00	0.03
929	000088	盐田港	36,600	178,608.00	0.03
930	300673	佩蒂股份	13,400	178,220.00	0.03
931	603232	格尔软件	12,900	176,601.00	0.03
932	688278	特宝生物	3,353	175,529.55	0.03
933	000753	漳州发展	41,700	175,140.00	0.03
934	688418	震有科技	9,284	175,096.24	0.03
935	301061	匠心家居	3,500	174,125.00	0.03
936	688616	西力科技	12,764	174,100.96	0.03
937	688019	安集科技	1,085	173,339.60	0.03
938	601717	郑煤机	13,643	172,583.95	0.03
939	603628	清源股份	8,200	172,200.00	0.03
940	003028	振邦智能	3,900	171,834.00	0.03
941	002184	海得控制	11,200	171,360.00	0.03
942	300280	紫天科技	4,000	170,920.00	0.03
943	603136	天目湖	9,300	170,841.00	0.03
944	002573	清新环境	34,500	170,775.00	0.03
945	603057	上海紫燕食品	7,900	170,482.00	0.03
946	600180	瑞茂通	27,900	169,911.00	0.03
947	301015	百洋医药	4,700	168,542.00	0.03
948	688633	星球石墨	5,388	168,267.24	0.03
949	688153	唯捷创芯	2,561	167,745.50	0.03
950	688608	恒玄科技	1,080	166,611.60	0.03
951	300120	经纬辉开	22,900	166,254.00	0.03
952	603500	祥和实业	13,500	165,375.00	0.03
953	000333	美的集团	3,000	163,890.00	0.03
954	600268	国电南自	23,500	163,795.00	0.03
955	300592	华凯易佰	6,600	163,482.00	0.03
956	000923	河钢资源	9,700	162,960.00	0.03
957	601952	苏垦农发	15,900	162,816.00	0.03
958	000913	钱江摩托	13,000	162,110.00	0.03
959	603722	阿科力	3,000	161,700.00	0.03
960	301046	能辉科技	5,900	160,008.00	0.03
961	603466	风语筑	11,100	159,618.00	0.03
962	603326	我乐家居	16,900	159,367.00	0.03

963	601001	晋控煤业	12,900	159,057.00	0.03
964	688379	华光新材	8,040	158,950.80	0.03
965	605178	时空科技	5,700	158,061.00	0.03
966	688333	西安铂力特	1,360	157,624.00	0.03
967	300553	集智股份	4,400	157,520.00	0.03
968	600826	兰生股份	17,700	156,468.00	0.03
969	300911	亿田智能	4,100	154,283.00	0.03
970	605268	王力安防	15,800	153,892.00	0.03
971	688218	江苏北人	7,743	153,853.41	0.03
972	002905	金逸影视	14,000	153,440.00	0.03
973	600026	中远海能	12,500	153,000.00	0.03
974	688022	瀚川智能	6,972	152,965.68	0.03
975	603278	大业股份	12,100	152,460.00	0.03
976	603958	哈森股份	16,800	152,376.00	0.03
977	300902	国安达	4,300	151,575.00	0.03
978	300430	诚益通	10,600	151,474.00	0.03
979	600482	中国动力	8,400	151,284.00	0.03
980	002605	姚记科技	6,800	151,096.00	0.03
981	601816	京沪高铁	30,600	150,552.00	0.03
982	300559	佳发教育	9,700	150,350.00	0.03
983	605098	行动教育	3,900	150,345.00	0.03
984	600088	中视传媒	11,700	150,228.00	0.03
985	300283	温州宏丰	23,600	150,096.00	0.03
986	688529	豪森智能股份	6,503	150,024.21	0.03
987	002612	朗姿股份	7,800	149,994.00	0.03
988	603579	荣泰健康	7,200	149,976.00	0.03
989	000526	学大教育	3,000	149,970.00	0.03
990	605598	上海港湾	5,600	149,856.00	0.03
991	000951	中国重汽	11,200	149,632.00	0.03
992	002357	富临运业	19,800	149,490.00	0.03
993	002845	同兴达	8,400	149,100.00	0.03
994	603605	珀莱雅	1,500	149,100.00	0.03
995	300756	金马游乐	9,200	149,040.00	0.03
996	688166	博瑞生物医药	4,257	148,995.00	0.03
997	300471	厚普股份	10,800	148,932.00	0.03
998	000541	佛山照明	22,369	148,753.85	0.03
999	605055	迎丰股份	20,800	148,720.00	0.03
1,000	605305	中际联合	4,600	148,626.00	0.03
1,001	605555	德昌股份	6,500	148,525.00	0.03
1,002	002351	漫步者	8,400	148,428.00	0.03
1,003	002723	小崧股份	14,500	148,335.00	0.03
1,004	600168	武汉控股	21,900	148,263.00	0.03
1,005	002315	焦点科技	4,472	148,157.36	0.03

1,006	300044	赛为智能	25,500	148,155.00	0.03
1,007	603759	海天股份	17,804	147,951.24	0.03
1,008	688520	神州细胞集团 公司	2,746	147,927.02	0.03
1,009	002590	万安科技	13,000	147,810.00	0.03
1,010	000821	京山轻机	9,300	147,777.00	0.03
1,011	600831	广电网络	28,200	147,768.00	0.03
1,012	002299	圣农发展	8,600	147,748.00	0.03
1,013	300647	超频三	23,000	147,660.00	0.03
1,014	002851	麦格米特	6,000	147,600.00	0.03
1,015	600456	宝钛股份	4,700	147,533.00	0.03
1,016	002209	达意隆	13,400	147,400.00	0.03
1,017	603903	中持股份	14,900	147,212.00	0.03
1,018	600571	信雅达	10,700	147,125.00	0.03
1,019	600839	四川长虹	27,800	147,062.00	0.03
1,020	000411	英特集团	13,106	146,918.26	0.03
1,021	000759	中百集团	33,600	146,832.00	0.03
1,022	300761	立华股份	7,000	146,790.00	0.03
1,023	601233	桐昆股份	9,700	146,761.00	0.03
1,024	002414	高德红外	20,100	146,730.00	0.03
1,025	002651	利君股份	21,200	146,704.00	0.03
1,026	000911	南宁糖业	18,000	146,700.00	0.03
1,027	300740	水羊股份	8,800	146,696.00	0.03
1,028	002046	国机精工	12,700	146,685.00	0.03
1,029	001289	龙源电力	7,400	146,594.00	0.03
1,030	002706	良信股份	16,600	146,578.00	0.03
1,031	002560	通达股份	20,300	146,566.00	0.03
1,032	601012	隆基绿能	6,400	146,560.00	0.03
1,033	600138	中青旅	13,800	146,556.00	0.03
1,034	003011	海象新材	6,900	146,487.00	0.03
1,035	002471	中超控股	50,500	146,450.00	0.03
1,036	688108	赛诺医疗科学	11,667	146,420.85	0.03
1,037	600375	汉马科技	24,200	146,410.00	0.03
1,038	000599	青岛双星	32,900	146,405.00	0.03
1,039	003001	中岩大地	8,100	146,367.00	0.03
1,040	002613	北玻股份	29,800	146,318.00	0.03
1,041	002161	远望谷	26,600	146,300.00	0.03
1,042	600100	同方股份	19,900	146,265.00	0.03
1,043	002918	蒙娜丽莎	10,800	146,232.00	0.03
1,044	600667	太极实业	20,800	146,224.00	0.03
1,045	002153	石基信息	15,010	146,197.40	0.03
1,046	000011	深物业 A	16,500	146,190.00	0.03
1,047	600861	北京人力	7,800	146,172.00	0.03
1,048	300485	赛升药业	13,800	146,142.00	0.03

1,049	605488	福莱新材	8,800	146,080.00	0.03
1,050	002536	飞龙股份	10,500	146,055.00	0.03
1,051	600031	三一重工	10,600	145,962.00	0.03
1,052	300912	凯龙高科	8,100	145,881.00	0.03
1,053	000068	华控赛格	41,200	145,848.00	0.03
1,054	002946	新乳业	12,700	145,796.00	0.03
1,055	601700	风范股份	29,100	145,791.00	0.03
1,056	002701	奥瑞金	35,200	145,728.00	0.03
1,057	600982	宁波能源	35,600	145,604.00	0.03
1,058	002695	煌上煌	13,900	145,533.00	0.03
1,059	002930	宏川智慧	7,500	145,425.00	0.03
1,060	000800	一汽解放	17,100	145,350.00	0.02
1,061	000014	沙河股份	13,200	145,332.00	0.02
1,062	600859	王府井	9,098	145,295.06	0.02
1,063	600765	中航重机	7,600	145,236.00	0.02
1,064	002568	百润股份	5,900	145,199.00	0.02
1,065	002318	久立特材	7,301	145,143.88	0.02
1,066	601727	上海电气	34,800	145,116.00	0.02
1,067	603171	税友股份	4,100	145,058.00	0.02
1,068	300949	奥雅股份	2,500	144,975.00	0.02
1,069	002582	好想你	18,900	144,963.00	0.02
1,070	600917	重庆燃气	22,500	144,900.00	0.02
1,071	600690	海尔智家	6,900	144,900.00	0.02
1,072	000993	闽东电力	14,200	144,840.00	0.02
1,073	600004	白云机场	14,800	144,744.00	0.02
1,074	601111	中国国航	19,700	144,598.00	0.02
1,075	600199	金种子酒	7,800	144,456.00	0.02
1,076	002694	顾地科技	23,600	144,432.00	0.02
1,077	601618	中国中冶	47,200	144,432.00	0.02
1,078	000021	深科技	8,900	144,269.00	0.02
1,079	600009	上海机场	4,400	144,232.00	0.02
1,080	601838	成都银行	12,800	144,128.00	0.02
1,081	603377	东方时尚	34,234	144,125.14	0.02
1,082	002798	帝欧家居	22,000	144,100.00	0.02
1,083	688092	爱科科技股份	4,684	144,079.84	0.02
1,084	002096	易普力	13,900	144,004.00	0.02
1,085	688393	安必平医药	5,766	143,977.02	0.02
1,086	600648	外高桥	14,600	143,956.00	0.02
1,087	601368	绿城水务	26,900	143,915.00	0.02
1,088	688190	云路先进材料股份	2,009	143,904.67	0.02
1,089	600919	江苏银行	21,500	143,835.00	0.02
1,090	300795	米奥会展	3,900	143,793.00	0.02
1,091	000065	北方国际	12,800	143,616.00	0.02

1,092	300693	盛弘股份	4,800	143,568.00	0.02
1,093	300762	上海瀚讯	9,500	143,260.00	0.02
1,094	002634	棒杰股份	20,000	143,200.00	0.02
1,095	601456	国联证券	13,200	143,088.00	0.02
1,096	002435	长江健康	34,200	142,614.00	0.02
1,097	600708	光明地产	66,300	142,545.00	0.02
1,098	002933	新兴装备	3,900	142,155.00	0.02
1,099	000978	桂林旅游	18,800	142,128.00	0.02
1,100	002474	榕基软件	21,600	142,128.00	0.02
1,101	603917	合力科技	8,000	142,080.00	0.02
1,102	600067	冠城大通	56,600	142,066.00	0.02
1,103	002517	恺英网络	12,700	141,859.00	0.02
1,104	600101	明星电力	16,800	141,288.00	0.02
1,105	300128	锦富技术	30,500	140,605.00	0.02
1,106	601886	江河集团	21,100	140,526.00	0.02
1,107	603056	德邦股份	9,700	140,359.00	0.02
1,108	000596	古井贡酒	600	139,680.00	0.02
1,109	000797	中国武夷	46,700	139,633.00	0.02
1,110	300057	万顺新材	22,600	139,442.00	0.02
1,111	300577	开润股份	9,500	139,365.00	0.02
1,112	000688	国城矿业	13,500	139,185.00	0.02
1,113	002350	北京科锐	20,600	139,050.00	0.02
1,114	601881	中国银河	11,500	138,575.00	0.02
1,115	000695	滨海能源	12,800	138,368.00	0.02
1,116	603005	晶方科技	6,300	138,348.00	0.02
1,117	002917	金奥博	14,000	138,180.00	0.02
1,118	002455	百川股份	18,600	138,012.00	0.02
1,119	000560	我爱我家	61,200	137,700.00	0.02
1,120	300147	香雪制药	26,700	137,505.00	0.02
1,121	688466	金科环境	7,738	137,349.50	0.02
1,122	001696	宗申动力	20,700	137,241.00	0.02
1,123	002287	奇正藏药	6,100	137,189.00	0.02
1,124	300821	东岳硅材	16,500	136,950.00	0.02
1,125	000639	西王食品	30,900	136,578.00	0.02
1,126	600699	均胜电子	7,600	136,496.00	0.02
1,127	601918	新集能源	25,900	136,493.00	0.02
1,128	600641	万业企业	7,900	136,354.00	0.02
1,129	603126	中材节能	20,200	136,148.00	0.02
1,130	002285	世联行	56,400	135,924.00	0.02
1,131	000650	仁和药业	20,500	135,915.00	0.02
1,132	300525	博思软件	9,100	135,772.00	0.02
1,133	300477	合纵科技	36,200	135,750.00	0.02
1,134	002196	方正电机	18,900	135,702.00	0.02

1,135	002387	维信诺	12,100	135,641.00	0.02
1,136	600025	华能水电	15,700	135,491.00	0.02
1,137	300444	双杰电气	20,100	135,474.00	0.02
1,138	600588	用友网络	7,600	135,204.00	0.02
1,139	000652	泰达股份	34,700	134,983.00	0.02
1,140	600370	三房巷	55,700	134,794.00	0.02
1,141	000407	胜利股份	37,200	134,664.00	0.02
1,142	600684	珠江股份	38,800	134,636.00	0.02
1,143	002208	合肥城建	21,000	134,610.00	0.02
1,144	000859	国风新材	25,300	134,343.00	0.02
1,145	300510	金冠股份	22,500	134,325.00	0.02
1,146	001896	豫能控股	30,700	134,159.00	0.02
1,147	002324	普利特	10,200	134,130.00	0.02
1,148	600797	浙大网新	20,400	133,824.00	0.02
1,149	002454	松芝股份	17,800	133,678.00	0.02
1,150	600979	广安爱众	38,600	133,556.00	0.02
1,151	000030	富奥股份	25,000	133,500.00	0.02
1,152	688234	天岳先进	2,020	133,461.40	0.02
1,153	688280	精进电动	17,400	133,458.00	0.02
1,154	603308	应流股份	9,300	133,269.00	0.02
1,155	300083	创世纪	21,000	132,930.00	0.02
1,156	600581	八一钢铁	37,000	132,830.00	0.02
1,157	688711	江苏宏微科技	3,200	132,768.00	0.02
1,158	600879	航天电子	17,200	132,612.00	0.02
1,159	603085	天成自控	13,000	132,600.00	0.02
1,160	002370	亚太药业	30,900	132,561.00	0.02
1,161	603301	振德医疗	5,400	132,300.00	0.02
1,162	601898	中煤能源	13,600	131,784.00	0.02
1,163	002139	拓邦股份	13,500	131,760.00	0.02
1,164	002167	东方锆业	20,400	131,172.00	0.02
1,165	601799	星宇股份	1,000	131,110.00	0.02
1,166	600237	铜峰电子	16,900	130,806.00	0.02
1,167	603995	甬金股份	6,800	130,764.00	0.02
1,168	600732	爱旭股份	7,400	130,536.00	0.02
1,169	600967	内蒙一机	15,800	130,508.00	0.02
1,170	002515	金字火腿	23,000	129,720.00	0.02
1,171	300102	乾照光电	17,600	129,360.00	0.02
1,172	002360	同德化工	17,700	129,210.00	0.02
1,173	002054	德美化工	19,000	129,200.00	0.02
1,174	688310	迈得医疗	4,316	129,048.40	0.02
1,175	300708	聚灿光电	11,400	128,592.00	0.02
1,176	300472	新元科技	13,600	128,384.00	0.02
1,177	600773	西藏城投	11,700	128,232.00	0.02

1,178	600658	电子城	28,600	127,842.00	0.02
1,179	000729	燕京啤酒	14,800	127,724.00	0.02
1,180	300447	全信股份	8,800	127,600.00	0.02
1,181	002385	大北农	21,400	127,544.00	0.02
1,182	002252	上海莱士	15,900	127,200.00	0.02
1,183	300236	上海新阳	3,600	126,792.00	0.02
1,184	600220	江苏阳光	63,700	126,763.00	0.02
1,185	688690	纳微科技	4,600	126,132.00	0.02
1,186	300702	天宇股份	5,800	125,918.00	0.02
1,187	300893	松原股份	4,300	125,689.00	0.02
1,188	688599	天合光能	4,400	125,532.00	0.02
1,189	603267	鸿远电子	2,500	125,500.00	0.02
1,190	300318	博晖创新	20,100	125,424.00	0.02
1,191	002011	盾安环境	9,100	125,125.00	0.02
1,192	002172	澳洋健康	32,800	124,312.00	0.02
1,193	603787	新日股份	9,900	123,849.00	0.02
1,194	603041	美思德	9,183	123,603.18	0.02
1,195	603328	依顿电子	15,161	123,562.15	0.02
1,196	300743	天地数码	8,900	123,532.00	0.02
1,197	600582	天地科技	22,600	122,944.00	0.02
1,198	002017	东信和平	11,799	122,827.59	0.02
1,199	300887	谱尼测试	10,400	122,824.00	0.02
1,200	601208	东材科技	9,900	122,562.00	0.02
1,201	002133	广宇集团	35,100	122,499.00	0.02
1,202	603368	柳药集团	6,440	121,844.80	0.02
1,203	688625	呈和科技	3,100	121,582.00	0.02
1,204	300452	山河药辅	8,530	121,467.20	0.02
1,205	000728	国元证券	17,700	120,891.00	0.02
1,206	002294	信立泰	3,700	120,842.00	0.02
1,207	603365	水星家纺	8,400	120,792.00	0.02
1,208	688037	芯源微电子	900	120,249.00	0.02
1,209	300243	瑞丰高材	12,300	120,171.00	0.02
1,210	600079	人福医药	4,800	119,328.00	0.02
1,211	002443	金洲管道	17,300	118,505.00	0.02
1,212	002043	兔宝宝	13,300	117,838.00	0.02
1,213	300639	凯普生物	12,600	117,684.00	0.02
1,214	600546	山煤国际	6,700	117,317.00	0.02
1,215	002545	东方铁塔	16,400	117,260.00	0.02
1,216	300092	科新机电	8,800	117,216.00	0.02
1,217	301096	百诚医药	1,800	117,180.00	0.02
1,218	603236	移远通信	2,180	117,175.00	0.02
1,219	688122	西部超导	2,200	117,106.00	0.02
1,220	603012	创力集团	19,800	117,018.00	0.02

1,221	300395	菲利华	3,200	116,992.00	0.02
1,222	000683	远兴能源	19,900	116,813.00	0.02
1,223	688202	美迪西生物医药	1,705	116,587.90	0.02
1,224	603306	华懋科技	4,300	116,573.00	0.02
1,225	300938	信测标准	3,240	116,283.60	0.02
1,226	002423	中粮资本	17,400	116,232.00	0.02
1,227	603020	爱普股份	13,900	116,204.00	0.02
1,228	301090	华润材料	10,700	116,202.00	0.02
1,229	002191	劲嘉股份	21,600	115,992.00	0.02
1,230	300772	运达股份	10,900	115,976.00	0.02
1,231	603170	宝立食品科技	6,857	115,951.87	0.02
1,232	603458	勘设股份	13,400	115,642.00	0.02
1,233	300664	鹏鹞环保	21,600	115,560.00	0.02
1,234	300908	仲景食品	2,800	115,556.00	0.02
1,235	300888	稳健医疗	3,100	115,475.00	0.02
1,236	002746	仙坛股份	16,400	115,456.00	0.02
1,237	600160	巨化股份	7,000	115,430.00	0.02
1,238	603113	金能科技	14,300	115,401.00	0.02
1,239	301235	华康医疗	4,500	115,335.00	0.02
1,240	002772	众兴菌业	14,600	115,194.00	0.02
1,241	000887	中鼎股份	9,300	115,041.00	0.02
1,242	001316	润贝航科	3,300	114,873.00	0.02
1,243	600566	济川药业	3,643	114,499.49	0.02
1,244	600256	广汇能源	16,000	114,240.00	0.02
1,245	300286	安科瑞	4,400	114,092.00	0.02
1,246	600728	佳都科技	19,800	113,256.00	0.02
1,247	300903	科翔股份	11,100	111,666.00	0.02
1,248	688106	金宏气体	4,628	111,488.52	0.02
1,249	002998	优彩资源	13,800	109,710.00	0.02
1,250	300150	世纪瑞尔	22,400	108,640.00	0.02
1,251	603797	联泰环保	19,600	108,192.00	0.02
1,252	688571	杭华油墨股份	14,391	107,644.68	0.02
1,253	300889	爱克股份	6,400	107,520.00	0.02
1,254	301127	天源环保	9,700	106,603.00	0.02
1,255	002588	史丹利	16,700	106,546.00	0.02
1,256	300239	东宝生物	17,100	106,533.00	0.02
1,257	603798	康普顿	11,000	106,370.00	0.02
1,258	300824	北鼎股份	11,700	105,651.00	0.02
1,259	002421	达实智能	32,700	105,294.00	0.02
1,260	688357	建龙微纳	2,035	105,189.15	0.02
1,261	002832	比音勒芬	3,300	104,610.00	0.02
1,262	300321	同大股份	5,400	104,490.00	0.02
1,263	002847	盐津铺子	1,500	104,220.00	0.02

1,264	002633	申科股份	8,900	104,041.00	0.02
1,265	603718	海利生物	9,700	103,887.00	0.02
1,266	600120	浙江东方	28,900	103,751.00	0.02
1,267	301177	迪阿股份	3,500	103,215.00	0.02
1,268	002817	黄山胶囊	11,700	102,492.00	0.02
1,269	000931	中关村	17,300	101,551.00	0.02
1,270	300384	三联虹普	6,300	100,548.00	0.02
1,271	300619	金银河	1,800	100,170.00	0.02
1,272	688585	上纬新材	11,773	99,717.31	0.02
1,273	300582	英飞特	8,200	98,482.00	0.02
1,274	002014	永新股份	11,700	97,695.00	0.02
1,275	688687	北京凯因科技	2,792	97,329.12	0.02
1,276	688332	中科蓝讯	1,260	95,029.20	0.02
1,277	688601	力芯微股份	1,800	94,302.00	0.02
1,278	688246	嘉和美康科技	2,795	93,408.90	0.02
1,279	301233	盛帮股份	2,100	93,282.00	0.02
1,280	688618	三旺通信	1,587	92,998.20	0.02
1,281	600612	老凤祥	1,300	89,700.00	0.02
1,282	688368	晶丰明源半导体	830	89,590.20	0.02
1,283	688697	纽威数控装备	4,729	89,047.07	0.02
1,284	002429	兆驰股份	15,800	88,164.00	0.02
1,285	300709	精研科技	2,800	87,332.00	0.02
1,286	000920	沃顿科技	8,500	84,405.00	0.01
1,287	000506	中润资源	20,400	84,252.00	0.01
1,288	603383	顶点软件	1,700	83,810.00	0.01
1,289	688168	北京安博通	2,300	83,168.00	0.01
1,290	300736	百邦科技	6,500	83,005.00	0.01
1,291	300882	万胜智能	3,400	82,824.00	0.01
1,292	300861	美畅股份	2,486	82,758.94	0.01
1,293	002270	华明装备	5,800	81,896.00	0.01
1,294	002745	木林森	9,400	81,404.00	0.01
1,295	601333	广深铁路	31,300	81,067.00	0.01
1,296	300851	交大思诺	2,600	81,042.00	0.01
1,297	603602	纵横通信	5,427	79,993.98	0.01
1,298	600883	博闻科技	9,213	78,310.50	0.01
1,299	002264	新华都	14,100	77,691.00	0.01
1,300	605050	福然德	6,300	77,679.00	0.01
1,301	600097	开创国际	7,200	76,968.00	0.01
1,302	300698	万马科技	2,100	76,650.00	0.01
1,303	688028	沃尔德金刚石	3,075	76,536.75	0.01
1,304	688656	浩欧博生物	2,200	76,472.00	0.01
1,305	002171	楚江新材	10,000	74,800.00	0.01
1,306	688257	新锐股份	2,952	73,918.08	0.01

1,307	600829	人民同泰	9,400	73,508.00	0.01
1,308	300020	银江技术	8,842	73,388.60	0.01
1,309	688099	晶晨半导体	1,171	73,339.73	0.01
1,310	002820	桂发祥	6,380	72,859.60	0.01
1,311	688100	威胜信息	2,502	72,357.84	0.01
1,312	601865	福莱特	2,700	72,090.00	0.01
1,313	600862	中航高科	3,200	70,880.00	0.01
1,314	600901	江苏金租	14,600	70,664.00	0.01
1,315	300947	德必集团	4,500	70,605.00	0.01
1,316	003031	中瓷电子	800	70,584.00	0.01
1,317	603323	苏农银行	16,910	70,345.60	0.01
1,318	688096	江苏京源环保	7,322	68,607.14	0.01
1,319	301018	申菱环境	2,600	68,484.00	0.01
1,320	003000	劲仔食品	5,600	68,432.00	0.01
1,321	688057	金达莱环保	4,832	68,421.12	0.01
1,322	688511	天微电子	2,147	67,566.09	0.01
1,323	002035	华帝股份	10,865	67,471.65	0.01
1,324	688078	龙软科技	1,667	67,213.44	0.01
1,325	603700	宁水集团	4,700	67,069.00	0.01
1,326	603221	爱丽家居	6,700	66,598.00	0.01
1,327	603192	汇得科技	3,360	66,024.00	0.01
1,328	603790	雅运股份	4,700	65,847.00	0.01
1,329	002134	天津普林	6,000	65,820.00	0.01
1,330	000685	中山公用	9,000	65,790.00	0.01
1,331	600332	白云山	2,300	65,780.00	0.01
1,332	603321	梅轮电梯	7,700	65,758.00	0.01
1,333	600064	南京高科	10,789	65,165.56	0.01
1,334	000715	中兴商业	8,900	65,059.00	0.01
1,335	300876	蒙泰高新	2,600	65,052.00	0.01
1,336	600938	中国海油	3,100	65,007.00	0.01
1,337	603199	九华旅游	2,497	64,797.15	0.01
1,338	300829	金丹科技	3,100	64,728.00	0.01
1,339	001222	源飞宠物	4,400	64,680.00	0.01
1,340	605169	洪通燃气	5,700	64,581.00	0.01
1,341	688098	申联生物医药	8,627	64,529.96	0.01
1,342	002774	快意电梯	7,766	64,457.80	0.01
1,343	605338	巴比食品	3,000	64,440.00	0.01
1,344	600573	惠泉啤酒	6,200	64,356.00	0.01
1,345	300226	上海钢联	2,229	63,504.21	0.01
1,346	300009	安科生物	6,200	63,364.00	0.01
1,347	300428	立中集团	3,000	63,360.00	0.01
1,348	300440	运达科技	8,500	63,325.00	0.01
1,349	000823	超声电子	6,600	63,162.00	0.01

1,350	688059	株洲华锐精密	800	62,968.00	0.01
1,351	688076	诺泰生物	1,400	62,930.00	0.01
1,352	300281	金明精机	10,500	62,895.00	0.01
1,353	603788	宁波高发	4,200	62,706.00	0.01
1,354	688049	炬芯科技	1,640	62,434.80	0.01
1,355	603739	蔚蓝生物	4,100	62,402.00	0.01
1,356	002179	中航光电	1,600	62,400.00	0.01
1,357	603507	振江股份	2,400	62,184.00	0.01
1,358	688331	荣昌生物	1,000	62,060.00	0.01
1,359	300834	星辉环材	2,900	62,002.00	0.01
1,360	300651	金陵体育	3,100	61,938.00	0.01
1,361	688080	映翰通网络	1,518	61,600.44	0.01
1,362	600363	联创光电	1,800	61,200.00	0.01
1,363	301219	腾远钴业	1,550	61,023.50	0.01
1,364	000020	深华发 A	4,700	60,865.00	0.01
1,365	688566	吉贝尔药业	1,934	60,708.26	0.01
1,366	300682	朗新科技	3,700	60,643.00	0.01
1,367	603103	横店影视	3,400	60,452.00	0.01
1,368	603130	云中马股份	2,800	60,340.00	0.01
1,369	605007	五洲特纸	4,100	60,311.00	0.01
1,370	002980	华盛昌	2,200	60,280.00	0.01
1,371	002818	富森美	4,800	59,808.00	0.01
1,372	600970	中材国际	6,400	59,776.00	0.01
1,373	301006	迈拓股份	3,300	59,763.00	0.01
1,374	300227	光韵达	7,600	59,584.00	0.01
1,375	600050	中国联通	13,600	59,568.00	0.01
1,376	300407	凯发电气	6,300	59,472.00	0.01
1,377	300019	硅宝科技	3,600	59,436.00	0.01
1,378	600391	航发科技	3,100	59,272.00	0.01
1,379	000902	新洋丰	5,200	59,228.00	0.01
1,380	002188	中天服务	9,000	59,220.00	0.01
1,381	300192	科德教育	6,000	59,220.00	0.01
1,382	301167	建研设计	3,500	59,220.00	0.01
1,383	688568	中科星图公司	1,207	59,215.42	0.01
1,384	002148	北纬科技	9,800	59,192.00	0.01
1,385	300563	神宇股份	3,700	59,163.00	0.01
1,386	603029	天鹅股份	2,900	59,160.00	0.01
1,387	300388	节能国祯	9,200	59,156.00	0.01
1,388	603101	汇嘉时代	8,800	59,136.00	0.01
1,389	002063	远光软件	9,568	59,130.24	0.01
1,390	603976	正川股份	3,000	59,130.00	0.01
1,391	002415	海康威视	1,700	59,024.00	0.01
1,392	002981	朝阳科技	1,700	59,024.00	0.01

1,393	600371	万向德农	5,500	59,015.00	0.01
1,394	600602	云赛智联	5,100	59,007.00	0.01
1,395	300547	川环科技	3,500	58,975.00	0.01
1,396	300424	航新科技	4,500	58,950.00	0.01
1,397	600757	长江传媒	7,900	58,855.00	0.01
1,398	300554	三超新材	2,200	58,850.00	0.01
1,399	300747	锐科激光	2,500	58,825.00	0.01
1,400	001319	铭科精技	2,300	58,811.00	0.01
1,401	002190	成飞集成	3,100	58,807.00	0.01
1,402	300800	力合科技	4,300	58,781.00	0.01
1,403	605166	聚合顺	5,900	58,528.00	0.01
1,404	601311	骆驼股份	7,300	58,473.00	0.01
1,405	300929	华骐环保	4,800	58,416.00	0.01
1,406	301030	仕净科技	1,400	58,380.00	0.01
1,407	603217	元利科技	3,200	58,368.00	0.01
1,408	603080	新疆火炬	3,500	58,310.00	0.01
1,409	300732	设研院	6,600	58,278.00	0.01
1,410	600718	东软集团	6,300	58,275.00	0.01
1,411	603300	华铁应急	9,100	58,240.00	0.01
1,412	603993	洛阳钼业	11,200	58,240.00	0.01
1,413	300533	冰川网络	2,100	58,170.00	0.01
1,414	002961	瑞达期货	3,900	58,110.00	0.01
1,415	000848	承德露露	7,400	58,090.00	0.01
1,416	301113	雅艺科技	1,800	58,086.00	0.01
1,417	000655	金岭矿业	8,100	58,077.00	0.01
1,418	000690	宝新能源	13,100	58,033.00	0.01
1,419	603351	威尔药业	2,200	58,014.00	0.01
1,420	001227	兰州银行	22,300	57,980.00	0.01
1,421	301026	浩通科技	1,900	57,855.00	0.01
1,422	600740	山西焦化	11,469	57,803.76	0.01
1,423	000537	广宇发展	6,000	57,780.00	0.01
1,424	601778	晶科科技	16,500	57,750.00	0.01
1,425	600483	福能股份	6,930	57,311.10	0.01
1,426	301162	国能日新	1,100	57,068.00	0.01
1,427	688389	深圳普门科技	2,531	56,972.81	0.01
1,428	301033	迈普医学	1,300	56,602.00	0.01
1,429	600621	华鑫股份	4,000	56,280.00	0.01
1,430	300426	唐德影视	5,100	56,253.00	0.01
1,431	600459	贵研铂业	3,900	56,004.00	0.01
1,432	301359	东南电子	2,100	55,881.00	0.01
1,433	000966	长源电力	12,600	55,818.00	0.01
1,434	600770	综艺股份	11,200	54,992.00	0.01
1,435	301077	星华新材	2,700	54,891.00	0.01

1,436	002697	红旗连锁	10,900	54,282.00	0.01
1,437	605222	起帆电缆	2,800	53,984.00	0.01
1,438	603639	海利尔	3,400	53,380.00	0.01
1,439	002895	川恒股份	2,800	53,200.00	0.01
1,440	300819	聚杰微纤	3,400	52,870.00	0.01
1,441	603159	上海亚虹	3,200	52,480.00	0.01
1,442	300605	恒锋信息	3,500	52,395.00	0.01
1,443	600007	中国国贸	2,700	52,326.00	0.01
1,444	605128	上海沿浦	900	52,245.00	0.01
1,445	300224	正海磁材	4,400	51,568.00	0.01
1,446	300681	英搏尔	2,650	51,065.50	0.01
1,447	002871	伟隆股份	4,540	50,757.20	0.01
1,448	603966	法兰泰克	6,200	50,716.00	0.01
1,449	688318	财富趋势	400	50,520.00	0.01
1,450	601766	中国中车	9,600	50,496.00	0.01
1,451	688459	哈铁科技	5,386	50,412.96	0.01
1,452	002829	星网宇达	1,860	50,294.40	0.01
1,453	688636	智明达电子	761	49,617.20	0.01
1,454	600593	大连圣亚	2,500	49,150.00	0.01
1,455	600651	飞乐音响	13,600	48,960.00	0.01
1,456	601616	广电电气	13,400	48,642.00	0.01
1,457	300155	安居宝	8,200	48,544.00	0.01
1,458	603183	建研院	10,340	48,287.80	0.01
1,459	000430	张家界	7,400	48,174.00	0.01
1,460	688171	纬德信息	2,135	48,037.50	0.01
1,461	605155	西大门	3,100	47,988.00	0.01
1,462	600908	无锡银行	9,500	47,975.00	0.01
1,463	002815	崇达技术	5,000	47,900.00	0.01
1,464	600470	六国化工	8,200	47,888.00	0.01
1,465	300518	盛讯达	2,800	47,824.00	0.01
1,466	300278	华昌达	12,500	47,750.00	0.01
1,467	300509	新美星	6,600	47,718.00	0.01
1,468	600576	祥源文旅	6,400	47,616.00	0.01
1,469	300464	星徽股份	7,900	47,558.00	0.01
1,470	300411	金盾股份	6,800	47,532.00	0.01
1,471	300665	飞鹿股份	5,500	47,520.00	0.01
1,472	002638	勤上股份	17,500	47,425.00	0.01
1,473	603703	盛洋科技	3,700	47,397.00	0.01
1,474	300658	延江股份	7,000	47,390.00	0.01
1,475	300289	利德曼	7,700	47,355.00	0.01
1,476	300072	海新能科	13,486	47,335.86	0.01
1,477	000622	恒立实业	10,800	47,304.00	0.01
1,478	300931	通用电梯	5,600	47,264.00	0.01

1,479	600478	科力远	9,600	47,232.00	0.01
1,480	603817	海峡环保	7,400	47,212.00	0.01
1,481	300414	中光防雷	4,900	47,187.00	0.01
1,482	300611	美力科技	4,100	47,109.00	0.01
1,483	000017	深中华 A	10,800	46,980.00	0.01
1,484	600869	远东股份	10,700	46,973.00	0.01
1,485	002969	嘉美包装	11,400	46,968.00	0.01
1,486	300004	南风股份	7,600	46,968.00	0.01
1,487	300300	海峡创新	11,700	46,917.00	0.01
1,488	600650	锦江在线	4,900	46,893.00	0.01
1,489	600063	皖维高新	10,900	46,870.00	0.01
1,490	600538	国发股份	10,100	46,864.00	0.01
1,491	600448	华纺股份	14,200	46,860.00	0.01
1,492	600550	保变电气	9,600	46,848.00	0.01
1,493	300326	凯利泰	7,400	46,842.00	0.01
1,494	002048	宁波华翔	3,600	46,836.00	0.01
1,495	300641	正丹股份	8,300	46,812.00	0.01
1,496	600390	五矿资本	10,000	46,800.00	0.01
1,497	002412	汉森制药	6,900	46,782.00	0.01
1,498	002361	神剑股份	11,900	46,767.00	0.01
1,499	300463	迈克生物	3,100	46,717.00	0.01
1,500	600308	华泰股份	13,500	46,710.00	0.01
1,501	600433	冠豪高新	13,500	46,710.00	0.01
1,502	603980	吉华集团	10,000	46,700.00	0.01
1,503	603811	诚意药业	4,500	46,665.00	0.01
1,504	600075	新疆天业	10,800	46,656.00	0.01
1,505	300365	恒华科技	6,900	46,644.00	0.01
1,506	002094	青岛金王	12,300	46,617.00	0.01
1,507	000590	启迪药业	5,200	46,592.00	0.01
1,508	002154	报喜鸟	8,200	46,576.00	0.01
1,509	600082	海泰发展	13,500	46,575.00	0.01
1,510	002084	海鸥住工	11,700	46,566.00	0.01
1,511	000566	海南海药	10,300	46,556.00	0.01
1,512	603311	金海高科	4,500	46,530.00	0.01
1,513	002244	滨江集团	6,400	46,528.00	0.01
1,514	300126	锐奇股份	6,500	46,475.00	0.01
1,515	002109	兴化股份	9,800	46,452.00	0.01
1,516	603556	海兴电力	1,600	46,448.00	0.01
1,517	002524	光正眼科	7,200	46,440.00	0.01
1,518	601828	美凯龙	12,000	46,440.00	0.01
1,519	300381	溢多利	6,300	46,431.00	0.01
1,520	300152	新动力	15,900	46,428.00	0.01
1,521	600500	中化国际	10,500	46,410.00	0.01

1,522	600643	爱建集团	9,100	46,410.00	0.01
1,523	601366	利群股份	8,500	46,410.00	0.01
1,524	600722	金牛化工	9,300	46,407.00	0.01
1,525	300190	维尔利	11,100	46,398.00	0.01
1,526	002230	科大讯飞	1,000	46,380.00	0.01
1,527	002278	神开股份	7,900	46,373.00	0.01
1,528	300234	开尔新材	8,900	46,369.00	0.01
1,529	300449	汉邦高科	6,900	46,368.00	0.01
1,530	300425	中建环能	9,900	46,332.00	0.01
1,531	300371	汇中股份	3,800	46,322.00	0.01
1,532	000901	航天科技	4,967	46,292.44	0.01
1,533	300187	永清环保	8,600	46,268.00	0.01
1,534	600936	广西广电	12,600	46,242.00	0.01
1,535	600611	大众交通	15,500	46,190.00	0.01
1,536	300998	宁波方正	2,000	46,160.00	0.01
1,537	600800	渤海化学	12,500	46,125.00	0.01
1,538	600665	天地源	12,200	46,116.00	0.01
1,539	600693	东百集团	11,500	46,115.00	0.01
1,540	002650	加加食品	11,300	46,104.00	0.01
1,541	000850	华茂股份	12,100	46,101.00	0.01
1,542	000958	电投产融	11,700	46,098.00	0.01
1,543	000761	本钢板材	12,900	46,053.00	0.01
1,544	600227	赤天化	17,500	46,025.00	0.01
1,545	600828	茂业商业	12,600	45,990.00	0.01
1,546	000953	河化股份	8,400	45,948.00	0.01
1,547	000972	ST中基	12,900	45,795.00	0.01
1,548	002620	瑞和股份	8,500	45,730.00	0.01
1,549	600403	大有能源	12,000	45,600.00	0.01
1,550	603586	金麒麟	2,850	45,600.00	0.01
1,551	600824	益民集团	11,900	45,577.00	0.01
1,552	300696	爱乐达	2,600	45,266.00	0.01
1,553	300133	华策影视	7,700	45,199.00	0.01
1,554	600783	鲁信创投	3,900	45,162.00	0.01
1,555	300387	富邦股份	5,400	45,036.00	0.01
1,556	002788	鹭燕医药	5,000	44,950.00	0.01
1,557	688055	昆山龙腾光电	9,200	44,896.00	0.01
1,558	300971	博亚精工	1,800	44,820.00	0.01
1,559	002174	游族网络	3,900	44,694.00	0.01
1,560	605001	威奥股份	6,600	44,154.00	0.01
1,561	600020	中原高速	11,900	43,792.00	0.01
1,562	600609	金杯汽车	8,900	43,254.00	0.01
1,563	601921	浙版传媒	5,500	42,020.00	0.01
1,564	600243	青海华鼎	8,800	41,976.00	0.01

1,565	300717	华信新材	2,500	41,975.00	0.01
1,566	603580	艾艾精工	2,800	41,692.00	0.01
1,567	300074	华平股份	9,000	41,670.00	0.01
1,568	002295	精艺股份	5,100	41,667.00	0.01
1,569	300154	瑞凌股份	5,600	41,440.00	0.01
1,570	300868	杰美特	1,900	41,268.00	0.01
1,571	603915	国茂股份	2,500	41,200.00	0.01
1,572	688187	时代电气	1,132	41,125.56	0.01
1,573	300885	海昌新材	3,900	41,106.00	0.01
1,574	002731	萃华珠宝	3,700	40,922.00	0.01
1,575	601518	吉林高速	15,800	40,290.00	0.01
1,576	300645	正元智慧	2,200	40,018.00	0.01
1,577	002186	全聚德	3,400	39,644.00	0.01
1,578	605288	凯迪股份	840	39,580.80	0.01
1,579	603679	华体科技	2,500	37,325.00	0.01
1,580	600207	安彩高科	7,800	37,206.00	0.01
1,581	688093	世华科技	2,000	36,420.00	0.01
1,582	300353	东土科技	3,700	35,816.00	0.01
1,583	002194	武汉凡谷	3,600	35,496.00	0.01
1,584	002535	ST林重	7,600	35,264.00	0.01
1,585	603843	正平股份	10,000	34,900.00	0.01
1,586	300247	融捷健康	9,800	34,888.00	0.01
1,587	002391	长青股份	5,500	34,650.00	0.01
1,588	002170	芭田股份	6,200	34,410.00	0.01
1,589	688163	赛伦生物	1,711	34,202.89	0.01
1,590	300636	同和药业	3,200	33,728.00	0.01
1,591	000567	海德股份	3,120	33,165.60	0.01
1,592	600976	健民集团	500	32,625.00	0.01
1,593	001217	华尔泰	2,300	32,476.00	0.01
1,594	600060	海信视像	1,500	31,350.00	0.01
1,595	603936	博敏电子	2,953	30,829.32	0.01
1,596	688292	浩瀚深度信息 技术	1,111	30,574.72	0.01
1,597	002078	太阳纸业	2,500	30,425.00	0.01
1,598	001218	丽臣实业	1,360	29,389.60	0.01
1,599	601860	紫金银行	11,500	29,095.00	0.01
1,600	601388	怡球资源	11,000	28,820.00	0.00
1,601	002578	闽发铝业	6,400	28,672.00	0.00
1,602	300446	乐凯新材	1,800	28,206.00	0.00
1,603	300084	海默科技	3,600	27,504.00	0.00
1,604	002365	永安药业	2,800	27,384.00	0.00
1,605	600850	电科数字	1,200	26,100.00	0.00
1,606	688560	明冠新材料	1,400	26,068.00	0.00
1,607	301051	信濠光电	400	25,468.00	0.00

1,608	002782	可立克	1,800	25,290.00	0.00
1,609	600288	大恒科技	1,900	21,622.00	0.00
1,610	003030	祖名股份	1,000	21,600.00	0.00
1,611	002623	亚玛顿	800	21,400.00	0.00
1,612	300700	岱勒新材	1,200	20,364.00	0.00
1,613	003018	金富科技	1,866	19,872.90	0.00
1,614	605500	森林包装	2,500	19,825.00	0.00
1,615	001216	华瓷股份	1,500	19,575.00	0.00
1,616	301238	瑞泰新材	1,100	19,283.00	0.00
1,617	002837	英维克	700	19,236.00	0.00
1,618	603339	四方科技	1,600	19,024.00	0.00
1,619	001212	中旗新材	800	19,008.00	0.00
1,620	002867	周大生	1,200	18,216.00	0.00
1,621	000600	建投能源	3,600	18,036.00	0.00
1,622	603766	隆鑫通用	3,400	17,544.00	0.00
1,623	688569	铁科轨道	600	16,566.00	0.00
1,624	688676	海南金盘智能科技	460	16,481.80	0.00
1,625	000899	赣能股份	2,100	16,254.00	0.00
1,626	688360	德马科技	786	15,775.02	0.00
1,627	600595	中孚实业	4,500	15,660.00	0.00
1,628	300491	通合科技	700	15,596.00	0.00
1,629	002919	名臣健康	600	15,384.00	0.00
1,630	603707	健友股份	1,000	15,000.00	0.00
1,631	000061	农产品	2,300	14,881.00	0.00
1,632	001267	汇绿生态	2,800	14,644.00	0.00
1,633	601728	中国电信	2,700	14,607.00	0.00
1,634	002386	天原股份	2,830	14,602.80	0.00
1,635	001258	立新能源	1,800	14,544.00	0.00
1,636	603757	大元泵业	600	14,544.00	0.00
1,637	600662	外服控股	3,000	14,400.00	0.00
1,638	002250	联化科技	2,000	14,260.00	0.00
1,639	002462	嘉事堂	1,000	14,210.00	0.00
1,640	603881	数据港	700	13,874.00	0.00
1,641	603239	浙江仙通	900	13,743.00	0.00
1,642	300263	隆华科技	1,900	13,376.00	0.00
1,643	300705	九典制药	400	13,292.00	0.00
1,644	603198	迎驾贡酒	200	13,258.00	0.00
1,645	605177	东亚药业	500	13,240.00	0.00
1,646	600461	洪城环境	1,400	12,796.00	0.00
1,647	600586	金晶科技	1,900	12,692.00	0.00
1,648	001338	永顺泰	1,000	12,060.00	0.00
1,649	600779	水井坊	200	11,754.00	0.00
1,650	002664	信质集团	700	11,641.00	0.00

1,651	600226	瀚叶股份	4,400	11,484.00	0.00
1,652	002495	佳隆股份	3,400	10,880.00	0.00
1,653	002673	西部证券	1,700	10,829.00	0.00
1,654	002461	珠江啤酒	1,300	10,270.00	0.00
1,655	688033	天宜上佳	600	10,140.00	0.00
1,656	600018	上港集团	2,000	9,800.00	0.00
1,657	002757	南兴股份	600	9,384.00	0.00
1,658	603577	汇金通	900	9,360.00	0.00
1,659	600792	云煤能源	2,000	9,320.00	0.00
1,660	002983	芯瑞达	300	9,258.00	0.00
1,661	688619	罗普特科技	643	9,040.58	0.00
1,662	600918	中泰证券	1,300	8,918.00	0.00
1,663	300926	博俊科技	300	8,799.00	0.00
1,664	000607	华媒控股	1,900	8,702.00	0.00
1,665	603505	金石资源	300	8,145.00	0.00
1,666	301065	本立科技	350	7,962.50	0.00
1,667	600537	亿晶光电	1,400	7,714.00	0.00
1,668	000554	泰山石油	1,300	7,501.00	0.00
1,669	301003	江苏博云	300	7,488.00	0.00
1,670	300091	金通灵	2,800	7,476.00	0.00
1,671	002521	齐峰新材	900	7,443.00	0.00
1,672	688353	华盛锂电	271	7,425.40	0.00
1,673	600356	恒丰纸业	900	7,182.00	0.00
1,674	300897	山科智能	200	6,840.00	0.00
1,675	605158	华达新材	900	6,840.00	0.00
1,676	002345	潮宏基	1,000	6,810.00	0.00
1,677	601985	中国核电	900	6,750.00	0.00
1,678	001333	光华股份	300	6,642.00	0.00
1,679	688737	中自科技	200	6,620.00	0.00
1,680	002106	莱宝高科	600	6,384.00	0.00
1,681	301195	北路智控	157	6,371.06	0.00
1,682	002241	歌尔股份	300	6,303.00	0.00
1,683	003036	泰坦股份	500	6,200.00	0.00
1,684	603897	长城科技	300	6,144.00	0.00
1,685	600369	西南证券	1,500	6,135.00	0.00
1,686	002164	宁波东力	900	6,075.00	0.00
1,687	002540	亚太科技	900	5,949.00	0.00
1,688	603955	大千生态	400	5,876.00	0.00
1,689	600796	钱江生化	1,000	5,850.00	0.00
1,690	002705	新宝股份	400	5,828.00	0.00
1,691	601038	一拖股份	400	5,828.00	0.00
1,692	300905	宝丽迪	300	5,814.00	0.00
1,693	300775	三角防务	200	5,580.00	0.00

1,694	301289	国缆检测	100	5,521.00	0.00
1,695	300304	云意电气	800	5,432.00	0.00
1,696	688210	泛海统联精密 制造	200	5,230.00	0.00
1,697	001283	豪鹏科技	100	5,190.00	0.00
1,698	301261	C 恒工	100	5,162.00	0.00
1,699	300779	惠城环保	100	5,160.00	0.00
1,700	000591	太阳能	900	5,022.00	0.00
1,701	301398	星源卓镁	100	4,929.00	0.00
1,702	301141	C 中科磁	100	4,654.00	0.00
1,703	600059	古越龙山	500	4,650.00	0.00
1,704	301210	C 金杨	100	4,548.00	0.00
1,705	688178	万德斯环保	251	4,538.08	0.00
1,706	603725	天安新材	400	4,452.00	0.00
1,707	603182	嘉华生物科技 股份	300	4,431.00	0.00
1,708	300870	欧陆通	100	4,427.00	0.00
1,709	000686	东北证券	600	4,260.00	0.00
1,710	002039	黔源电力	300	4,137.00	0.00
1,711	002683	广东宏大	200	4,016.00	0.00
1,712	301270	汉仪股份	100	3,975.00	0.00
1,713	300305	裕兴股份	400	3,952.00	0.00
1,714	601600	中国铝业	700	3,948.00	0.00
1,715	001225	和泰机电	100	3,923.00	0.00
1,716	301208	中亦科技	100	3,904.00	0.00
1,717	301428	C 世纪恒	100	3,865.00	0.00
1,718	600262	北方股份	200	3,850.00	0.00
1,719	688373	盟科药业	578	3,774.34	0.00
1,720	600301	华锡有色	300	3,774.00	0.00
1,721	000019	深粮控股	500	3,770.00	0.00
1,722	301039	中集车辆	400	3,752.00	0.00
1,723	002873	新天药业	300	3,738.00	0.00
1,724	600810	神马股份	500	3,720.00	0.00
1,725	301152	天力锂能	100	3,658.00	0.00
1,726	001282	N 三联锻	100	3,617.00	0.00
1,727	600598	北大荒	300	3,591.00	0.00
1,728	603357	设计总院	400	3,560.00	0.00
1,729	000875	吉电股份	800	3,520.00	0.00
1,730	001202	炬申股份	200	3,514.00	0.00
1,731	001380	C 华纬	100	3,484.00	0.00
1,732	002557	洽洽食品	100	3,482.00	0.00
1,733	301120	新特电气	300	3,477.00	0.00
1,734	300791	仙乐健康	100	3,466.00	0.00
1,735	003003	天元股份	300	3,447.00	0.00

1,736	301196	唯科科技	100	3,438.00	0.00
1,737	002442	龙星化工	500	3,435.00	0.00
1,738	300922	天秦装备	200	3,414.00	0.00
1,739	301122	采纳股份	100	3,386.00	0.00
1,740	301139	元道通信	100	3,381.00	0.00
1,741	603650	彤程新材	100	3,330.00	0.00
1,742	301150	中一科技	100	3,326.00	0.00
1,743	301256	华融化学	400	3,292.00	0.00
1,744	600735	新华锦	500	3,225.00	0.00
1,745	301202	C朗威	100	3,213.00	0.00
1,746	002978	安宁股份	100	3,166.00	0.00
1,747	600114	东睦股份	200	3,098.00	0.00
1,748	301456	C盘古	100	3,080.00	0.00
1,749	301468	C博盈	100	3,049.00	0.00
1,750	002677	浙江美大	300	3,033.00	0.00
1,751	001298	好上好	100	2,982.00	0.00
1,752	001318	阳光乳业	200	2,968.00	0.00
1,753	301499	C维科精	100	2,941.00	0.00
1,754	603237	五芳斋实业	100	2,930.00	0.00
1,755	300809	华辰装备	100	2,925.00	0.00
1,756	600343	航天动力	300	2,925.00	0.00
1,757	603079	圣达生物	200	2,914.00	0.00
1,758	300248	新开普	300	2,877.00	0.00
1,759	301132	满坤科技	100	2,871.00	0.00
1,760	002281	光迅科技	100	2,850.00	0.00
1,761	301290	东星医疗	100	2,759.00	0.00
1,762	300711	广哈通信	200	2,670.00	0.00
1,763	002838	道恩股份	200	2,562.00	0.00
1,764	300546	雄帝科技	160	2,523.20	0.00
1,765	301302	华如科技	100	2,511.00	0.00
1,766	603180	金牌厨柜	100	2,509.00	0.00
1,767	603529	爱玛科技	100	2,504.00	0.00
1,768	600512	腾达建设	1,000	2,480.00	0.00
1,769	603176	汇通集团	400	2,472.00	0.00
1,770	002085	万丰奥威	500	2,470.00	0.00
1,771	300599	雄塑科技	300	2,406.00	0.00
1,772	603097	江苏华辰	100	2,399.00	0.00
1,773	002624	完美世界	200	2,368.00	0.00
1,774	000504	南华生物	200	2,320.00	0.00
1,775	300843	胜蓝股份	100	2,298.00	0.00
1,776	600547	山东黄金	100	2,287.00	0.00
1,777	605259	绿田机械	100	2,270.00	0.00
1,778	002614	奥佳华	300	2,250.00	0.00

1,779	600415	小商品城	300	2,196.00	0.00
1,780	300992	泰福泵业	100	2,158.00	0.00
1,781	301277	新天地	100	2,081.00	0.00
1,782	601611	中国核建	300	2,079.00	0.00
1,783	000505	京粮控股	300	2,052.00	0.00
1,784	002544	普天科技	100	2,032.00	0.00
1,785	300005	探路者	300	1,986.00	0.00
1,786	301102	兆讯传媒	100	1,914.00	0.00
1,787	000825	太钢不锈	500	1,865.00	0.00
1,788	300718	长盛轴承	100	1,855.00	0.00
1,789	300416	苏试试验	100	1,837.00	0.00
1,790	600618	氯碱化工	200	1,820.00	0.00
1,791	000987	越秀资本	300	1,806.00	0.00
1,792	301115	建科股份	100	1,790.00	0.00
1,793	601512	中新集团	200	1,542.00	0.00
1,794	600131	国网信通	100	1,515.00	0.00
1,795	000975	银泰黄金	100	1,500.00	0.00
1,796	600578	京能电力	500	1,480.00	0.00
1,797	605183	确成股份	100	1,463.00	0.00
1,798	301439	泓淋电力	100	1,462.00	0.00
1,799	300071	福石控股	400	1,384.00	0.00
1,800	300218	安利股份	100	1,355.00	0.00
1,801	300214	日科化学	200	1,300.00	0.00
1,802	000027	深圳能源	200	1,290.00	0.00
1,803	603188	亚邦股份	300	1,269.00	0.00
1,804	600073	上海梅林	183	1,246.23	0.00
1,805	002092	中泰化学	200	1,220.00	0.00
1,806	600892	大晟文化	200	1,216.00	0.00
1,807	603055	台华新材	100	1,204.00	0.00
1,808	300590	移为通信	100	1,201.00	0.00
1,809	300221	银禧科技	200	1,200.00	0.00
1,810	000737	北方铜业	200	1,160.00	0.00
1,811	002609	捷顺科技	100	1,142.00	0.00
1,812	603693	江苏新能	100	1,121.00	0.00
1,813	002123	梦网科技	100	1,115.00	0.00
1,814	603506	南都物业	100	1,087.00	0.00
1,815	600858	银座股份	200	1,064.00	0.00
1,816	600748	上实发展	300	1,047.00	0.00
1,817	600379	宝光股份	100	1,005.00	0.00
1,818	300022	吉峰科技	200	986.00	0.00
1,819	002543	万和电气	100	892.00	0.00
1,820	603959	百利科技	100	889.00	0.00
1,821	000558	莱茵体育	300	879.00	0.00

1,822	002659	凯文教育	200	866.00	0.00
1,823	300512	中亚股份	100	841.00	0.00
1,824	600626	申达股份	200	834.00	0.00
1,825	002539	云图控股	100	825.00	0.00
1,826	002274	华昌化工	100	755.00	0.00
1,827	600116	三峡水利	100	753.00	0.00
1,828	000582	北部湾港	100	751.00	0.00
1,829	603889	新澳股份	100	712.00	0.00
1,830	000700	模塑科技	100	700.00	0.00
1,831	600351	亚宝药业	100	690.00	0.00
1,832	300385	雪浪环境	100	672.00	0.00
1,833	600731	湖南海利	100	657.00	0.00
1,834	600186	莲花健康	100	605.00	0.00
1,835	300317	珈伟新能	100	509.00	0.00
1,836	600266	城建发展	100	484.00	0.00
1,837	600676	交运股份	100	441.00	0.00
1,838	002562	兄弟科技	100	404.00	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	002273	水晶光电	14,269,584.83	1.93
2	000999	华润三九	12,580,392.86	1.70
3	301153	中科江南	11,874,639.00	1.60
4	300701	森霸传感	11,832,690.44	1.60
5	603060	国检集团	11,646,999.39	1.57
6	300015	爱尔眼科	11,613,359.04	1.57
7	300003	乐普医疗	11,402,233.00	1.54
8	603688	石英股份	11,265,789.00	1.52
9	300207	欣旺达	11,167,250.00	1.51
10	300138	晨光生物	11,162,233.10	1.51
11	000887	中鼎股份	10,992,438.10	1.48
12	300136	信维通信	10,917,683.88	1.47
13	600284	浦东建设	10,866,579.77	1.47
14	600526	菲达环保	10,782,422.30	1.46
15	603369	今世缘	10,674,668.00	1.44
16	000063	中兴通讯	10,527,384.36	1.42
17	002353	杰瑞股份	10,461,822.00	1.41
18	002152	广电运通	10,441,619.00	1.41
19	603019	中科曙光	10,277,337.00	1.39
20	301268	铭利达	10,201,491.16	1.38

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	002273	水晶光电	14,028,123.01	1.89
2	000999	华润三九	12,207,314.94	1.65
3	300701	森霸传感	11,982,769.62	1.62
4	301153	中科江南	11,641,370.00	1.57
5	603060	国检集团	11,516,543.74	1.55
6	300138	晨光生物	11,381,213.70	1.54
7	000887	中鼎股份	11,277,819.57	1.52
8	300136	信维通信	11,122,419.00	1.50
9	600284	浦东建设	10,887,919.84	1.47
10	603019	中科曙光	10,777,248.20	1.45
11	300015	爱尔眼科	10,727,607.52	1.45
12	600971	恒源煤电	10,559,874.80	1.43
13	000738	航发控制	10,535,359.50	1.42
14	603688	石英股份	10,527,230.70	1.42
15	002152	广电运通	10,498,016.00	1.42
16	300003	乐普医疗	10,478,782.00	1.41
17	603369	今世缘	10,349,315.20	1.40
18	600526	菲达环保	10,280,808.22	1.39
19	000063	中兴通讯	10,277,494.29	1.39
20	300207	欣旺达	10,221,793.00	1.38

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	9,030,397,095.32
卖出股票收入（成交）总额	9,195,587,923.34

注：卖出股票收入（成交）总额中扣除了增值税的影响

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

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

9	其他	-	-
10	合计	-	-

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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

金额单位：人民币元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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

金额单位：人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-	-

注：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

本集合计划将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

无。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,642,637.03
2	应收清算款	14,271,522.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	116,092.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	16,030,252.02

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
-	-	-	-	-

注：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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
国海量化优选一年持有股票 A	137	165,556.57	3,987,792.94	17.58	18,693,456.47	82.42
国海量化优选一年持有股票 C	8,694	36,724.91	23,009,674.23	7.21	296,276,728.53	92.79
合计	8,831	38,723.55	26,997,467.17	7.89	314,970,185.00	92.11

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	国海量化优选一年持有股票 A	500,196.12	2.21
	国海量化优选一年持有股票 C	5,618,618.24	1.76
	合计	6,118,814.36	1.79

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国海量化优选一年持有股票 A	-
	国海量化优选一年持有股票 C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国海量化优选一年持有股票 A	-
	国海量化优选一年持有股票 C	0~10
	合计	0~10

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间 (万份)

-	公募基金	-
	私募资产管理计划	-
	合计	-

注：本基金的基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国海量化优选一年持有股票 A	国海量化优选一年持有股票 C
基金合同生效日 (2021 年 8 月 23 日) 基金份额总额	61,870,332.78	-
本报告期期初基金份额总额	29,481,316.46	412,118,808.63
本报告期基金总申购份额	-	64,446,266.17
减：本报告期基金总赎回份额	6,800,067.05	157,278,672.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,681,249.41	319,286,402.76

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人重大人事变动下：

- 2023 年 12 月 28 日，卢凯先生因个人原因辞去公司总裁职务。
- 2023 年 12 月 29 日，公司召开第九届董事会第二十次会议，指定度万中先生代为履行总裁职责，度万中先生自 2023 年 12 月 29 日起代为履行总裁职责；聘任郎蒙先生为公司副总裁，郎蒙先生自 2023 年 12 月 29 日起正式履行副总裁职责。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给上会会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 40,000.00 元人民币。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

注：本报告期内，管理人及其高级管理人员未因资产管理业务受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-
采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-
措施 2	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	-
受到稽查或处罚等措施的时间	-

采取稽查或处罚等措施的机构	-
受到的具体措施类型	-
受到稽查或处罚等措施的原因	-
托管人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	-
其他	-

注：本报告期内，托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国海证券	2	18,227,556,144.31	100.00	6,095,493.02	100.00	-

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 (%)
国海证券	-	-	-	-	-	-

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	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 1 月 28 日
2	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 1 月 28 日
3	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 14 日
4	国海证券股份有限公司关于旗下部分集合资产管理计划增加盈米基金销售有限公司为代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 2 月 27 日

5	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 3 月 31 日
6	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2022 年年度报告	中国证监会规定网站	2023 年 3 月 31 日
7	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 4 月 21 日
8	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 4 月 21 日
9	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 5 月 12 日
10	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年第二季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 7 月 21 日
11	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2023 年第 2 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 7 月 21 日
12	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 8 月 15 日
13	国海证券股份有限公司关于增加广州银行股份有限公司为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 8 月 30 日
14	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 8 月 31 日
15	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2023 年中期报告	中国证监会规定网站	2023 年 8 月 31 日
16	国海证券股份有限公司关于增加雪球基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 9 月 13 日
17	国海证券股份有限公司关于增加海通期货股份有限公司为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 9 月 15 日

18	国海证券股份有限公司关于旗下参照公募基金管理运作的集合资产管理计划 2023 年第三季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2023 年 10 月 25 日
19	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2023 年第 3 季度报告	中国证监会规定网站	2023 年 10 月 25 日
20	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额）投资业务公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 11 月 15 日
21	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书更新	中国证监会规定网站	2023 年 11 月 22 日
22	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划（国海量化优选一年持有股票 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2023 年 11 月 22 日
23	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划（国海量化优选一年持有股票 A 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2023 年 11 月 22 日
24	国海证券股份有限公司关于增加上海利得基金为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2023 年 11 月 24 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
-							

注：本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划托管协议；
- 4、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

13.2 存放地点

上海市黄浦区中山南路 988 号绿地外滩中心 C1 栋国海证券大厦 9 层

13.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的办公场所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95563

公司网址：<http://www.ghzq.com.cn>

国海证券股份有限公司

2024 年 3 月 29 日