

国海证券量化优选一年持有期股票型集合 资产管理计划 2024 年年度报告

2024 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：2025 年 03 月 31 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 2025 年 3 月 11 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 2024 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	7
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	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	15
§ 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	23
§ 8 投资组合报告	69

8.1 期末基金资产组合情况	69
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	69
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	70
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	102
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	105
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	106
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	106
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	106
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	106
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	106
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	106
8.14 投资组合报告附注	107
§ 9 基金份额持有人信息	108
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	108
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	108
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	108
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	109
§ 10 开放式基金份额变动	109
§ 11 重大事件揭示	109
11.1 基金份额持有人大会决议	109
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	109
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	110
11.4 基金投资策略的改变	110
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	110
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	110
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	111
11.8 其他重大事件	111
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	114
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	114
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	114
§ 13 备查文件目录	114
13.1 备查文件目录	114
13.2 存放地点	114
13.3 查阅方式	115

§ 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	206,933,229.74 份	
基金合同存续期	不超过 2025 年 2 月 21 日	
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	17,004,987.32 份	189,928,242.42 份

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	廖林

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	2024 年		2023 年		2022 年	
	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	96,710.42	- 7,236,225 .30	902,639.2 4	16,309,07 8.89	- 2,225,863 .44	- 11,836,45 0.20
本期利润	- 11,341.99	901,750.1 4	1,031,288 .25	16,640,66 6.24	- 2,529,138 .73	- 26,558,35 7.14

加权平均 基金份额 本期利润	-0.0006	0.0033	0.0416	0.0468	-0.0608	-0.0627
本期加权 平均净值 利润率	-0.04%	0.21%	2.36%	2.66%	-3.57%	-3.68%
本期基金 份额净值 增长率	2.53%	2.53%	1.36%	1.36%	-3.89%	-3.94%
3.1.2 期 末数据和 指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供 分配利润	12,022,85 7.84	133,830,1 73.48	14,782,35 0.63	207,356,3 21.37	18,296,44 4.25	254,834,6 81.51
期末可供 分配基金 份额利润	0.7070	0.7046	0.6517	0.6494	0.6206	0.6184
期末基金 资产净值	29,690,99 6.71	331,206,9 01.23	38,623,28 6.64	543,027,8 96.21	49,530,59 4.81	691,495,4 50.37
期末基金 份额净值	1.7460	1.7439	1.7029	1.7008	1.6801	1.6779
3.1.3 累 计期末指 标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额 累计净值 增长率	2.94%	2.81%	0.40%	0.27%	-0.95%	-1.08%

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）。

4、本基金于 2021 年 8 月 23 日（基金合同生效日）确认赎回份额 6,248,348.38 份，所确认份额的申请日为 2021 年 8 月 20 日，该部分份额变动视为本报告期的份额变动。

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

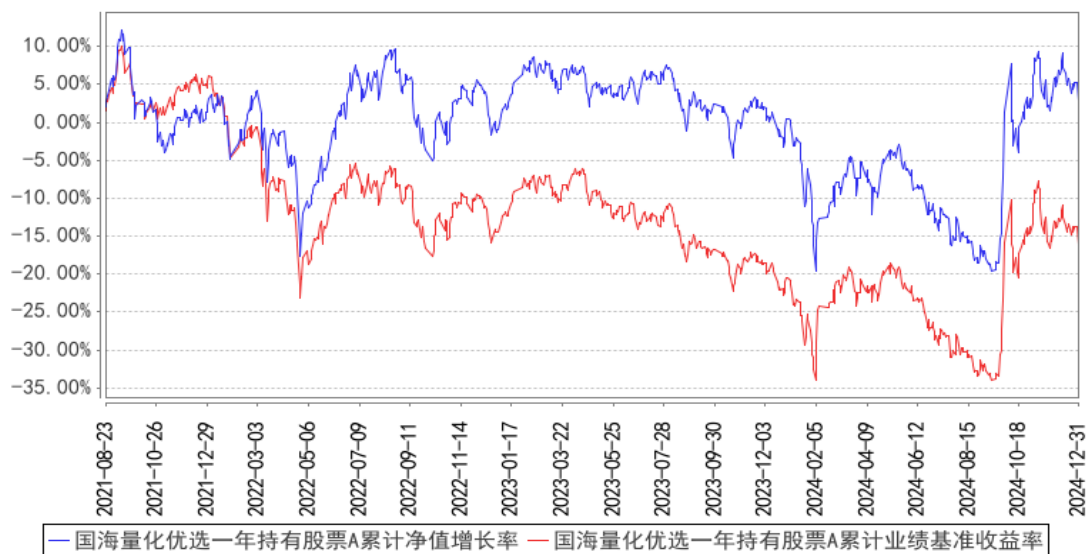
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	1.55%	1.86%	-0.23%	1.93%	1.78%	-0.07%
过去六个月	16.59%	1.83%	15.13%	1.91%	1.46%	-0.08%
过去一年	2.53%	1.67%	5.40%	1.73%	-2.87%	-0.06%
过去三年	-0.12%	1.32%	-20.91%	1.33%	20.79%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	2.94%	1.29%	-16.12%	1.29%	19.06%	0.00%

国海量化优选一年持有股票 C

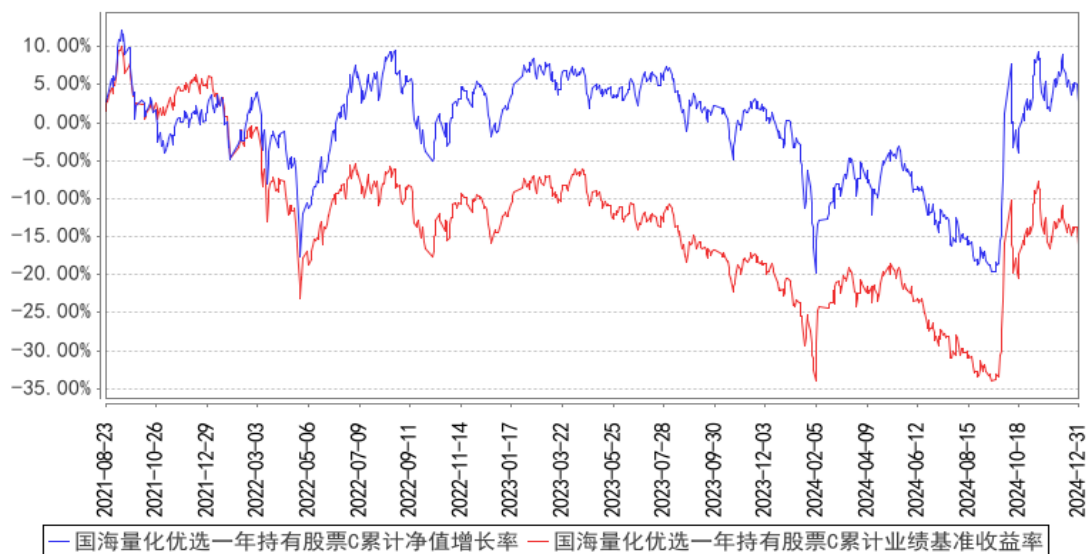
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①－③	②－④
过去三个月	1.55%	1.86%	-0.23%	1.93%	1.78%	-0.07%
过去六个月	16.59%	1.83%	15.13%	1.91%	1.46%	-0.08%
过去一年	2.53%	1.67%	5.40%	1.73%	-2.87%	-0.06%
过去三年	-0.17%	1.32%	-20.91%	1.33%	20.74%	-0.01%
自基金合同生效 起至今	2.81%	1.30%	-16.12%	1.29%	18.93%	0.01%

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

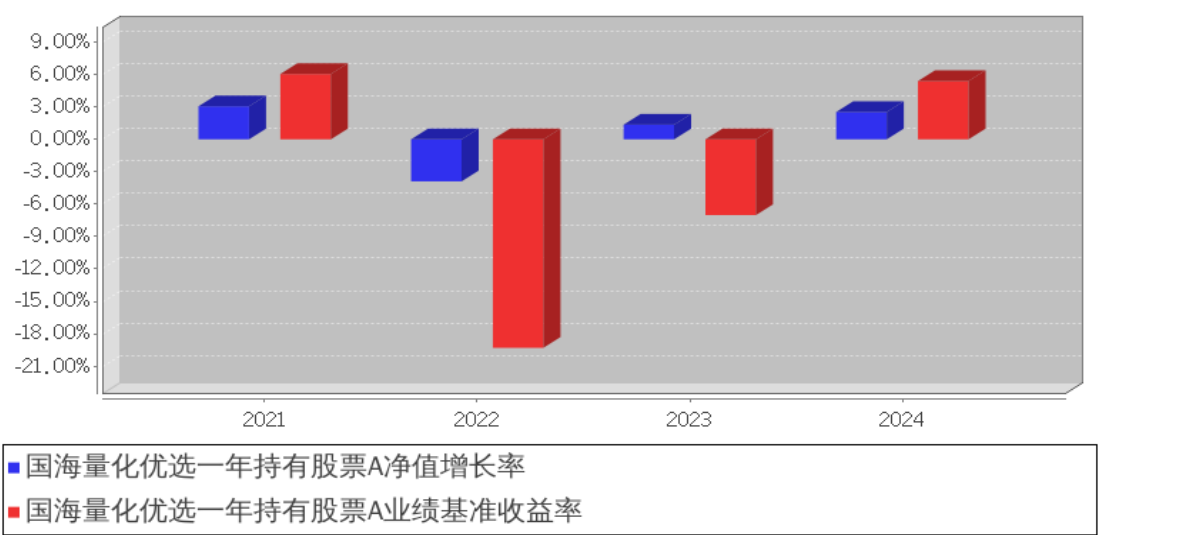


国海量化优选一年持有股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

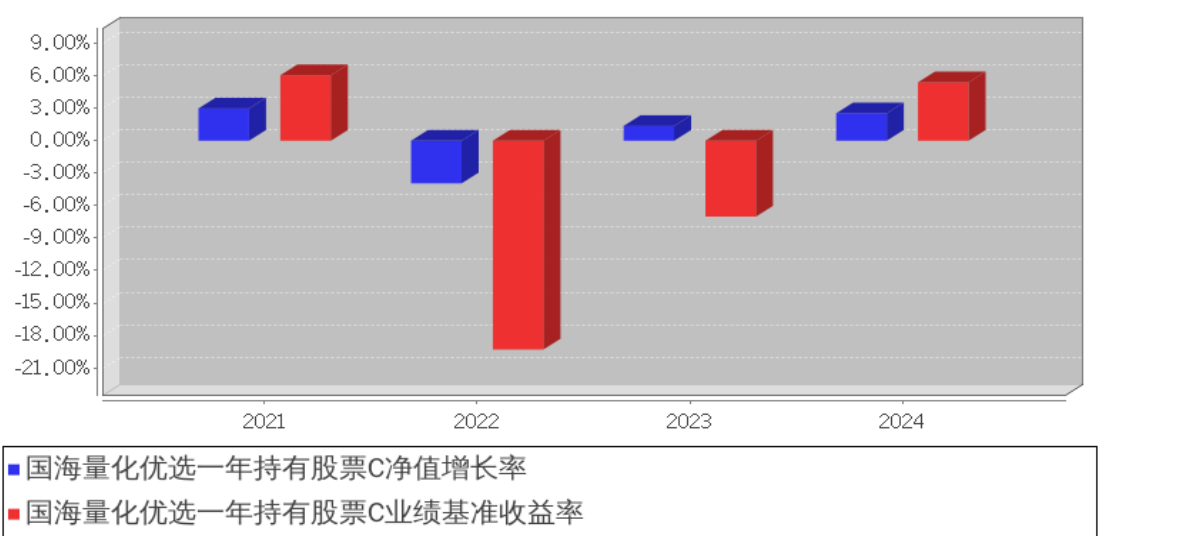


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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（ 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日）
—	—
其他指标	报告期末（2024 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
第 10 页 共 115 页

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
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 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
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 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 2024 年 12 月末，公司在全国 22 个省级区域设有 31 家分公司、88 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有限公司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。

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，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”，其中“国海六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”已于 2024 年 12 月 10 日完成终止清算。

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	-	7	石雨萌先生，墨尔本大学信息技术硕士，7 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合规守信情况的说明

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

2024 年，国内经济呈现“渐进修复”特征。制造业 PMI 前三季度波动回升，四季度稳居荣枯线上方。需求端消费持续回暖，政策端持续松绑以提振信心，特别是 9 月底相关会议的定调，给市场提振了信心。

海外方面，国际地缘政治环境日趋复杂，美联储上半年维持高利率，9 月开启降息通道，而未来目标利率仍存在较大博弈的空间；叠加全球“选举年”政局动荡及地缘冲突，全球权益市场不确定性显著增加。

市场方面，A 股全年走势波折，风格分化显著。一季度市场 V 型反弹，中小市值板块经历极端调整后，成长类资产弹性凸显。二季度 A 股市场流动性逐步衰减，持续下行，高股息风格相对表现强势，价值风格占优。三季度市场先抑后扬，政策密集发力驱动 9 月末强势反转，流动性改善对冲基本面扰动。而时至四季度，政策加码下震荡上行，制造业 PMI 连续扩张，市场信心逐步修复。

产品运作方面，2024 年量化策略的超额收益受到较大的冲击，在 2 月份极端行情下量化超额出现较大幅度的回撤；而全年来看，在 4 月、9 月均出现了市场风格的急剧切换，给量化选股策略带来了很大的挑战。但整体而言，量化策略中长期的有效性并未发生本质变化，我们也将持续优化 alpha 模型及风险控制措施，努力提升超额收益的风险收益比。

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 1.7460 元，本报告期基金 A 类份额净值增长率为 2.53%；C 类份额基金份额净值为 1.7439 元，本报告期份额净值增长率为 2.53%，同期业绩比较基准收益率为 5.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年末中央经济工作会议定调“适度宽松的货币政策”，同时将实施“更加积极的财政政策”给 2025 年的整体政策环境定下基调。在政策加力托底的前提下，市场预期 2025 年宏观经济有望持续复苏。而海外方面的压力主要来自于美国特朗普政府上台后的关税政策，以及地缘政治格局的变动。

市场方面，我们认为国内宏观政策转向带来的市场信心修复仍然是 A 股市场较强的驱动力量，市场成交量有望维持在高位，因此我们对后续量化选股策略的表现维持谨慎乐观的态度。

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 2024 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(2025)第 2030 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 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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。
强调事项	—
其他事项	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。
其他信息	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 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理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。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误

任	导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： 1、识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 2、了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 3、评价管理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。 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，就可能导致对国海量化优选一年持有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股票型集合计划不能持续经营。 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。 我们与管理人就国海量化优选一年持有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。	
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	张健	黄雨帅
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	2025 年 3 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股票型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	7.4.7.1	30,735,326.28	36,446,807.69
结算备付金		11,414,393.45	4,916,042.33
存出保证金		1,892,283.68	1,642,637.03
交易性金融资产	7.4.7.2	322,290,014.98	539,200,393.92
其中：股票投资		322,290,014.98	539,200,393.92
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
应收股利		-	-
应收申购款		25,674.32	116,092.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		366,357,692.71	596,593,495.96
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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		4,361,868.07	13,782,569.96
应付赎回款		265,028.92	142,747.71
应付管理人报酬		324,182.53	497,037.12
应付托管费		32,417.91	49,703.16
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		24,677.75	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	451,619.59	470,255.16

负债合计		5,459,794.77	14,942,313.11
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	206,933,229.74	341,967,652.17
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	153,964,668.20	239,683,530.68
净资产合计		360,897,897.94	581,651,182.85
负债和净资产总计		366,357,692.71	596,593,495.96

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 206,933,229.74 份，资产总净值（暂估业绩报酬前）360,897,897.94 元。其中 A 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7460 元，集合计划份额总额 17,004,987.32 份，资产净值（暂估业绩报酬前）29,690,996.71 元，相关暂估业绩报酬余额 157,746.66 元，资产净值（暂估业绩报酬后）29,533,250.05 元；C 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7439 元，集合计划份额总额 189,928,242.42 份，资产净值（暂估业绩报酬前）331,206,901.23 元，相关暂估业绩报酬 117,306.23 元，资产净值（暂估业绩报酬后）331,089,595.00 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（同资产管理合同定义）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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,189,506.17	25,812,293.05
1. 利息收入		307,432.90	308,657.74
其中：存款利息收入	7.4.7.13	306,005.19	308,657.74
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		1,427.71	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,147,849.76	25,043,398.95

其中：股票投资收益	7.4.7.14	-12,132,111.56	15,602,209.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	1,616,488.42	-544,251.75
股利收益	7.4.7.19	8,367,773.38	9,985,441.49
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	8,029,923.03	460,236.36
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		5,299,098.02	8,140,338.56
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,677,012.13	7,112,948.64
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	464,532.72	670,515.46
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		2,649.19	189,444.65
8. 其他费用	7.4.7.23	154,903.98	167,429.81
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		890,408.15	17,671,954.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		890,408.15	17,671,954.49
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		890,408.15	17,671,954.49

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	341,967,652.17	-	239,683,530.68	581,651,182.85
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	341,967,652.17	-	239,683,530.68	581,651,182.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	- 135,034,422.43	-	-85,718,862.48	-220,753,284.91
(一)、综合收益总额	-	-	890,408.15	890,408.15
(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)	- 135,034,422.43	-	-86,609,270.63	-221,643,693.06
其中：1. 基金申购款	4,613,769.40	-	2,536,477.75	7,150,247.15
2. 基金赎回款	- 139,648,191.83	-	-89,145,748.38	-228,793,940.21
(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	206,933,229.74	-	153,964,668.20	360,897,897.94
项目	上年度可比期间 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

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”）、中国证券投资基金业协会颁

布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制，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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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

注： 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

注：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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

注：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

注：（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

注：（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业务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业务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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：（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

注：（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

注：（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

注：无。

7.4.4.13 分部报告

注：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

注：根据本集合计划的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本集合计划确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

注：无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

注：无。

7.4.5.3 差错更正的说明

注：无。

7.4.6 税项

注：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》、中华人民共和国主席令（第五十一号）公布的《中华人民共和国城市维护建设税法》、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。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	30,735,326.28	36,446,807.69
等于：本金	30,732,344.72	36,442,935.60
加：应计利息	2,981.56	3,872.09
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	30,735,326.28	36,446,807.69

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		327,640,081.45	-	322,290,014.98	-5,350,066.47
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		327,640,081.45	-	322,290,014.98	-5,350,066.47
项目		上年度末 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

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 2024 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	14,566,360.00	-	-	-
其中： 股指期货投资	14,566,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	14,566,360.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义	公允价值		备注

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

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
IC2503	中证 500 股指期货 2503	13.00	14,756,040.00	189,680.00
合计				189,680.00
减：可抵销期货暂收款				189,680.00
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
----	-----

	2024 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 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	-	-

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 2024 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					-	-	-
项目	上年度末 2023 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 2024 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 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		-	-	-	-	-

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	-	-	-	-

7.4.7.6 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 2024 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 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		-	-	-	-	-	-

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 2024 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 2023 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 2024 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 2023 年 12 月 31 日					
	指定为以公	本期确认的	累计利得	累计损失	其他综合收	其他综合

	允价值计量 且其变动计 入其他综合 收益的原因	股利收入			益转入留存 收益的金额	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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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	303,619.59	310,255.16
其中：交易所市场	303,619.59	310,255.16
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	148,000.00	160,000.00
合计	451,619.59	470,255.16

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,681,249.41	22,681,249.41
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-5,676,262.09	-5,676,262.09
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	17,004,987.32	17,004,987.32

国海量化优选一年持有股票 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	319,286,402.76	319,286,402.76
本期申购	4,613,769.40	4,613,769.40
本期赎回（以“-”号填列）	-133,971,929.74	-133,971,929.74
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	189,928,242.42	189,928,242.42

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	14,782,350.63	1,159,686.60	15,942,037.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,782,350.63	1,159,686.60	15,942,037.23
本期利润	96,710.42	-108,052.41	-11,341.99
本期基金份额交易产生的变动数	-2,856,203.21	-388,482.64	-3,244,685.85
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2,856,203.21	-388,482.64	-3,244,685.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,022,857.84	663,151.55	12,686,009.39

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	207,356,321.37	16,385,172.08	223,741,493.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	207,356,321.37	16,385,172.08	223,741,493.45
本期利润	-7,236,225.30	8,137,975.44	901,750.14
本期基金份额交易产生的变动数	-66,289,922.59	-17,074,662.19	-83,364,584.78
其中：基金申购款	2,217,508.36	318,969.39	2,536,477.75
基金赎回款	-68,507,430.95	-17,393,631.58	-85,901,062.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	133,830,173.48	7,448,485.33	141,278,658.81

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	120,089.08	150,597.72
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	183,734.72	155,509.98
其他	2,181.39	2,550.04
合计	306,005.19	308,657.74

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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖 股票差价收入	-12,132,111.56	15,602,209.21
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	-12,132,111.56	15,602,209.21

注：卖出股票成交总额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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出股票成交总 额	8,588,599,345.12	9,195,587,923.34
减：卖出股票成本 总额	8,589,485,528.86	9,164,293,662.53
减：交易费用	11,245,927.82	15,692,051.60
买卖股票差价收 入	-12,132,111.56	15,602,209.21

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 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	1,616,488.42	-544,251.75

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	8,367,773.38	9,985,441.49
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	8,367,773.38	9,985,441.49

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	7,227,323.03	548,516.36
股票投资	7,227,323.03	548,516.36
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	802,600.00	-88,280.00
权证投资	-	-
期货投资	802,600.00	-88,280.00
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	8,029,923.03	460,236.36

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
-	-	-
合计	-	-

7.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	28,000.00	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	6,903.98	7,429.81
合计	154,903.98	167,429.81

7.4.7.24 分部报告

注：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（“国海证券”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行股份有限公司”）	基金托管人
广西投资集团有限公司	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（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）（2024 年 8 月 9 日注销）	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
济南市国海云创创业投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

无。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	16,953,920,586.49	100.00	18,227,556,144.31	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	10,000,000.00	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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（%）
-	-	-	-	-

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 2024年1月1日至2024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	5,864,357.07	100.00	303,619.59	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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
------	--------------	--------	------------	--------

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,677,012.13	7,112,948.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,913,450.33	2,737,148.94
应支付基金管理人的净管理费	2,763,561.80	4,375,799.70

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 4,645,328.21 元，管理人业绩报酬 31,683.92 元。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	464,532.72	670,515.46

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 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	-	-	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 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
-	-	-	-	-	-	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 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
-	-	-	-	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 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
-	-	-	-	-	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	1,131,926.77	12,425,702.16
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	-	7,100,000.00
报告期末持有的基金份额	1,131,926.77	5,325,702.16
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.66%	2.80%

项目	上年度可比期间 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%

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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	30,735,326.28	120,089.08	36,446,807.69	150,597.72

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 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
-	-	-	-	-	-

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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（2024 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2025 年 1 月 2 日	重大事项停牌	7.22	-	-	16,300	119,133.51	117,686.00	-

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

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。

7.4.13.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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	上年度末
--------	-----	------

	2024 年 12 月 31 日	2023 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 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 2024 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 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	-	-	-	-

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 2024 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	30,735,326.28	-	-	-	30,735,326.28
结算备付金	11,414,393.45	-	-	-	11,414,393.45
存出保证金	1,892,283.68	-	-	-	1,892,283.68
交易性金融资产	-	-	-	322,290,014.98	322,290,014.98
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	-	-	-	25,674.32	25,674.32
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	44,042,003.41	-	-	322,315,689.30	366,357,692.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	265,028.92	265,028.92
应付管理人报酬	-	-	-	324,182.53	324,182.53
应付托管费	-	-	-	32,417.91	32,417.91
应付清算款	-	-	-	4,361,868.07	4,361,868.07
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	-	-	-	24,677.75	24,677.75
其他负债	-	-	-	451,619.59	451,619.59
负债总计	-	-	-	5,459,794.77	5,459,794.77
利率敏感度缺口	44,042,003.41	-	-	-316,855,894.53	360,897,897.94
上年度末 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

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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 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 2024 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
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 外汇风险敞口净额	-	-	-	-

项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
货币资金	-	-	-	-
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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	322,290,014.98	89.30	539,200,393.92	92.70
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	322,290,014.98	89.30	539,200,393.92	92.70

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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 5%	16,875,265.77	27,887,896.29
	业绩比较基准下降 5%	-16,875,265.77	-27,887,896.29

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 (2024 年 12 月 31 日)	上年度末 (2023 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	322,172,328.98	539,020,345.92
第二层次	117,686.00	180,048.00
第三层次	-	-
合计	322,290,014.98	539,200,393.92

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 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	-	-	-

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 2024 年 12 月 31 日，集合计划份额总额 206,933,229.74 份，资产总净值（暂估业绩报酬前）360,897,897.94 元。其中 A 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7460 元，集合计划份额总额 17,004,987.32 份，资产净值（暂估业绩报酬前）29,690,996.71 元，相关暂估业绩报酬余额 157,746.66 元，资产净值（暂估业绩报酬后）29,533,250.05 元；C 类集合计划份额净值（暂估业绩报酬前）1.7439 元，集合计划份额总额 189,928,242.42 份，资产净值（暂估业绩报酬前）331,206,901.23 元，相关暂估业绩报酬 117,306.23 元，资产净值（暂估业绩报酬后）

331,089,595.00 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(同资产管理合同定义)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	322,290,014.98	87.97
	其中:股票	322,290,014.98	87.97
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	42,149,719.73	11.51
-	-	-	-
8	其他各项资产	1,917,958.00	0.52
9	合计	366,357,692.71	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	1,359,888.36	0.38
B	采矿业	16,477,887.98	4.57
C	制造业	197,342,888.37	54.68
D	电力、热力、燃气及水生产和	14,321,254.50	3.97

	供应业		
E	建筑业	8,712,362.89	2.41
F	批发和零售业	7,383,336.32	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	10,336,029.60	2.86
H	住宿和餐饮业	284,224.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,476,506.50	5.67
J	金融业	27,571,687.41	7.64
K	房地产业	6,026,915.10	1.67
L	租赁和商务服务业	1,102,294.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	3,553,592.65	0.98
N	水利、环境和公共设施管理业	3,649,047.30	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	97,920.00	0.03
Q	卫生和社会工作	670,745.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,675,004.00	0.46
S	综合	1,248,431.00	0.35
	合计	322,290,014.98	89.30

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（%）
-	-	-
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	600418	江淮汽车	69,200	2,595,000.00	0.72
2	601058	赛轮轮胎	146,600	2,100,778.00	0.58
3	601077	渝农商行	318,500	1,926,925.00	0.53
4	601555	东吴证券	239,759	1,870,120.20	0.52
5	300207	欣旺达	80,100	1,787,031.00	0.50
6	600066	宇通客车	66,200	1,746,356.00	0.48
7	002028	思源电气	23,400	1,701,180.00	0.47
8	002273	水晶光电	75,400	1,675,388.00	0.46
9	002202	金风科技	159,219	1,644,732.27	0.46
10	601168	西部矿业	98,269	1,579,182.83	0.44
11	300002	神州泰岳	133,600	1,548,424.00	0.43
12	002532	天山铝业	189,300	1,489,791.00	0.41
13	000423	东阿阿胶	23,500	1,473,920.00	0.41
14	601128	常熟银行	194,285	1,470,737.45	0.41
15	002128	电投能源	73,100	1,431,298.00	0.40

16	688099	晶晨半导体	20,478	1,406,429.04	0.39
17	600352	浙江龙盛	130,400	1,341,816.00	0.37
18	002444	巨星科技	40,878	1,322,403.30	0.37
19	688213	思特威电子科技	16,949	1,317,276.28	0.36
20	002353	杰瑞股份	35,500	1,313,145.00	0.36
21	000933	神火股份	72,800	1,230,320.00	0.34
22	603606	东方电缆	23,300	1,224,415.00	0.34
23	000039	中集集团	154,960	1,204,039.20	0.33
24	600521	华海药业	66,922	1,195,896.14	0.33
25	600141	兴发集团	54,800	1,189,160.00	0.33
26	603338	浙江鼎力	17,900	1,154,908.00	0.32
27	601179	中国西电	152,000	1,153,680.00	0.32
28	600563	法拉电子	9,700	1,153,524.00	0.32
29	000400	许继电气	41,500	1,142,495.00	0.32
30	300054	鼎龙股份	43,300	1,126,666.00	0.31
31	603893	瑞芯微	10,200	1,122,612.00	0.31
32	000988	华工科技	25,900	1,121,470.00	0.31
33	002850	科达利	11,400	1,113,552.00	0.31
34	600096	云天化	49,600	1,106,080.00	0.31
35	601997	贵阳银行	183,200	1,099,200.00	0.30
36	301236	软通动力	18,700	1,097,877.00	0.30
37	601717	郑煤机	84,300	1,094,214.00	0.30
38	601696	中银证券	97,644	1,089,707.04	0.30
39	000683	远兴能源	188,300	1,052,597.00	0.29
40	600021	上海电力	114,400	1,049,048.00	0.29
41	000009	中国宝安	114,200	1,044,930.00	0.29
42	600968	海油发展	244,100	1,042,307.00	0.29
43	002595	豪迈科技	20,700	1,038,933.00	0.29
44	600298	安琪酵母	28,700	1,034,635.00	0.29
45	000883	湖北能源	206,700	1,029,366.00	0.29
46	600583	海油工程	186,600	1,020,702.00	0.28
47	603179	新泉股份	23,900	1,020,530.00	0.28
48	600546	山煤国际	85,000	1,005,550.00	0.28
49	601156	东航物流	59,200	998,704.00	0.28
50	000050	深天马 A	108,200	977,046.00	0.27
51	600985	淮北矿业	69,400	976,458.00	0.27
52	002138	顺络电子	30,700	966,436.00	0.27
53	600637	东方明珠	123,200	956,032.00	0.26
54	300763	锦浪科技	15,600	952,692.00	0.26
55	002958	青农商行	313,000	951,520.00	0.26
56	300037	新宙邦	25,400	950,976.00	0.26
57	600170	上海建工	358,665	950,462.25	0.26
58	300677	英科医疗	37,300	942,944.00	0.26

59	002385	大北农	217,300	940,909.00	0.26
60	600863	内蒙华电	215,600	933,548.00	0.26
61	601665	齐鲁银行	165,800	926,822.00	0.26
62	002831	裕同科技	34,000	921,400.00	0.26
63	300866	安克创新	9,388	916,644.32	0.25
64	000960	锡业股份	65,000	911,950.00	0.25
65	688188	上海柏楚电子科技	4,662	905,593.50	0.25
66	603979	金诚信	24,900	903,870.00	0.25
67	601966	玲珑轮胎	49,900	900,196.00	0.25
68	000623	吉林敖东	51,800	894,586.00	0.25
69	600079	人福医药	38,000	888,440.00	0.25
70	600879	航天电子	98,300	880,768.00	0.24
71	600970	中材国际	92,385	875,809.80	0.24
72	600827	百联股份	79,000	863,470.00	0.24
73	000878	云南铜业	70,200	855,738.00	0.24
74	000830	鲁西化工	73,000	853,370.00	0.24
75	600282	南钢股份	179,780	843,168.20	0.23
76	600885	宏发股份	26,300	836,866.00	0.23
77	600529	山东药玻	32,400	834,948.00	0.23
78	001286	C 陕西能	89,000	825,920.00	0.23
79	002508	老板电器	38,500	825,055.00	0.23
80	002368	太极股份	34,800	824,064.00	0.23
81	002507	涪陵榨菜	58,090	820,811.70	0.23
82	000401	冀东水泥	155,301	812,224.23	0.23
83	000060	中金岭南	172,350	808,321.50	0.22
84	002120	韵达股份	107,200	806,144.00	0.22
85	600008	首创环保	245,000	803,600.00	0.22
86	002281	光迅科技	15,300	798,201.00	0.22
87	601991	大唐发电	279,700	797,145.00	0.22
88	300394	天孚通信	8,620	787,523.20	0.22
89	603658	安图生物	17,810	777,228.40	0.22
90	300601	康泰生物	45,280	776,552.00	0.22
91	600299	安迪苏	61,300	769,315.00	0.21
92	600095	湘财股份	104,700	753,840.00	0.21
93	688005	容百科技	23,891	753,761.05	0.21
94	001227	兰州银行	306,300	753,498.00	0.21
95	688617	惠泰医疗	1,994	742,426.02	0.21
96	601399	国机重装	236,700	729,036.00	0.20
97	603317	天味食品	54,500	727,030.00	0.20
98	300285	国瓷材料	41,800	712,272.00	0.20
99	002797	第一创业	85,000	709,750.00	0.20
100	600820	隧道股份	98,600	708,934.00	0.20
101	688122	XD 西部超导	16,502	706,615.64	0.20

102	600739	辽宁成大	67,800	701,730.00	0.19
103	603298	杭叉集团	39,200	701,288.00	0.19
104	002266	浙富控股	223,900	698,568.00	0.19
105	002019	亿帆医药	64,500	691,440.00	0.19
106	002625	光启技术	14,200	678,760.00	0.19
107	601992	金隅集团	378,900	674,442.00	0.19
108	688200	华峰测控	6,411	669,949.50	0.19
109	601216	君正集团	127,200	669,072.00	0.19
110	300373	扬杰科技	15,200	661,504.00	0.18
111	000729	燕京啤酒	54,600	657,384.00	0.18
112	601456	国联证券	48,000	648,960.00	0.18
113	002064	华峰化学	79,300	648,674.00	0.18
114	603218	日月股份	52,400	631,420.00	0.17
115	688538	和辉光电	267,400	620,368.00	0.17
116	000031	大悦城	204,000	620,160.00	0.17
117	688120	华海清科	3,800	619,362.00	0.17
118	600928	西安银行	169,445	611,696.45	0.17
119	600959	江苏有线	182,300	610,705.00	0.17
120	002984	森麒麟	24,240	597,758.40	0.17
121	603087	甘李药业	13,390	590,499.00	0.16
122	600995	南网储能	58,200	588,984.00	0.16
123	601567	三星医疗	19,100	587,516.00	0.16
124	688169	石头科技	2,677	587,039.33	0.16
125	002557	洽洽食品	19,700	572,285.00	0.16
126	688349	三一重能	18,319	565,690.72	0.16
127	603568	伟明环保	25,630	554,376.90	0.15
128	601233	桐昆股份	46,800	552,240.00	0.15
129	600339	中油工程	149,000	533,420.00	0.15
130	002226	江南化工	96,400	522,488.00	0.14
131	600369	西南证券	111,800	522,106.00	0.14
132	002409	雅克科技	9,000	521,550.00	0.14
133	600848	上海临港	51,600	521,160.00	0.14
134	600704	物产中大	101,800	515,108.00	0.14
135	002432	九安医疗	12,500	509,750.00	0.14
136	600399	抚顺特钢	87,600	508,080.00	0.14
137	603596	伯特利	11,240	501,191.60	0.14
138	603160	汇顶科技	6,200	499,348.00	0.14
139	002608	江苏国信	65,100	499,317.00	0.14
140	603517	绝味食品	30,000	493,200.00	0.14
141	600428	中远海特	67,000	489,100.00	0.14
142	000975	银泰黄金	31,700	487,229.00	0.14
143	603098	森特股份	50,700	486,720.00	0.13
144	601877	正泰电器	20,700	484,587.00	0.13

145	600064	南京高科	62,000	481,740.00	0.13
146	002001	新和成	21,900	481,143.00	0.13
147	601918	新集能源	66,700	478,906.00	0.13
148	600812	华北制药	92,400	477,708.00	0.13
149	300433	蓝思科技	21,700	475,230.00	0.13
150	002928	华夏航空	61,200	474,912.00	0.13
151	000415	渤海租赁	123,900	467,103.00	0.13
152	002500	山西证券	73,900	464,092.00	0.13
153	000728	国元证券	55,200	461,472.00	0.13
154	002318	久立特材	19,700	461,177.00	0.13
155	601958	金钼股份	45,100	453,706.00	0.13
156	603939	益丰药房	18,764	452,775.32	0.13
157	600497	驰宏锌锗	79,800	444,486.00	0.12
158	301031	中熔电气	4,200	436,884.00	0.12
159	601666	平煤股份	43,400	434,868.00	0.12
160	300558	贝达药业	8,000	431,440.00	0.12
161	688180	君实生物	15,737	430,092.21	0.12
162	002065	东华软件	59,100	429,066.00	0.12
163	000921	海信家电	14,800	427,720.00	0.12
164	000725	京东方 A	97,200	426,708.00	0.12
165	688234	天岳先进	8,308	425,369.60	0.12
166	600642	申能股份	44,100	418,509.00	0.12
167	600027	华电国际	74,600	418,506.00	0.12
168	002074	国轩高科	19,600	415,912.00	0.12
169	300012	华测检测	33,100	411,433.00	0.11
170	000537	中绿电	44,900	409,488.00	0.11
171	688029	南微医学科技	6,055	409,257.45	0.11
172	002941	新疆交建	35,800	399,886.00	0.11
173	600269	赣粤高速	70,500	395,505.00	0.11
174	600216	浙江医药	24,800	393,328.00	0.11
175	002966	苏州银行	48,370	392,280.70	0.11
176	002384	东山精密	13,400	391,280.00	0.11
177	601965	中国汽研	22,200	391,164.00	0.11
178	000598	兴蓉环境	51,500	390,885.00	0.11
179	000885	城发环境	29,800	390,678.00	0.11
180	600516	方大炭素	79,872	385,781.76	0.11
181	002550	千红制药	62,200	385,640.00	0.11
182	600120	浙江东方	81,600	380,256.00	0.11
183	600109	国金证券	43,000	375,390.00	0.10
184	688107	安路科技	12,537	370,844.46	0.10
185	301165	锐捷网络	5,100	368,220.00	0.10
186	688798	艾为电子	5,186	362,086.52	0.10
187	300888	稳健医疗	8,600	361,888.00	0.10

188	600073	光明肉业	51,600	358,104.00	0.10
189	000425	徐工机械	45,100	357,643.00	0.10
190	600871	石化油服	175,000	357,000.00	0.10
191	600874	创业环保	59,700	356,409.00	0.10
192	600320	振华重工	90,800	355,936.00	0.10
193	002088	鲁阳节能	27,800	355,562.00	0.10
194	000048	京基智农	19,700	354,600.00	0.10
195	601898	中煤能源	29,100	354,438.00	0.10
196	001283	豪鹏科技	6,100	353,129.00	0.10
197	600058	五矿发展	49,500	352,440.00	0.10
198	000672	上峰水泥	46,000	351,900.00	0.10
199	600961	株冶集团	44,700	351,789.00	0.10
200	000685	中山公用	38,000	350,740.00	0.10
201	688526	武汉科前生物	24,410	348,818.90	0.10
202	002746	仙坛股份	54,800	347,432.00	0.10
203	000065	北方国际	35,500	347,190.00	0.10
204	002938	鹏鼎控股	9,500	346,560.00	0.10
205	300674	宇信科技	17,700	345,504.00	0.10
206	600578	京能电力	98,100	345,312.00	0.10
207	300039	上海凯宝	55,800	344,844.00	0.10
208	001289	龙源电力	21,900	344,049.00	0.10
209	603989	艾华集团	22,800	343,824.00	0.10
210	600060	海信视像	17,200	342,968.00	0.10
211	300705	九典制药	19,096	342,773.20	0.09
212	600183	生益科技	14,200	341,510.00	0.09
213	603713	密尔克卫	6,600	337,920.00	0.09
214	002967	广电计量	20,600	337,840.00	0.09
215	002546	新联电子	78,000	337,740.00	0.09
216	688348	昱能科技	6,914	337,403.20	0.09
217	688111	金山办公	1,178	337,367.42	0.09
218	600248	陕建股份	74,990	335,955.20	0.09
219	000997	新大陆	16,800	335,160.00	0.09
220	001380	C 华纬	15,220	333,318.00	0.09
221	600783	鲁信创投	26,100	330,687.00	0.09
222	603129	春风动力	2,100	329,847.00	0.09
223	600801	华新水泥	27,200	329,120.00	0.09
224	601336	新华保险	6,600	328,020.00	0.09
225	002987	京北方	22,900	325,867.00	0.09
226	000528	柳工	27,000	325,620.00	0.09
227	601838	成都银行	19,000	325,090.00	0.09
228	002945	华林证券	21,100	323,463.00	0.09
229	600894	广日股份	22,100	322,660.00	0.09
230	603299	苏盐井神	28,900	321,946.00	0.09

231	600323	瀚蓝环境	13,600	321,232.00	0.09
232	600674	川投能源	18,600	320,850.00	0.09
233	601808	中海油服	21,000	320,250.00	0.09
234	600486	扬农化工	5,530	320,021.10	0.09
235	688428	诺诚健华	26,054	319,943.12	0.09
236	600872	中炬高新	14,500	319,290.00	0.09
237	000898	鞍钢股份	132,800	318,720.00	0.09
238	600380	健康元	28,265	318,546.55	0.09
239	002601	龙佰集团	18,000	318,060.00	0.09
240	000156	华数传媒	44,100	317,520.00	0.09
241	601001	晋控煤业	23,200	317,144.00	0.09
242	600489	中金黄金	26,300	316,389.00	0.09
243	002142	宁波银行	13,000	316,030.00	0.09
244	600023	浙能电力	55,800	315,828.00	0.09
245	603766	隆鑫通用	34,700	315,770.00	0.09
246	600648	外高桥	26,500	315,615.00	0.09
247	600196	复星医药	12,700	315,595.00	0.09
248	003039	顺控发展	24,100	315,228.00	0.09
249	000786	北新建材	10,400	315,224.00	0.09
250	002705	新宝股份	21,000	315,000.00	0.09
251	600208	衢州发展	106,400	314,944.00	0.09
252	600031	三一重工	19,100	314,768.00	0.09
253	600496	精工钢构	104,200	314,684.00	0.09
254	603439	贵州三力	24,200	314,600.00	0.09
255	601989	中国重工	65,400	314,574.00	0.09
256	600641	万业企业	21,500	314,330.00	0.09
257	002422	科伦药业	10,500	314,265.00	0.09
258	600795	国电电力	68,600	314,188.00	0.09
259	601009	南京银行	29,500	314,175.00	0.09
260	601827	三峰环境	36,600	314,028.00	0.09
261	600219	南山铝业	80,300	313,973.00	0.09
262	600233	圆通速递	22,100	313,599.00	0.09
263	603733	仙鹤股份	15,200	313,576.00	0.09
264	600618	氯碱化工	31,800	313,548.00	0.09
265	002332	仙琚制药	31,500	313,110.00	0.09
266	600048	保利发展	35,300	312,758.00	0.09
267	300498	温氏股份	18,936	312,633.36	0.09
268	000021	深科技	16,400	312,584.00	0.09
269	000876	新希望	34,800	312,504.00	0.09
270	605507	国邦医药	15,000	312,450.00	0.09
271	000761	本钢板材	97,500	312,000.00	0.09
272	603301	振德医疗	14,181	311,840.19	0.09
273	603162	海通发展	33,892	311,806.40	0.09

274	002926	华西证券	37,500	311,625.00	0.09
275	601022	宁波远洋	38,800	311,564.00	0.09
276	603693	江苏新能	31,630	311,555.50	0.09
277	600585	海螺水泥	13,100	311,518.00	0.09
278	601200	上海环境	38,120	311,440.40	0.09
279	002545	东方铁塔	44,300	311,429.00	0.09
280	002004	华邦健康	68,900	311,428.00	0.09
281	601083	锦江航运	32,700	311,304.00	0.09
282	601618	中国中冶	94,300	311,190.00	0.09
283	002399	海普瑞	29,100	311,079.00	0.09
284	002468	申通快递	30,700	310,991.00	0.09
285	600604	市北高新	65,300	310,828.00	0.09
286	300661	圣邦股份	3,800	310,764.00	0.09
287	000498	山东路桥	52,200	310,590.00	0.09
288	603993	洛阳钼业	46,700	310,555.00	0.09
289	600685	中船防务	13,100	310,470.00	0.09
290	601677	明泰铝业	25,800	310,374.00	0.09
291	600547	山东黄金	13,705	310,144.15	0.09
292	002237	恒邦股份	30,700	310,070.00	0.09
293	601211	国泰君安	16,600	309,590.00	0.09
294	000927	中国铁物	117,700	309,551.00	0.09
295	688315	诺禾致源科技	24,760	309,500.00	0.09
296	601311	骆驼股份	37,300	309,217.00	0.09
297	603995	甬金股份	16,900	309,101.00	0.09
298	603612	索通发展	22,800	308,028.00	0.09
299	600999	招商证券	16,060	307,709.60	0.09
300	600988	赤峰黄金	19,700	307,517.00	0.09
301	301015	百洋医药	12,700	307,467.00	0.09
302	603799	华友钴业	10,500	307,230.00	0.09
303	002978	安宁股份	10,800	306,936.00	0.09
304	300080	易成新能	70,200	306,774.00	0.09
305	002249	大洋电机	52,200	306,414.00	0.08
306	601688	华泰证券	17,400	306,066.00	0.08
307	688128	中国电器研究院	14,541	305,506.41	0.08
308	600582	天地科技	49,400	305,292.00	0.08
309	000718	苏宁环球	129,200	304,912.00	0.08
310	002410	广联达	25,900	304,584.00	0.08
311	600633	浙数文化	29,100	304,386.00	0.08
312	688281	华秦科技实业	3,260	303,506.00	0.08
313	002153	石基信息	42,500	303,450.00	0.08
314	002961	瑞达期货	21,100	303,207.00	0.08
315	000807	云铝股份	22,400	303,072.00	0.08
316	300166	东方国信	32,100	301,740.00	0.08

317	002212	天融信	46,700	301,215.00	0.08
318	603093	南华期货	25,300	301,070.00	0.08
319	600958	东方证券	28,500	300,960.00	0.08
320	688326	经纬恒润	3,577	300,825.70	0.08
321	002241	歌尔股份	11,600	299,396.00	0.08
322	603986	兆易创新	2,800	299,040.00	0.08
323	000019	深粮控股	45,400	298,278.00	0.08
324	603106	恒银科技	37,900	298,273.00	0.08
325	000778	新兴铸管	77,100	296,064.00	0.08
326	603337	杰克股份	9,700	295,462.00	0.08
327	603000	人民网	13,400	295,336.00	0.08
328	688409	富创精密	5,700	293,949.00	0.08
329	603501	韦尔股份	2,800	292,348.00	0.08
330	601198	东兴证券	26,500	291,765.00	0.08
331	600517	国网英大	52,900	291,479.00	0.08
332	688550	瑞联新材料	9,314	291,435.06	0.08
333	603618	杭电股份	53,500	290,505.00	0.08
334	603786	科博达	4,700	290,460.00	0.08
335	000559	万向钱潮	47,100	289,665.00	0.08
336	300684	中石科技	12,900	289,347.00	0.08
337	300018	中元股份	42,600	288,402.00	0.08
338	600273	嘉化能源	36,026	287,127.22	0.08
339	000422	湖北宜化	22,700	286,474.00	0.08
340	688082	盛美上海半导体	2,862	286,200.00	0.08
341	603355	莱克电气	12,600	285,390.00	0.08
342	002096	易普力	24,000	285,120.00	0.08
343	605116	奥锐特	13,500	285,120.00	0.08
344	603556	海兴电力	7,700	284,823.00	0.08
345	301267	华夏眼科	14,900	283,696.00	0.08
346	000928	中钢国际	44,500	283,465.00	0.08
347	601689	拓普集团	5,725	280,525.00	0.08
348	002948	青岛银行	72,000	279,360.00	0.08
349	688739	成大生物	10,805	278,552.90	0.08
350	600295	鄂尔多斯	28,500	278,160.00	0.08
351	601088	中国神华	6,300	273,924.00	0.08
352	600266	城建发展	53,600	273,360.00	0.08
353	603533	掌阅科技	13,400	272,154.00	0.08
354	002340	格林美	41,500	270,995.00	0.08
355	688596	正帆科技	7,607	270,428.85	0.07
356	688392	骄成超声波	6,600	269,280.00	0.07
357	688187	时代电气	5,589	267,824.88	0.07
358	600886	国投电力	16,000	265,920.00	0.07
359	605166	聚合顺	22,200	265,734.00	0.07

360	600271	航天信息	29,100	265,101.00	0.07
361	601319	中国人保	34,600	263,652.00	0.07
362	002498	汉缆股份	77,700	263,403.00	0.07
363	601298	青岛港	28,900	263,279.00	0.07
364	300408	三环集团	6,800	261,868.00	0.07
365	002648	卫星化学	13,900	261,181.00	0.07
366	600037	歌华有线	35,000	261,100.00	0.07
367	600875	东方电气	16,400	260,596.00	0.07
368	600926	杭州银行	17,800	260,058.00	0.07
369	600707	彩虹股份	31,600	259,752.00	0.07
370	000977	浪潮信息	5,000	259,400.00	0.07
371	601868	中国能建	113,200	259,228.00	0.07
372	600657	信达地产	62,300	259,168.00	0.07
373	600150	中国船舶	7,200	258,912.00	0.07
374	605499	东鹏饮料	1,040	258,460.80	0.07
375	600362	江西铜业	12,500	258,000.00	0.07
376	002463	沪电股份	6,500	257,725.00	0.07
377	000999	华润三九	5,800	257,172.00	0.07
378	688303	大全能源	10,565	255,039.10	0.07
379	002671	龙泉股份	56,300	255,039.00	0.07
380	601919	中远海控	16,400	254,200.00	0.07
381	002352	顺丰控股	6,300	253,890.00	0.07
382	002920	德赛西威	2,300	253,253.00	0.07
383	000776	广发证券	15,600	252,876.00	0.07
384	603077	和邦生物	123,100	251,124.00	0.07
385	002916	深南电路	2,000	250,000.00	0.07
386	002190	成飞集成	12,800	247,552.00	0.07
387	688256	寒武纪科技	373	245,434.00	0.07
388	300579	数字认证	7,800	245,076.00	0.07
389	600373	中文传媒	19,500	244,725.00	0.07
390	688008	澜起科技	3,604	244,711.60	0.07
391	601360	三六零	23,600	244,260.00	0.07
392	688186	张家港广大特材	15,908	244,187.80	0.07
393	688658	悦康药业	16,841	242,678.81	0.07
394	600718	东软集团	22,300	240,171.00	0.07
395	301155	海力风电	4,500	239,895.00	0.07
396	300741	华宝股份	13,700	238,243.00	0.07
397	002267	陕天然气	28,100	237,445.00	0.07
398	688389	深圳普门科技	15,910	236,899.90	0.07
399	600619	海立股份	19,400	236,680.00	0.07
400	600312	平高电气	12,200	234,240.00	0.06
401	000636	风华高科	16,200	232,470.00	0.06
402	601107	四川成渝	44,300	231,689.00	0.06

403	603043	广州酒家	13,900	231,157.00	0.06
404	688212	澳华内镜	5,752	231,115.36	0.06
405	600528	中铁工业	28,500	229,710.00	0.06
406	300454	深信服	4,000	229,600.00	0.06
407	000902	新洋丰	17,600	229,504.00	0.06
408	603013	亚普股份	15,300	229,194.00	0.06
409	600017	日照港	71,600	229,120.00	0.06
410	600987	航民股份	33,000	229,020.00	0.06
411	601126	四方股份	13,500	228,960.00	0.06
412	002314	南山控股	96,100	228,718.00	0.06
413	002003	伟星股份	16,130	228,562.10	0.06
414	000828	东莞控股	21,300	227,697.00	0.06
415	002250	联化科技	41,300	227,563.00	0.06
416	300737	科顺股份	44,800	227,136.00	0.06
417	603609	禾丰股份	26,300	226,706.00	0.06
418	600861	北京人力	11,700	226,395.00	0.06
419	601628	中国人寿	5,400	226,368.00	0.06
420	000403	派林生物	10,700	226,091.00	0.06
421	600062	华润双鹤	11,400	225,720.00	0.06
422	002773	康弘药业	11,500	225,400.00	0.06
423	002901	大博医疗	7,306	225,317.04	0.06
424	002020	京新药业	17,600	225,280.00	0.06
425	603132	金徽股份	20,000	224,600.00	0.06
426	000603	盛达资源	18,700	224,213.00	0.06
427	300294	博雅生物	7,400	224,072.00	0.06
428	600851	海欣股份	38,600	223,880.00	0.06
429	601766	中国中车	26,700	223,746.00	0.06
430	300620	光库科技	4,600	223,560.00	0.06
431	600780	通宝能源	39,700	223,511.00	0.06
432	300685	艾德生物	9,800	223,440.00	0.06
433	601225	陕西煤业	9,600	223,296.00	0.06
434	600420	国药现代	18,700	223,278.00	0.06
435	600710	苏美达	24,000	223,200.00	0.06
436	601949	中国出版	30,900	221,862.00	0.06
437	688232	国泰新点软件	7,638	221,425.62	0.06
438	601818	XD 光大银行	57,100	220,977.00	0.06
439	300768	迪普科技	12,500	218,750.00	0.06
440	605111	新洁能	6,440	218,380.40	0.06
441	688048	长光华芯	5,600	218,344.00	0.06
442	688206	概伦电子	11,527	217,975.57	0.06
443	300604	长川科技	4,900	216,237.00	0.06
444	605080	浙江自然	9,200	216,200.00	0.06
445	002097	山河智能	28,800	216,000.00	0.06

446	601881	中国银河	14,100	214,743.00	0.06
447	688002	睿创微纳	4,564	214,553.64	0.06
448	603936	博敏电子	25,300	213,026.00	0.06
449	000686	东北证券	26,800	212,792.00	0.06
450	601800	XD 中国交建	20,300	212,135.00	0.06
451	688630	芯碁微装	3,638	209,985.36	0.06
452	605337	李子园	18,500	208,865.00	0.06
453	601866	中远海发	79,900	208,539.00	0.06
454	600487	亨通光电	12,100	208,362.00	0.06
455	300827	上能电气	4,700	206,330.00	0.06
456	601061	中信金属	28,400	206,184.00	0.06
457	002620	瑞和股份	45,700	205,193.00	0.06
458	002517	恺英网络	15,000	204,150.00	0.06
459	601616	广电电气	46,400	203,696.00	0.06
460	002166	莱茵生物	27,200	203,184.00	0.06
461	300158	振东制药	46,800	202,176.00	0.06
462	688018	乐鑫科技	919	200,342.00	0.06
463	300638	广和通	9,900	199,485.00	0.06
464	300641	正丹股份	8,000	198,720.00	0.06
465	002597	金禾实业	8,700	198,621.00	0.06
466	300035	中科电气	13,200	197,340.00	0.05
467	000913	钱江摩托	10,900	196,309.00	0.05
468	603128	华贸物流	30,500	196,115.00	0.05
469	002371	北方华创	500	195,500.00	0.05
470	300973	立高食品	5,000	195,150.00	0.05
471	003006	百亚股份	8,100	194,319.00	0.05
472	601669	中国电建	35,500	193,830.00	0.05
473	603008	喜临门	11,500	192,740.00	0.05
474	603530	神马电力	7,800	192,738.00	0.05
475	603801	志邦家居	15,000	192,150.00	0.05
476	601108	财通证券	23,400	191,178.00	0.05
477	605376	博迁新材	6,600	191,070.00	0.05
478	002891	中宠股份	5,350	190,995.00	0.05
479	600449	宁夏建材	12,700	190,754.00	0.05
480	002946	新乳业	13,100	190,081.00	0.05
481	003012	东鹏控股	28,700	189,707.00	0.05
482	002068	黑猫股份	17,800	189,392.00	0.05
483	300772	运达股份	14,300	189,332.00	0.05
484	002204	大连重工	38,000	189,240.00	0.05
485	000680	山推股份	19,500	189,150.00	0.05
486	600059	古越龙山	21,300	189,144.00	0.05
487	600285	羚锐制药	8,500	188,360.00	0.05
488	001337	四川黄金	9,000	187,920.00	0.05

489	600901	江苏金租	36,000	187,920.00	0.05
490	300463	迈克生物	14,200	187,440.00	0.05
491	301339	通行宝	9,200	187,128.00	0.05
492	000597	东北制药	35,500	187,085.00	0.05
493	300474	景嘉微	2,000	186,980.00	0.05
494	002755	奥赛康	14,700	186,837.00	0.05
495	601068	中铝国际	42,300	186,543.00	0.05
496	688150	莱特光电股份	8,272	186,285.44	0.05
497	603039	泛微网络	3,800	186,200.00	0.05
498	600900	长江电力	6,300	186,165.00	0.05
499	300253	卫宁健康	26,000	186,160.00	0.05
500	002361	神剑股份	34,100	185,845.00	0.05
501	301175	中科环保	34,400	185,760.00	0.05
502	301559	C 中集环	12,100	185,735.00	0.05
503	002135	东南网架	43,700	185,725.00	0.05
504	001311	多利科技	7,200	185,688.00	0.05
505	600338	西藏珠峰	17,400	185,658.00	0.05
506	600075	新疆天业	42,600	185,310.00	0.05
507	601101	昊华能源	22,500	185,175.00	0.05
508	600649	城投控股	41,578	185,022.10	0.05
509	601187	厦门银行	32,800	184,992.00	0.05
510	300926	博俊科技	8,400	184,884.00	0.05
511	600258	首旅酒店	12,600	184,842.00	0.05
512	600682	南京新百	27,000	184,680.00	0.05
513	300415	伊之密	9,200	184,552.00	0.05
514	002091	江苏国泰	25,200	184,464.00	0.05
515	002125	湘潭电化	18,300	184,464.00	0.05
516	002534	西子洁能	16,600	184,426.00	0.05
517	600125	铁龙物流	31,100	184,423.00	0.05
518	300203	聚光科技	12,100	184,283.00	0.05
519	601778	晶科科技	65,300	184,146.00	0.05
520	301327	华宝新能	2,400	184,104.00	0.05
521	600557	康缘药业	13,500	183,870.00	0.05
522	601528	瑞丰银行	32,619	183,644.97	0.05
523	600094	大名城	50,400	183,456.00	0.05
524	300443	金雷股份	9,200	183,264.00	0.05
525	603866	桃李面包	27,740	183,084.00	0.05
526	605577	龙版传媒	12,600	183,078.00	0.05
527	300406	九强生物	13,700	183,032.00	0.05
528	688167	西安炬光科技	2,873	183,010.10	0.05
529	300724	捷佳伟创	2,892	182,803.32	0.05
530	002245	蔚蓝锂芯	17,100	182,799.00	0.05
531	605123	派克新材	3,400	182,784.00	0.05

532	600993	马应龙	7,000	182,770.00	0.05
533	601607	上海医药	8,700	182,700.00	0.05
534	601208	东材科技	24,200	182,468.00	0.05
535	002960	青鸟消防	15,629	182,390.43	0.05
536	688351	微创电生理股份	9,579	182,384.16	0.05
537	300618	寒锐钴业	5,400	182,358.00	0.05
538	002396	星网锐捷	9,600	182,304.00	0.05
539	688161	威高骨科	7,215	181,962.30	0.05
540	000821	京山轻机	14,600	181,770.00	0.05
541	002194	武汉凡谷	16,200	181,764.00	0.05
542	601006	大秦铁路	26,800	181,704.00	0.05
543	603259	药明康德	3,300	181,632.00	0.05
544	300244	迪安诊断	16,000	181,600.00	0.05
545	688372	伟测科技	3,101	181,470.52	0.05
546	300031	宝通科技	9,900	181,368.00	0.05
547	600019	宝钢股份	25,900	181,300.00	0.05
548	600335	国机汽车	29,100	181,293.00	0.05
549	000813	德展健康	57,900	181,227.00	0.05
550	601229	上海银行	19,800	181,170.00	0.05
551	000899	赣能股份	20,800	181,168.00	0.05
552	601609	金田股份	30,700	181,130.00	0.05
553	600660	福耀玻璃	2,900	180,960.00	0.05
554	002036	联创电子	19,200	180,480.00	0.05
555	600759	洲际油气	79,500	180,465.00	0.05
556	002174	游族网络	19,300	180,455.00	0.05
557	688007	光峰科技	12,201	180,452.79	0.05
558	000917	电广传媒	25,500	180,285.00	0.05
559	600015	XD 华夏银行	22,500	180,225.00	0.05
560	300687	赛意信息	9,900	180,180.00	0.05
561	600016	民生银行	43,600	180,068.00	0.05
562	600556	天下秀	34,600	179,920.00	0.05
563	600089	特变电工	14,100	179,634.00	0.05
564	601169	北京银行	29,200	179,580.00	0.05
565	300379	东方通	11,900	179,571.00	0.05
566	000338	潍柴动力	13,100	179,470.00	0.05
567	601600	中国铝业	24,400	179,340.00	0.05
568	300232	洲明科技	26,100	179,307.00	0.05
569	300525	博思软件	11,500	179,170.00	0.05
570	600438	通威股份	8,100	179,091.00	0.05
571	600050	中国联通	33,700	178,947.00	0.05
572	601390	中国中铁	28,000	178,920.00	0.05
573	300142	沃森生物	14,800	178,784.00	0.05
574	688131	皓元医药	5,006	178,714.20	0.05

575	002023	海特高新	17,600	178,640.00	0.05
576	603105	芯能科技	19,800	178,398.00	0.05
577	605167	利柏特	18,500	178,340.00	0.05
578	688209	英集芯科技	10,072	177,972.24	0.05
579	688023	安恒信息	4,360	177,888.00	0.05
580	603686	福龙马	17,100	177,840.00	0.05
581	600717	天津港	36,400	177,268.00	0.05
582	300274	阳光电源	2,400	177,192.00	0.05
583	688158	优刻得科技	12,642	176,735.16	0.05
584	601012	隆基绿能	11,200	175,952.00	0.05
585	601886	江河集团	32,581	175,937.40	0.05
586	000090	天健集团	42,800	175,908.00	0.05
587	601377	兴业证券	28,000	175,280.00	0.05
588	002567	唐人神	34,300	174,930.00	0.05
589	300144	宋城演艺	18,800	174,652.00	0.05
590	600819	耀皮玻璃	32,200	172,914.00	0.05
591	603718	海利生物	25,000	172,750.00	0.05
592	300033	同花顺	600	172,500.00	0.05
593	600155	华创云信	23,300	172,420.00	0.05
594	603969	银龙股份	25,500	172,380.00	0.05
595	688508	芯朋微电子	4,009	172,266.73	0.05
596	688083	中望软件	2,011	172,081.27	0.05
597	688337	普源精电	4,411	172,029.00	0.05
598	688776	国光电气	3,627	171,665.91	0.05
599	601136	首创证券	7,800	171,600.00	0.05
600	688127	蓝特光学	6,319	171,244.90	0.05
601	300001	特锐德	7,800	171,210.00	0.05
602	603823	百合花	18,400	171,120.00	0.05
603	688312	燕麦科技	5,550	170,940.00	0.05
604	600690	海尔智家	6,000	170,820.00	0.05
605	600745	闻泰科技	4,400	170,632.00	0.05
606	688093	世华科技	8,450	170,605.50	0.05
607	688261	东微半导体	4,060	170,479.40	0.05
608	688981	中芯国际	1,800	170,316.00	0.05
609	601566	九牧王	20,200	169,882.00	0.05
610	002454	松芝股份	25,500	169,575.00	0.05
611	002282	博深股份	22,857	169,370.37	0.05
612	002483	润邦股份	32,500	169,325.00	0.05
613	002906	华阳集团	5,504	169,248.00	0.05
614	000096	广聚能源	13,800	169,188.00	0.05
615	002714	牧原股份	4,400	169,136.00	0.05
616	600887	伊利股份	5,600	169,008.00	0.05
617	603379	三美股份	4,400	168,872.00	0.05

618	002375	亚厦股份	43,700	168,682.00	0.05
619	002991	甘源食品	1,800	168,336.00	0.05
620	601226	华电科工	24,900	168,324.00	0.05
621	601728	中国电信	23,300	168,226.00	0.05
622	600712	南宁百货	23,200	167,736.00	0.05
623	688578	艾力斯医药科技	2,800	167,720.00	0.05
624	600699	均胜电子	10,700	167,669.00	0.05
625	688687	北京凯因科技	7,760	167,460.80	0.05
626	603987	康德莱	23,300	167,294.00	0.05
627	002565	顺灏股份	54,900	166,896.00	0.05
628	600435	北方导航	17,100	166,896.00	0.05
629	601998	中信银行	23,900	166,822.00	0.05
630	603998	方盛制药	16,000	166,720.00	0.05
631	002627	三峡旅游	33,200	166,664.00	0.05
632	000551	创元科技	13,900	166,244.00	0.05
633	603283	赛腾股份	2,400	165,984.00	0.05
634	600640	国脉文化	13,900	165,966.00	0.05
635	600300	维维股份	51,500	165,830.00	0.05
636	688319	欧林生物	15,642	165,805.20	0.05
637	301077	星华新材	6,200	165,726.00	0.05
638	002044	美年健康	36,100	165,699.00	0.05
639	600000	浦发银行	16,100	165,669.00	0.05
640	600162	香江控股	86,200	165,504.00	0.05
641	301303	真兰仪表	10,800	165,456.00	0.05
642	688425	铁建重工	37,600	165,440.00	0.05
643	300761	立华股份	8,500	165,410.00	0.05
644	601577	长沙银行	18,600	165,354.00	0.05
645	688268	广东华特气体	3,600	165,312.00	0.05
646	603288	海天味业	3,600	165,240.00	0.05
647	603811	诚意药业	21,400	165,208.00	0.05
648	000001	平安银行	14,100	164,970.00	0.05
649	688123	聚辰半导体	2,818	164,909.36	0.05
650	603818	曲美家居	60,600	164,832.00	0.05
651	601899	紫金矿业	10,900	164,808.00	0.05
652	603897	长城科技	7,000	164,500.00	0.05
653	300181	佐力药业	10,700	164,352.00	0.05
654	600663	陆家嘴	16,700	164,328.00	0.05
655	300529	健帆生物	5,600	164,304.00	0.05
656	000572	海马汽车	39,300	164,274.00	0.05
657	002506	协鑫集成	61,500	164,205.00	0.05
658	002606	大连电瓷	17,800	164,116.00	0.05
659	001270	铖昌科技	4,300	163,830.00	0.05
660	600392	盛和资源	15,900	163,452.00	0.05

661	688286	敏芯股份	2,711	163,337.75	0.05
662	688509	正元地信	41,041	162,932.77	0.05
663	002653	海思科	4,900	162,925.00	0.05
664	300699	光威复材	4,700	162,855.00	0.05
665	688100	威胜信息	4,488	162,465.60	0.05
666	003031	中瓷电子	3,100	162,409.00	0.05
667	002802	洪汇新材	13,700	162,345.00	0.04
668	002472	双环传动	5,300	162,286.00	0.04
669	600598	北大荒	11,000	162,250.00	0.04
670	301335	天元宠物	7,200	162,000.00	0.04
671	600143	金发科技	18,700	161,568.00	0.04
672	688347	华虹半导体公司	3,476	161,529.72	0.04
673	002358	森源电气	35,100	161,460.00	0.04
674	600609	金杯汽车	22,400	161,280.00	0.04
675	000768	中航西飞	5,700	160,968.00	0.04
676	002262	恩华药业	6,600	160,710.00	0.04
677	603680	今创集团	19,300	160,190.00	0.04
678	688588	凌志软件	11,600	160,080.00	0.04
679	603816	顾家家居	5,800	159,964.00	0.04
680	001267	汇绿生态	20,900	159,676.00	0.04
681	300750	宁德时代	600	159,600.00	0.04
682	688380	中微半导	5,327	159,277.30	0.04
683	600498	烽火通信	8,100	157,626.00	0.04
684	600893	航发动力	3,800	157,510.00	0.04
685	300979	华利集团	2,000	157,300.00	0.04
686	601568	北元集团	37,400	157,080.00	0.04
687	600018	上港集团	25,500	156,060.00	0.04
688	600176	中国巨石	13,700	156,043.00	0.04
689	301087	可孚医疗	4,400	155,584.00	0.04
690	300170	汉得信息	12,500	155,000.00	0.04
691	300188	国投智能	11,200	154,448.00	0.04
692	600919	江苏银行	15,700	154,174.00	0.04
693	000708	中信特钢	13,500	154,035.00	0.04
694	000591	太阳能	32,300	153,748.00	0.04
695	605358	立昂微	6,200	153,574.00	0.04
696	600161	天坛生物	7,480	153,340.00	0.04
697	600415	小商品城	11,400	152,874.00	0.04
698	605117	德业股份	1,800	152,640.00	0.04
699	601916	浙商银行	52,400	152,484.00	0.04
700	600010	宝钢股份	81,900	152,334.00	0.04
701	300083	创世纪	23,400	152,334.00	0.04
702	300124	汇川技术	2,600	152,308.00	0.04
703	600482	中国动力	6,200	151,714.00	0.04

704	300759	康龙化成	5,900	151,630.00	0.04
705	301180	万祥科技	9,800	151,606.00	0.04
706	600837	海通证券	13,600	151,232.00	0.04
707	600026	中远海能	13,000	150,800.00	0.04
708	300628	亿联网络	3,900	150,540.00	0.04
709	600845	宝信软件	5,140	150,396.40	0.04
710	600032	浙江新能	20,300	150,220.00	0.04
711	600436	片仔癀	700	150,150.00	0.04
712	688599	天合光能	7,774	150,038.20	0.04
713	002230	科大讯飞	3,100	149,792.00	0.04
714	300014	亿纬锂能	3,200	149,568.00	0.04
715	000661	长春高新	1,500	149,160.00	0.04
716	600570	恒生电子	5,300	148,347.00	0.04
717	300308	中际旭创	1,200	148,212.00	0.04
718	300251	光线传媒	15,600	147,264.00	0.04
719	603075	热威科技股份	7,900	147,177.00	0.04
720	600584	长电科技	3,600	147,096.00	0.04
721	601139	深圳燃气	20,800	146,848.00	0.04
722	600316	洪都航空	4,500	144,540.00	0.04
723	688772	珠海冠宇电池	8,932	143,626.56	0.04
724	301218	华是科技	6,600	143,418.00	0.04
725	600566	济川药业	4,900	142,492.00	0.04
726	002299	圣农发展	9,800	141,904.00	0.04
727	002430	杭氧股份	6,500	141,700.00	0.04
728	000959	首钢股份	46,400	141,520.00	0.04
729	688065	凯赛生物	3,640	141,232.00	0.04
730	600191	华资实业	20,400	141,168.00	0.04
731	300752	隆利科技	8,300	141,100.00	0.04
732	002558	巨人网络	11,100	140,859.00	0.04
733	300150	世纪瑞尔	32,100	140,598.00	0.04
734	301363	美好医疗	4,300	139,406.00	0.04
735	002837	英维克	3,450	139,380.00	0.04
736	301397	C 溯联	5,400	139,050.00	0.04
737	600499	科达制造	17,800	138,840.00	0.04
738	601162	天风证券	30,800	137,984.00	0.04
739	600177	雅戈尔	15,500	137,950.00	0.04
740	603833	欧派家居	2,000	137,880.00	0.04
741	002456	欧菲光	11,500	137,770.00	0.04
742	000887	中鼎股份	10,500	137,760.00	0.04
743	601611	中国核建	15,200	137,408.00	0.04
744	603228	景旺电子	4,900	136,416.00	0.04
745	600390	五矿资本	21,100	136,095.00	0.04
746	001338	永顺泰	12,500	136,000.00	0.04

747	002624	完美世界	13,100	135,323.00	0.04
748	600160	巨化股份	5,600	135,072.00	0.04
749	000739	普洛药业	8,300	134,958.00	0.04
750	601116	三江购物	12,400	134,912.00	0.04
751	300233	金城医药	11,200	134,400.00	0.04
752	603118	共进股份	15,100	134,390.00	0.04
753	000987	越秀资本	19,100	134,082.00	0.04
754	600882	妙可蓝多	7,482	133,927.80	0.04
755	000818	航锦科技	7,000	133,700.00	0.04
756	601117	中国化学	16,100	133,469.00	0.04
757	002833	弘亚数控	7,900	132,957.00	0.04
758	002626	金达威	8,800	132,880.00	0.04
759	688789	杭州宏华数码 科技	2,000	132,760.00	0.04
760	688019	安集科技	952	132,670.72	0.04
761	000767	晋控电力	52,400	132,572.00	0.04
762	000966	长源电力	27,900	132,525.00	0.04
763	002100	天康生物	20,200	132,310.00	0.04
764	605369	拱东医疗	4,700	131,976.00	0.04
765	300738	奥飞数据	9,100	131,950.00	0.04
766	300577	开润股份	5,300	131,705.00	0.04
767	603938	三孚股份	12,180	131,665.80	0.04
768	300172	中电环保	26,000	131,300.00	0.04
769	002549	凯美特气	21,400	131,182.00	0.04
770	603279	景津装备	7,300	130,524.00	0.04
771	300476	胜宏科技	3,100	130,479.00	0.04
772	601279	英利汽车	34,000	130,220.00	0.04
773	301376	C 致欧	6,800	130,016.00	0.04
774	688566	吉贝尔药业	5,800	129,920.00	0.04
775	002548	金新农	32,700	129,819.00	0.04
776	002539	云图控股	16,600	129,812.00	0.04
777	603858	步长制药	8,200	129,560.00	0.04
778	600897	厦门空港	8,500	129,455.00	0.04
779	603053	成都燃气	12,900	129,387.00	0.04
780	002101	广东鸿图	10,800	129,384.00	0.04
781	002777	久远银海	7,500	129,150.00	0.04
782	603158	腾龙股份	15,900	128,472.00	0.04
783	605016	百龙创园	7,600	128,440.00	0.04
784	603689	皖天然气	14,300	128,414.00	0.04
785	603600	永艺股份	10,800	128,412.00	0.04
786	300470	中密控股	3,400	128,180.00	0.04
787	603595	东尼电子	7,500	128,175.00	0.04
788	000850	华茂股份	31,000	128,030.00	0.04
789	001216	华瓷股份	10,028	127,857.00	0.04

790	002059	云南旅游	23,700	127,743.00	0.04
791	688680	海优新材	3,776	127,553.28	0.04
792	600419	天润乳业	13,700	127,547.00	0.04
793	603967	中创物流	13,000	127,530.00	0.04
794	301332	C 德尔玛	12,700	127,254.00	0.04
795	600283	钱江水利	13,700	127,136.00	0.04
796	603538	美诺华	10,000	127,100.00	0.04
797	600638	新黄浦	24,900	126,990.00	0.04
798	600758	辽宁能源	36,900	126,936.00	0.04
799	001872	招商港口	6,200	126,914.00	0.04
800	000153	丰原药业	20,700	126,891.00	0.04
801	002452	长高电新	17,100	126,882.00	0.04
802	603173	福斯达深冷	5,500	126,775.00	0.04
803	601008	连云港	33,100	126,773.00	0.04
804	002224	三力士	29,300	126,576.00	0.04
805	600056	中国医药	11,400	126,540.00	0.04
806	600853	龙建股份	31,600	126,400.00	0.04
807	605319	无锡振华	6,000	126,300.00	0.03
808	603727	博迈科	11,000	126,280.00	0.03
809	300986	志特新材	10,400	126,256.00	0.03
810	688313	仕佳光子	7,700	126,203.00	0.03
811	002996	顺博合金	19,000	126,160.00	0.03
812	601368	绿城水务	26,500	126,140.00	0.03
813	000655	金岭矿业	20,500	126,075.00	0.03
814	600644	乐山电力	20,600	126,072.00	0.03
815	688522	纳睿雷达科技	2,237	126,032.58	0.03
816	600727	鲁北化工	17,000	125,970.00	0.03
817	300673	佩蒂股份	7,100	125,883.00	0.03
818	002578	闽发铝业	42,100	125,879.00	0.03
819	601177	杭齿前进	15,200	125,856.00	0.03
820	603788	宁波高发	9,100	125,853.00	0.03
821	000404	长虹华意	17,000	125,800.00	0.03
822	002666	德联集团	28,850	125,786.00	0.03
823	000920	沃顿科技	14,100	125,772.00	0.03
824	002160	常铝股份	33,800	125,736.00	0.03
825	603890	春秋电子	10,700	125,725.00	0.03
826	002980	华盛昌	4,900	125,685.00	0.03
827	301058	中粮科工	11,900	125,545.00	0.03
828	003013	地铁设计	8,300	125,496.00	0.03
829	300867	圣元环保	9,700	125,421.00	0.03
830	300545	联得装备	4,000	125,320.00	0.03
831	688381	帝奥微电子	6,493	125,185.04	0.03
832	301028	东亚机械	11,600	125,164.00	0.03

833	301305	C 朗坤	7,100	125,102.00	0.03
834	300259	新天科技	35,700	124,950.00	0.03
835	000524	岭南控股	12,900	124,872.00	0.03
836	603628	清源股份	10,000	124,800.00	0.03
837	603929	亚翔集成	4,500	124,785.00	0.03
838	600746	江苏索普	17,800	124,778.00	0.03
839	300815	玉禾田	8,000	124,720.00	0.03
840	603209	兴通股份	7,800	124,644.00	0.03
841	603309	维力医疗	10,400	124,592.00	0.03
842	002768	国恩股份	5,400	124,578.00	0.03
843	300160	秀强股份	22,900	124,576.00	0.03
844	600410	华胜天成	17,200	124,528.00	0.03
845	000862	银星能源	25,200	124,488.00	0.03
846	600592	XD 龙溪股份	12,600	124,488.00	0.03
847	300988	津荣天宇	6,900	124,476.00	0.03
848	002880	卫光生物	4,600	124,246.00	0.03
849	301456	C 盘古	5,500	124,245.00	0.03
850	688117	圣诺生物	4,835	124,114.45	0.03
851	600468	百利电气	26,400	124,080.00	0.03
852	301112	信邦智能	5,300	123,861.00	0.03
853	301320	C 豪江	8,300	123,753.00	0.03
854	605286	同力日升	4,100	123,656.00	0.03
855	000788	北大医药	20,600	123,600.00	0.03
856	002631	德尔未来	27,900	123,597.00	0.03
857	300682	朗新科技	10,100	123,220.00	0.03
858	601113	华鼎股份	31,500	122,850.00	0.03
859	301377	鼎泰高科	5,800	122,670.00	0.03
860	301195	北路智控	3,800	122,018.00	0.03
861	688155	先惠技术	3,204	121,559.76	0.03
862	002181	粤传媒	21,600	121,176.00	0.03
863	300047	天源迪科	10,300	121,025.00	0.03
864	603558	健盛集团	11,200	120,512.00	0.03
865	301158	德石股份	8,500	119,255.00	0.03
866	002560	通达股份	17,400	118,668.00	0.03
867	688383	新益昌科技	2,633	118,142.71	0.03
868	002252	上海莱士	16,300	117,686.00	0.03
869	688050	爱博诺德医疗	1,289	117,337.67	0.03
870	603707	健友股份	8,800	116,776.00	0.03
871	300357	我武生物	5,700	115,824.00	0.03
872	688390	固德威电源	2,800	114,520.00	0.03
873	000738	航发控制	5,100	113,424.00	0.03
874	301358	湖南裕能	2,500	113,300.00	0.03
875	600764	中国海防	4,000	113,280.00	0.03

876	000533	顺钠股份	18,600	112,716.00	0.03
877	002937	兴瑞科技	6,600	111,540.00	0.03
878	603168	莎普爱思	16,500	110,550.00	0.03
879	300492	华图山鼎	1,500	109,200.00	0.03
880	605599	莱百股份	9,600	108,960.00	0.03
881	688331	荣昌生物	3,600	108,396.00	0.03
882	002690	美亚光电	7,300	108,186.00	0.03
883	688248	南方电网电力科技	3,352	107,565.68	0.03
884	600941	中国移动	900	106,344.00	0.03
885	688608	恒玄科技	326	106,070.62	0.03
886	300582	英飞特	7,500	105,600.00	0.03
887	300547	川环科技	3,800	104,652.00	0.03
888	600098	广州发展	16,200	104,004.00	0.03
889	002311	海大集团	2,100	103,005.00	0.03
890	000017	深中华 A	17,700	102,660.00	0.03
891	603185	弘元绿能	6,300	102,375.00	0.03
892	300760	迈瑞医疗	400	102,000.00	0.03
893	300255	常山药业	5,100	101,949.00	0.03
894	603535	嘉诚国际	8,500	101,915.00	0.03
895	300010	豆神教育	16,300	101,223.00	0.03
896	002256	兆新股份	40,100	101,052.00	0.03
897	002155	湖南黄金	6,400	100,672.00	0.03
898	600470	六国化工	18,400	100,464.00	0.03
899	300778	新城市	9,000	100,440.00	0.03
900	000709	河钢股份	45,327	100,172.67	0.03
901	300149	睿智医药	15,600	100,152.00	0.03
902	300197	节能铁汉	43,300	100,023.00	0.03
903	000627	天茂集团	21,400	99,938.00	0.03
904	601816	京沪高铁	16,200	99,792.00	0.03
905	002556	辉隆股份	17,900	99,703.00	0.03
906	300552	万集科技	2,900	99,615.00	0.03
907	603233	大参林	6,600	99,396.00	0.03
908	600754	锦江酒店	3,700	99,382.00	0.03
909	600278	东方创业	14,200	99,258.00	0.03
910	600527	江南高纤	44,900	99,229.00	0.03
911	000703	恒逸石化	15,800	99,224.00	0.03
912	688387	中信科移动	16,644	99,198.24	0.03
913	600895	张江高科	3,700	99,160.00	0.03
914	688525	佰维存储	1,600	99,152.00	0.03
915	603333	尚纬股份	17,800	99,146.00	0.03
916	600257	大湖股份	21,000	99,120.00	0.03
917	300135	宝利国际	25,000	99,000.00	0.03
918	601828	美凯龙	30,800	98,868.00	0.03

919	601601	中国太保	2,900	98,832.00	0.03
920	600397	安源煤业	23,400	98,748.00	0.03
921	601212	白银有色	35,500	98,690.00	0.03
922	002056	横店东磁	7,600	98,496.00	0.03
923	002694	顾地科技	21,500	98,470.00	0.03
924	300438	鹏辉能源	3,500	98,385.00	0.03
925	300206	理邦仪器	8,800	98,384.00	0.03
926	000831	中国稀土	3,500	98,175.00	0.03
927	000816	智慧农业	32,500	98,150.00	0.03
928	002806	华锋股份	8,700	98,136.00	0.03
929	301558	C 三态	11,200	98,112.00	0.03
930	002607	中公教育	28,800	97,920.00	0.03
931	000333	美的集团	1,300	97,786.00	0.03
932	000968	蓝焰控股	14,700	97,755.00	0.03
933	600383	金地集团	22,300	97,674.00	0.03
934	300058	蓝色光标	10,500	97,440.00	0.03
935	601231	环旭电子	5,900	97,350.00	0.03
936	002673	西部证券	11,900	96,985.00	0.03
937	600481	双良节能	17,600	96,800.00	0.03
938	002939	长城证券	11,800	96,760.00	0.03
939	001213	中铁特货	23,200	96,744.00	0.03
940	002429	兆驰股份	16,700	96,526.00	0.03
941	002439	启明星辰	6,100	96,502.00	0.03
942	600589	大位科技	21,000	96,180.00	0.03
943	601858	中国科传	4,700	95,786.00	0.03
944	002195	二三四五	24,100	95,677.00	0.03
945	300059	东方财富	3,700	95,534.00	0.03
946	002791	坚朗五金	4,200	95,508.00	0.03
947	601099	太平洋	22,400	95,424.00	0.03
948	688276	长春百克生物 科技	3,800	95,418.00	0.03
949	300265	通光线缆	11,600	95,352.00	0.03
950	601326	秦港股份	28,300	94,805.00	0.03
951	300595	欧普康视	5,000	94,750.00	0.03
952	002156	通富微电	3,200	94,560.00	0.03
953	601519	大智慧	10,200	94,350.00	0.03
954	002179	中航光电	2,400	94,320.00	0.03
955	002298	中电兴发	17,700	94,164.00	0.03
956	600100	同方股份	13,200	93,852.00	0.03
957	601963	重庆银行	10,100	93,728.00	0.03
958	601799	星宇股份	700	93,436.00	0.03
959	603605	珀莱雅	1,100	93,170.00	0.03
960	002180	纳思达	3,300	92,961.00	0.03
961	300347	泰格医药	1,700	92,854.00	0.03

962	603659	璞泰来	5,800	92,278.00	0.03
963	002459	晶澳科技	6,700	92,125.00	0.03
964	600809	山西汾酒	500	92,105.00	0.03
965	603055	台华新材	8,300	91,964.00	0.03
966	603806	福斯特	6,200	91,760.00	0.03
967	001201	东瑞股份	5,800	91,756.00	0.03
968	002129	TCL 中环	10,300	91,361.00	0.03
969	601228	广州港	26,800	90,852.00	0.03
970	603958	哈森股份	5,100	90,729.00	0.03
971	600606	绿地控股	43,200	90,720.00	0.03
972	688032	禾迈股份	805	90,675.20	0.03
973	300666	江丰电子	1,300	90,285.00	0.03
974	605050	福然德	9,300	90,210.00	0.02
975	002772	众兴菌业	12,200	89,914.00	0.02
976	000027	深圳能源	13,800	89,424.00	0.02
977	002867	周大生	6,100	88,633.00	0.02
978	600406	国电南瑞	3,500	88,270.00	0.02
979	300218	安利股份	5,700	87,780.00	0.02
980	603380	易德龙	3,500	87,465.00	0.02
981	002982	湘佳股份	4,900	87,465.00	0.02
982	000419	通程控股	15,300	87,363.00	0.02
983	600665	天地源	27,900	87,327.00	0.02
984	000698	沈阳化工	25,900	87,283.00	0.02
985	601668	中国建筑	14,500	87,000.00	0.02
986	601633	长城汽车	3,300	86,889.00	0.02
987	300195	长荣股份	15,400	86,702.00	0.02
988	603817	海峡环保	15,500	86,490.00	0.02
989	002394	联发股份	11,500	86,480.00	0.02
990	301086	鸿富瀚	1,700	86,479.00	0.02
991	000510	新金路	24,000	86,400.00	0.02
992	000651	格力电器	1,900	86,355.00	0.02
993	600731	湖南海利	15,110	86,127.00	0.02
994	603999	读者传媒	14,000	86,100.00	0.02
995	600249	两面针	16,900	86,021.00	0.02
996	688628	优利德科技	2,330	85,837.20	0.02
997	002286	保龄宝	11,600	85,608.00	0.02
998	603058	永吉股份	9,700	85,554.00	0.02
999	300241	瑞丰光电	15,500	85,095.00	0.02
1,000	688371	菲沃泰纳米科技	5,479	85,034.08	0.02
1,001	301311	昆船智能	4,700	85,023.00	0.02
1,002	002380	科远智慧	4,600	85,008.00	0.02
1,003	301121	紫建电子	1,600	84,896.00	0.02
1,004	600325	华发股份	14,700	84,672.00	0.02

1,005	603861	白云电器	9,400	84,600.00	0.02
1,006	603166	福达股份	11,600	84,332.00	0.02
1,007	001316	润贝航科	2,900	84,100.00	0.02
1,008	003037	三和管桩	11,400	84,018.00	0.02
1,009	601111	中国国航	10,600	83,846.00	0.02
1,010	600906	财达证券	11,800	83,780.00	0.02
1,011	600548	深高速	6,200	83,576.00	0.02
1,012	001207	联科科技	4,300	83,377.00	0.02
1,013	000617	中油资本	12,100	83,369.00	0.02
1,014	301379	天山电子	4,100	82,820.00	0.02
1,015	688070	成都纵横	2,337	82,496.10	0.02
1,016	000563	陕国投 A	23,000	81,880.00	0.02
1,017	603737	三棵树	1,900	80,940.00	0.02
1,018	000166	申万宏源	15,100	80,785.00	0.02
1,019	300413	芒果超媒	3,000	80,670.00	0.02
1,020	688105	诺唯赞生物	3,600	79,812.00	0.02
1,021	000517	荣安地产	35,600	79,388.00	0.02
1,022	600029	南方航空	12,200	79,178.00	0.02
1,023	603730	岱美股份	8,800	79,112.00	0.02
1,024	600169	太原重工	31,700	78,933.00	0.02
1,025	000690	宝新能源	17,600	78,848.00	0.02
1,026	601990	南京证券	9,100	78,806.00	0.02
1,027	603187	海容冷链	7,000	78,330.00	0.02
1,028	600054	黄山旅游	6,900	77,970.00	0.02
1,029	601002	晋亿实业	17,800	77,430.00	0.02
1,030	300820	英杰电气	1,400	77,350.00	0.02
1,031	600708	光明地产	20,600	76,632.00	0.02
1,032	603815	交建股份	13,600	76,568.00	0.02
1,033	002414	高德红外	10,300	76,529.00	0.02
1,034	601975	招商南油	24,200	75,746.00	0.02
1,035	301205	联特科技	1,000	75,690.00	0.02
1,036	002285	世联行	29,200	75,628.00	0.02
1,037	301367	怡和嘉业	1,200	75,600.00	0.02
1,038	002785	万里石	2,300	75,325.00	0.02
1,039	002319	乐通股份	7,000	74,410.00	0.02
1,040	300211	亿通科技	8,100	72,090.00	0.02
1,041	300193	佳士科技	8,100	72,009.00	0.02
1,042	000858	五粮液	500	70,020.00	0.02
1,043	301029	怡合达	2,800	69,216.00	0.02
1,044	688108	赛诺医疗科学	6,931	67,646.56	0.02
1,045	688235	百济神州	400	64,408.00	0.02
1,046	000826	启迪环境	31,900	63,800.00	0.02
1,047	000967	盈峰环境	12,100	60,137.00	0.02

1,048	601598	中国外运	11,200	59,920.00	0.02
1,049	002587	奥拓电子	9,600	57,600.00	0.02
1,050	600869	远东股份	12,100	57,475.00	0.02
1,051	002832	比音勒芬	2,600	55,666.00	0.02
1,052	603236	移远通信	800	54,752.00	0.02
1,053	688322	奥比中光	1,177	54,730.50	0.02
1,054	603871	嘉友国际	2,800	54,180.00	0.02
1,055	002270	华明装备	3,200	54,048.00	0.01
1,056	688017	绿的谐波	500	54,030.00	0.01
1,057	002612	朗姿股份	3,300	53,988.00	0.01
1,058	601033	永兴股份	3,700	53,502.00	0.01
1,059	600655	豫园股份	8,100	52,083.00	0.01
1,060	601375	中原证券	11,900	51,408.00	0.01
1,061	000688	国城矿业	4,300	51,127.00	0.01
1,062	601869	长飞光纤	1,700	50,813.00	0.01
1,063	688208	道通科技	1,289	50,477.24	0.01
1,064	300565	科信技术	4,200	50,358.00	0.01
1,065	301338	凯格精机	1,600	49,920.00	0.01
1,066	688135	利扬芯片	2,408	48,328.56	0.01
1,067	688066	北京航天宏图	2,363	48,205.20	0.01
1,068	300679	电连技术	800	47,760.00	0.01
1,069	600967	内蒙一机	5,600	47,600.00	0.01
1,070	300084	海默科技	8,700	46,806.00	0.01
1,071	300672	国科微	700	46,725.00	0.01
1,072	002110	三钢闽光	14,000	46,480.00	0.01
1,073	688118	普元信息	2,189	46,034.67	0.01
1,074	000059	华锦股份	9,600	45,984.00	0.01
1,075	600195	中牧股份	6,800	45,628.00	0.01
1,076	600020	中原高速	10,800	45,576.00	0.01
1,077	601158	重庆水务	9,300	45,570.00	0.01
1,078	600675	中华企业	16,200	45,522.00	0.01
1,079	300523	辰安科技	2,300	45,517.00	0.01
1,080	600261	阳光照明	13,900	45,453.00	0.01
1,081	603601	再升科技	13,500	45,360.00	0.01
1,082	000589	贵州轮胎	9,000	45,270.00	0.01
1,083	600035	楚天高速	9,800	45,080.00	0.01
1,084	300239	东宝生物	7,200	45,072.00	0.01
1,085	000601	韶能股份	11,100	45,066.00	0.01
1,086	600502	安徽建工	9,400	44,932.00	0.01
1,087	002568	百润股份	1,600	44,816.00	0.01
1,088	600488	津药药业	10,565	44,795.60	0.01
1,089	300735	光弘科技	1,600	44,784.00	0.01
1,090	688103	国力股份	1,100	44,737.00	0.01

1,091	300375	鹏翎股份	9,700	44,717.00	0.01
1,092	603083	剑桥科技	1,100	44,660.00	0.01
1,093	000030	富奥股份	8,700	44,631.00	0.01
1,094	603108	润达医疗	2,800	44,604.00	0.01
1,095	300745	欣锐科技	2,800	44,576.00	0.01
1,096	002522	浙江众成	11,400	44,574.00	0.01
1,097	000554	泰山石油	7,500	44,550.00	0.01
1,098	000790	华神科技	11,400	44,460.00	0.01
1,099	600816	建元信托	12,700	44,450.00	0.01
1,100	000650	仁和药业	7,700	44,352.00	0.01
1,101	002585	双星新材	8,300	44,322.00	0.01
1,102	603520	司太立	5,100	44,319.00	0.01
1,103	688199	久日新材料	2,942	44,277.10	0.01
1,104	600033	福建高速	11,400	44,232.00	0.01
1,105	603883	老百姓	2,700	44,199.00	0.01
1,106	301080	百普赛斯	1,000	44,140.00	0.01
1,107	000032	深桑达 A	2,500	44,100.00	0.01
1,108	301132	满坤科技	1,600	44,000.00	0.01
1,109	000503	国新健康	4,000	43,920.00	0.01
1,110	688595	芯海科技	1,339	43,919.20	0.01
1,111	603323	苏农银行	8,300	43,907.00	0.01
1,112	688573	信宇人	2,800	43,652.00	0.01
1,113	600061	国投资本	5,800	43,616.00	0.01
1,114	601860	XD 紫金银行	15,300	43,605.00	0.01
1,115	600063	皖维高新	10,900	43,600.00	0.01
1,116	300068	南都电源	2,700	43,578.00	0.01
1,117	603496	恒为科技	1,600	43,488.00	0.01
1,118	003035	南网能源	10,400	43,472.00	0.01
1,119	002206	海利得	10,100	43,329.00	0.01
1,120	300110	华仁药业	12,300	43,296.00	0.01
1,121	300358	楚天科技	6,300	43,218.00	0.01
1,122	002971	和远气体	2,300	43,125.00	0.01
1,123	002382	蓝帆医疗	8,400	43,092.00	0.01
1,124	000932	华菱钢铁	10,300	43,054.00	0.01
1,125	600187	国中水务	12,800	43,008.00	0.01
1,126	002443	金洲管道	7,300	42,924.00	0.01
1,127	600688	上海石化	14,200	42,884.00	0.01
1,128	601615	明阳智能	3,400	42,874.00	0.01
1,129	002441	众业达	5,500	42,790.00	0.01
1,130	002793	罗欣药业	11,200	42,784.00	0.01
1,131	002170	芭田股份	4,900	42,777.00	0.01
1,132	300928	华安鑫创	1,300	42,757.00	0.01
1,133	300857	协创数据	400	42,756.00	0.01

1, 134	301276	嘉曼服饰	2, 100	42, 735. 00	0. 01
1, 135	600602	云赛智联	2, 700	42, 714. 00	0. 01
1, 136	002061	浙江交科	10, 453	42, 648. 24	0. 01
1, 137	600284	浦东建设	6, 800	42, 636. 00	0. 01
1, 138	601658	邮储银行	7, 500	42, 600. 00	0. 01
1, 139	000926	福星股份	16, 700	42, 585. 00	0. 01
1, 140	000055	方大集团	10, 800	42, 552. 00	0. 01
1, 141	000582	北部湾港	5, 400	42, 552. 00	0. 01
1, 142	688033	天宜上佳	7, 400	42, 550. 00	0. 01
1, 143	301359	东南电子	1, 900	42, 522. 00	0. 01
1, 144	600328	中盐化工	5, 400	42, 498. 00	0. 01
1, 145	600361	创新新材	11, 000	42, 460. 00	0. 01
1, 146	300057	万顺新材	8, 800	42, 416. 00	0. 01
1, 147	605365	立达信	2, 700	42, 390. 00	0. 01
1, 148	300890	翔丰华	1, 400	42, 364. 00	0. 01
1, 149	600206	有研新材	2, 700	42, 309. 00	0. 01
1, 150	688779	五矿新能	7, 951	42, 299. 32	0. 01
1, 151	000158	常山北明	2, 100	42, 294. 00	0. 01
1, 152	603113	金能科技	7, 500	42, 225. 00	0. 01
1, 153	601100	恒立液压	800	42, 216. 00	0. 01
1, 154	002053	云南能投	3, 700	42, 180. 00	0. 01
1, 155	600409	三友化工	7, 800	42, 120. 00	0. 01
1, 156	601318	中国平安	800	42, 120. 00	0. 01
1, 157	688598	金博碳素股份	2, 000	42, 120. 00	0. 01
1, 158	002222	福晶科技	1, 300	42, 120. 00	0. 01
1, 159	300212	易华录	1, 800	42, 120. 00	0. 01
1, 160	000034	神州数码	1, 200	42, 060. 00	0. 01
1, 161	300762	上海瀚讯	2, 000	42, 060. 00	0. 01
1, 162	000089	深圳机场	6, 100	42, 029. 00	0. 01
1, 163	001979	招商蛇口	4, 100	41, 984. 00	0. 01
1, 164	000538	云南白药	700	41, 965. 00	0. 01
1, 165	002448	中原内配	6, 700	41, 942. 00	0. 01
1, 166	000705	浙江震元	5, 300	41, 923. 00	0. 01
1, 167	600740	山西焦化	10, 400	41, 912. 00	0. 01
1, 168	300088	长信科技	6, 400	41, 856. 00	0. 01
1, 169	002413	雷科防务	9, 600	41, 856. 00	0. 01
1, 170	600562	国睿科技	2, 100	41, 853. 00	0. 01
1, 171	600966	博汇纸业	8, 100	41, 796. 00	0. 01
1, 172	300164	通源石油	9, 800	41, 748. 00	0. 01
1, 173	601718	际华集团	14, 700	41, 748. 00	0. 01
1, 174	600222	太龙药业	8, 200	41, 738. 00	0. 01
1, 175	600531	豫光金铅	6, 500	41, 730. 00	0. 01
1, 176	000726	鲁泰 A	6, 400	41, 728. 00	0. 01

1,177	300364	中文在线	1,700	41,701.00	0.01
1,178	688601	力芯微股份	1,000	41,430.00	0.01
1,179	000700	模塑科技	5,900	41,418.00	0.01
1,180	600782	新钢股份	12,400	41,416.00	0.01
1,181	600351	亚宝药业	6,800	41,412.00	0.01
1,182	600929	雪天盐业	7,400	41,366.00	0.01
1,183	002462	嘉事堂	3,200	41,344.00	0.01
1,184	300320	海达股份	4,300	41,280.00	0.01
1,185	002739	万达电影	3,400	41,276.00	0.01
1,186	688469	芯联集成	8,036	41,224.68	0.01
1,187	000157	中联重科	5,700	41,211.00	0.01
1,188	600909	华安证券	6,800	41,208.00	0.01
1,189	002057	中钢天源	5,700	41,154.00	0.01
1,190	300130	新国都	1,900	41,154.00	0.01
1,191	000792	盐湖股份	2,500	41,150.00	0.01
1,192	600188	兖矿能源	2,900	41,093.00	0.01
1,193	600067	冠城新材	15,500	41,075.00	0.01
1,194	002434	万里扬	6,600	40,920.00	0.01
1,195	000088	盐田港	8,400	40,908.00	0.01
1,196	600025	华能水电	4,300	40,893.00	0.01
1,197	688488	艾迪药业	5,200	40,872.00	0.01
1,198	002940	昂利康	3,100	40,858.00	0.01
1,199	300451	创业慧康	9,100	40,768.00	0.01
1,200	300773	拉卡拉	2,300	40,710.00	0.01
1,201	600742	一汽富维	4,600	40,710.00	0.01
1,202	603369	今世缘	900	40,707.00	0.01
1,203	603809	豪能股份	3,500	40,705.00	0.01
1,204	000029	深深房 A	2,700	40,662.00	0.01
1,205	000676	智度股份	4,800	40,608.00	0.01
1,206	600623	华谊集团	5,800	40,600.00	0.01
1,207	688148	芳源股份	8,200	40,590.00	0.01
1,208	002391	长青股份	8,100	40,581.00	0.01
1,209	600600	青岛啤酒	500	40,460.00	0.01
1,210	000937	冀中能源	6,400	40,448.00	0.01
1,211	601995	中金公司	1,200	40,428.00	0.01
1,212	601218	吉鑫科技	12,400	40,424.00	0.01
1,213	600989	宝丰能源	2,400	40,416.00	0.01
1,214	001965	招商公路	2,896	40,399.20	0.01
1,215	601801	皖新传媒	5,500	40,370.00	0.01
1,216	603588	高能环境	7,700	40,348.00	0.01
1,217	300725	药石科技	1,200	40,320.00	0.01
1,218	600111	北方稀土	1,900	40,318.00	0.01
1,219	002651	利君股份	5,500	40,315.00	0.01

1, 220	600975	新五丰	6, 500	40, 300. 00	0. 01
1, 221	603266	天龙股份	2, 500	40, 250. 00	0. 01
1, 222	600133	东湖高新	4, 300	40, 205. 00	0. 01
1, 223	600905	三峡能源	9, 200	40, 204. 00	0. 01
1, 224	300258	精锻科技	4, 500	40, 095. 00	0. 01
1, 225	688009	中国通号	6, 400	40, 064. 00	0. 01
1, 226	601700	风范股份	8, 900	40, 050. 00	0. 01
1, 227	300339	润和软件	800	40, 024. 00	0. 01
1, 228	600153	建发股份	3, 800	39, 976. 00	0. 01
1, 229	002183	怡亚通	8, 900	39, 961. 00	0. 01
1, 230	600011	华能国际	5, 900	39, 943. 00	0. 01
1, 231	300132	青松股份	8, 100	39, 933. 00	0. 01
1, 232	600346	恒力石化	2, 600	39, 910. 00	0. 01
1, 233	002060	粤水电	10, 900	39, 894. 00	0. 01
1, 234	000539	粤电力 A	8, 800	39, 864. 00	0. 01
1, 235	688295	中复神鹰碳纤维	2, 000	39, 860. 00	0. 01
1, 236	688110	东芯股份	1, 600	39, 840. 00	0. 01
1, 237	002493	荣盛石化	4, 400	39, 820. 00	0. 01
1, 238	603111	康尼机电	6, 600	39, 798. 00	0. 01
1, 239	300015	爱尔眼科	3, 000	39, 750. 00	0. 01
1, 240	603885	吉祥航空	2, 900	39, 730. 00	0. 01
1, 241	300045	华力创通	1, 900	39, 691. 00	0. 01
1, 242	600171	上海贝岭	1, 000	39, 680. 00	0. 01
1, 243	600446	金证股份	2, 300	39, 652. 00	0. 01
1, 244	000025	特力 A	2, 400	39, 648. 00	0. 01
1, 245	600475	华光环能	4, 400	39, 644. 00	0. 01
1, 246	001331	胜通能源	3, 600	39, 636. 00	0. 01
1, 247	002035	华帝股份	5, 400	39, 636. 00	0. 01
1, 248	002351	漫步者	2, 400	39, 600. 00	0. 01
1, 249	002466	天齐锂业	1, 200	39, 600. 00	0. 01
1, 250	000078	海王生物	15, 500	39, 525. 00	0. 01
1, 251	002662	京威股份	10, 200	39, 474. 00	0. 01
1, 252	002859	洁美科技	1, 900	39, 425. 00	0. 01
1, 253	600251	冠农股份	5, 400	39, 366. 00	0. 01
1, 254	002533	金杯电工	4, 000	39, 360. 00	0. 01
1, 255	300569	天能重工	7, 900	39, 342. 00	0. 01
1, 256	300048	合康新能	7, 800	39, 312. 00	0. 01
1, 257	600643	爱建集团	7, 600	39, 292. 00	0. 01
1, 258	688652	京仪装备	800	39, 280. 00	0. 01
1, 259	300194	福安药业	8, 800	39, 248. 00	0. 01
1, 260	601878	浙商证券	3, 200	39, 168. 00	0. 01
1, 261	601988	中国银行	7, 100	39, 121. 00	0. 01
1, 262	002588	史丹利	5, 300	39, 114. 00	0. 01

1,263	002698	博实股份	2,300	39,100.00	0.01
1,264	600477	杭萧钢构	15,200	39,064.00	0.01
1,265	300261	雅本化学	5,700	39,045.00	0.01
1,266	603151	邦基科技股份	3,900	39,039.00	0.01
1,267	002300	太阳电缆	7,300	38,982.00	0.01
1,268	000938	紫光股份	1,400	38,962.00	0.01
1,269	002123	梦网科技	3,600	38,916.00	0.01
1,270	600426	华鲁恒升	1,800	38,898.00	0.01
1,271	001259	利仁科技	1,800	38,880.00	0.01
1,272	002479	富春环保	8,200	38,868.00	0.01
1,273	688102	陕西斯瑞新材股份	4,400	38,808.00	0.01
1,274	600552	凯盛科技	3,400	38,794.00	0.01
1,275	300567	精测电子	600	38,580.00	0.01
1,276	300360	炬华科技	2,300	38,571.00	0.01
1,277	002171	楚江新材	4,700	38,540.00	0.01
1,278	300657	弘信电子	1,700	38,522.00	0.01
1,279	000612	焦作万方	6,000	38,520.00	0.01
1,280	603650	彤程新材	1,100	38,467.00	0.01
1,281	002261	拓维信息	2,100	38,451.00	0.01
1,282	002236	大华股份	2,400	38,400.00	0.01
1,283	000901	航天科技	3,500	38,395.00	0.01
1,284	688385	复旦微电	1,000	38,390.00	0.01
1,285	300803	指南针	400	38,380.00	0.01
1,286	300680	隆盛科技	1,600	38,336.00	0.01
1,287	601901	方正证券	4,600	38,318.00	0.01
1,288	002185	华天科技	3,300	38,313.00	0.01
1,289	688586	江航飞机装备	4,000	38,280.00	0.01
1,290	600372	中航机载	3,100	38,223.00	0.01
1,291	601236	红塔证券	4,500	38,205.00	0.01
1,292	002478	常宝股份	7,200	38,088.00	0.01
1,293	002736	国信证券	3,400	38,080.00	0.01
1,294	601788	光大证券	2,100	38,031.00	0.01
1,295	300070	碧水源	7,500	37,950.00	0.01
1,296	301292	C海科	2,900	37,932.00	0.01
1,297	603063	禾望电气	1,900	37,924.00	0.01
1,298	603067	振华股份	3,000	37,890.00	0.01
1,299	688012	中微半导体设备	200	37,832.00	0.01
1,300	601069	西部黄金	3,300	37,785.00	0.01
1,301	688280	精进电动	8,600	37,754.00	0.01
1,302	600639	浦东金桥	3,400	37,740.00	0.01
1,303	600353	旭光电子	5,200	37,544.00	0.01
1,304	002645	华宏科技	5,500	37,510.00	0.01

1,305	301215	中汽股份	6,300	37,485.00	0.01
1,306	300812	易天股份	1,700	37,468.00	0.01
1,307	601608	中信重工	8,900	37,380.00	0.01
1,308	300696	爱乐达	2,400	37,272.00	0.01
1,309	600673	东阳光	3,300	37,257.00	0.01
1,310	688222	成都先导	3,000	36,960.00	0.01
1,311	600760	中航沈飞	720	36,518.40	0.01
1,312	688778	厦钨新能源	800	36,512.00	0.01
1,313	300073	当升科技	900	36,252.00	0.01
1,314	688202	美迪西生物医 药	1,200	36,204.00	0.01
1,315	002913	奥士康	1,500	36,165.00	0.01
1,316	603195	公牛集团	514	36,103.36	0.01
1,317	688173	希荻微电子	3,245	35,954.60	0.01
1,318	300496	中科创达	600	35,736.00	0.01
1,319	603296	华勤技术	500	35,475.00	0.01
1,320	688700	东威科技	1,200	35,352.00	0.01
1,321	000596	古井贡酒	200	34,660.00	0.01
1,322	605555	德昌股份	1,600	34,624.00	0.01
1,323	688559	海目星激光	1,000	34,400.00	0.01
1,324	688037	芯源微电子	400	33,452.00	0.01
1,325	600839	四川长虹	3,436	33,157.40	0.01
1,326	688568	中科星图公司	644	32,863.32	0.01
1,327	688072	拓荆科技	200	30,734.00	0.01
1,328	002442	龙星化工	5,000	30,050.00	0.01
1,329	603109	神驰机电	1,500	26,625.00	0.01
1,330	002412	汉森制药	4,400	26,444.00	0.01
1,331	603768	常青股份	2,200	26,444.00	0.01
1,332	688663	新风光科技	1,217	26,421.07	0.01
1,333	600512	腾达建设	11,100	26,307.00	0.01
1,334	002476	宝莫股份	6,200	26,164.00	0.01
1,335	603586	金麒麟	1,800	26,046.00	0.01
1,336	688468	科美诊断	3,800	26,030.00	0.01
1,337	002907	华森制药	2,000	26,000.00	0.01
1,338	688516	奥特维科技	600	25,986.00	0.01
1,339	300424	航新科技	1,400	25,284.00	0.01
1,340	002034	旺能环境	1,600	24,800.00	0.01
1,341	300395	菲利华	600	22,566.00	0.01
1,342	002372	伟星新材	1,700	21,471.00	0.01
1,343	300180	华峰超纤	3,100	19,530.00	0.01
1,344	000682	东方电子	1,800	19,278.00	0.01
1,345	002759	天际股份	2,100	18,417.00	0.01
1,346	600004	白云机场	1,000	9,600.00	0.00
1,347	603678	火炬电子	300	9,150.00	0.00

1,348	688076	诺泰生物	170	8,826.40	0.00
1,349	300626	华瑞股份	800	7,296.00	0.00
1,350	688511	天微电子	400	6,228.00	0.00
1,351	600350	山东高速	600	6,168.00	0.00
1,352	000544	中原环保	400	3,492.00	0.00
1,353	300243	瑞丰高材	300	2,856.00	0.00
1,354	600550	保变电气	300	2,355.00	0.00
1,355	300407	凯发电气	200	2,034.00	0.00
1,356	002741	光华科技	100	1,652.00	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	300502	新易盛	29,659,407.90	5.10
2	002463	沪电股份	20,003,116.00	3.44
3	601058	赛轮轮胎	19,771,608.37	3.40
4	000975	银泰黄金	17,710,283.00	3.04
5	600079	人福医药	17,628,559.45	3.03
6	601077	渝农商行	17,483,242.00	3.01
7	601555	东吴证券	17,374,847.61	2.99
8	002517	恺英网络	17,324,871.00	2.98
9	601577	长沙银行	17,035,505.00	2.93
10	300394	天孚通信	16,875,899.00	2.90
11	002138	顺络电子	16,609,395.00	2.86
12	002384	东山精密	16,598,140.00	2.85
13	002156	通富微电	16,521,146.92	2.84
14	600699	均胜电子	16,462,542.00	2.83
15	601168	西部矿业	16,321,488.78	2.81
16	688188	上海柏楚电 子科技	16,218,476.99	2.79
17	600066	宇通客车	16,146,213.53	2.78
18	002028	思源电气	16,070,896.00	2.76
19	002273	水晶光电	16,019,042.00	2.75
20	600418	江淮汽车	15,997,673.00	2.75
21	000933	神火股份	15,848,707.00	2.72
22	000423	东阿阿胶	15,793,287.00	2.72
23	300001	特锐德	15,553,226.00	2.67
24	600988	赤峰黄金	15,546,547.00	2.67
25	000960	锡业股份	14,755,176.82	2.54
26	002966	苏州银行	14,605,684.40	2.51
27	600096	云天化	14,520,284.00	2.50
28	601233	桐昆股份	14,519,509.00	2.50

29	601128	常熟银行	14,379,240.40	2.47
30	300207	欣旺达	14,293,630.00	2.46
31	600161	天坛生物	14,281,152.60	2.46
32	688099	晶晨半导体	14,267,328.72	2.45
33	601966	玲珑轮胎	14,257,655.00	2.45
34	002078	太阳纸业	14,072,759.00	2.42
35	603816	顾家家居	14,013,296.00	2.41
36	002422	科伦药业	14,002,383.35	2.41
37	002472	双环传动	13,724,231.00	2.36
38	600985	淮北矿业	13,693,317.00	2.35
39	600157	永泰能源	13,553,564.00	2.33
40	688169	石头科技	13,513,935.65	2.32
41	000400	许继电气	13,497,474.00	2.32
42	300285	国瓷材料	13,472,164.00	2.32
43	601696	中银证券	13,405,423.12	2.30
44	002340	格林美	13,302,297.00	2.29
45	600399	抚顺特钢	13,200,038.00	2.27
46	601997	贵阳银行	13,170,186.00	2.26
47	603939	益丰药房	12,912,302.90	2.22
48	603160	汇顶科技	12,753,544.00	2.19
49	603228	景旺电子	12,702,886.00	2.18
50	600109	国金证券	12,623,806.00	2.17
51	603596	伯特利	12,526,508.40	2.15
52	600885	宏发股份	12,449,486.16	2.14
53	000598	兴蓉环境	12,425,186.00	2.14
54	300012	华测检测	12,292,007.00	2.11
55	603338	浙江鼎力	12,225,600.00	2.10
56	002353	杰瑞股份	12,212,654.00	2.10
57	002409	雅克科技	12,176,420.00	2.09
58	000039	中集集团	12,154,156.20	2.09
59	600529	山东药玻	12,122,920.00	2.08
60	600642	申能股份	12,079,682.00	2.08
61	002625	光启技术	11,882,243.00	2.04
62	603589	口子窖	11,799,412.00	2.03
63	000988	华工科技	11,794,427.16	2.03
64	002465	海格通信	11,659,857.94	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	32,670,274.53	5.62
2	002463	沪电股份	21,831,413.62	3.75
3	601058	赛轮轮胎	19,150,721.32	3.29

4	300394	天孚通信	18,113,842.60	3.11
5	002517	恺英网络	18,022,794.00	3.10
6	002384	东山精密	17,528,767.00	3.01
7	601577	长沙银行	17,281,414.00	2.97
8	002138	顺络电子	17,243,774.60	2.96
9	000975	银泰黄金	17,151,525.00	2.95
10	600079	人福医药	17,082,575.60	2.94
11	600699	均胜电子	16,706,793.00	2.87
12	002156	通富微电	16,673,767.74	2.87
13	300001	特锐德	16,601,954.78	2.85
14	601077	渝农商行	16,506,987.00	2.84
15	600066	宇通客车	16,164,337.17	2.78
16	601555	东吴证券	15,845,092.00	2.72
17	002273	水晶光电	15,811,713.00	2.72
18	600988	赤峰黄金	15,703,910.00	2.70
19	688188	上海柏楚电 子科技	15,247,292.96	2.62
20	300207	欣旺达	15,246,048.59	2.62
21	000933	神火股份	15,208,383.00	2.61
22	002028	思源电气	15,074,742.00	2.59
23	002422	科伦药业	14,744,893.53	2.54
24	002966	苏州银行	14,546,268.30	2.50
25	600418	江淮汽车	14,514,613.00	2.50
26	002472	双环传动	14,471,068.00	2.49
27	000423	东阿阿胶	14,415,221.00	2.48
28	601168	西部矿业	14,410,407.00	2.48
29	600161	天坛生物	14,387,505.00	2.47
30	002078	太阳纸业	14,184,614.00	2.44
31	000960	锡业股份	14,139,525.94	2.43
32	603816	顾家家居	14,116,067.80	2.43
33	601128	常熟银行	13,978,701.50	2.40
34	601233	桐昆股份	13,803,818.62	2.37
35	600096	云天化	13,803,587.00	2.37
36	688099	晶晨半导体	13,758,508.21	2.37
37	601966	玲珑轮胎	13,665,033.00	2.35
38	600157	永泰能源	13,580,887.00	2.33
39	600985	淮北矿业	13,350,242.00	2.30
40	688169	石头科技	13,309,347.14	2.29
41	600642	申能股份	13,068,923.12	2.25
42	600399	抚顺特钢	13,012,693.00	2.24
43	603160	汇顶科技	12,991,084.76	2.23
44	300285	国瓷材料	12,906,309.00	2.22
45	603228	景旺电子	12,842,514.00	2.21
46	000400	许继电气	12,706,334.89	2.18

47	002340	格林美	12,648,837.00	2.17
48	000598	兴蓉环境	12,644,013.00	2.17
49	002558	巨人网络	12,504,298.00	2.15
50	603596	伯特利	12,488,240.60	2.15
51	601696	中银证券	12,397,927.00	2.13
52	600109	国金证券	12,198,600.00	2.10
53	002353	杰瑞股份	12,182,827.00	2.09
54	300012	华测检测	12,072,874.00	2.08
55	002465	海格通信	12,059,901.42	2.07
56	002268	电科网安	12,038,597.00	2.07
57	601997	贵阳银行	12,016,985.00	2.07
58	002625	光启技术	11,929,591.00	2.05
59	000988	华工科技	11,881,515.84	2.04
60	600498	烽火通信	11,793,180.00	2.03
61	603939	益丰药房	11,758,958.60	2.02
62	603338	浙江鼎力	11,713,061.00	2.01
63	002409	雅克科技	11,672,280.00	2.01
64	601198	东兴证券	11,638,266.50	2.00
65	600529	山东药玻	11,634,902.00	2.00
66	603589	口子窖	11,634,052.00	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,365,347,826.89
卖出股票收入（成交）总额	8,588,599,345.12

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	1,892,283.68
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	25,674.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
-	-	-
8	其他	-
9	合计	1,917,958.00

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	102	166715.56	3987792.94	23.45	13017194.38	76.55
国海量化 优选一年 持有股票 C	5,564	34135.20	7126379.54	3.75	182801862.88	96.25
合计	5,666	36521.93	11114172.48	5.37	195819057.26	94.63

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	417,494.90	2.46
	国海量化优选一年持有股票 C	2,115,974.58	1.11
	合计	2,533,469.48	1.22

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	0
	国海量化优选一年持有股 票 C	0~10
	合计	0~10
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	0
	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	—
本报告期初基金份额总额	22,681,249.41	319,286,402.76
本报告期基金总申购份额	—	4,613,769.40
减：本报告期基金总赎回份额	5,676,262.09	133,971,929.74
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	17,004,987.32	189,928,242.42

§ 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

基金管理人本报告期基金管理人重大人事变动如下：

1. 2024 年 2 月 1 日，公司召开第十届董事会第一次会议，聘任度万中先生为公司总裁，度万中先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行总裁职责；聘任汪成接先生为公司副总裁，汪成接先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行副总裁职责；聘任张宁先生为公司首席信息官，张宁先生自 2024 年 2 月 1 日起正式履行首席信息官职责；因任期届满，蒋健先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司副总裁，温力先生自 2024 年 2 月 1 日起不再担任公司首席信息官。

2. 2024 年 10 月 29 日，吴凌翔先生因个人原因辞去公司副总裁兼首席风险官职务；2024 年 10 月 30 日，公司召开第十届董事会第六次会议，聘任高菲女士为公司首席风险官。

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

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 28,000.00 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关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	16,953,920,586.49	100.00	5,864,357.07	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	-	-	10,000,000.00	100.00	-	-

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基金行业高	中国证监会规定报刊及	2024 年 1 月 3 日

	级管理人员变更公告	规定网站	
2	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 年第四季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 1 月 22 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 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定网站	2024 年 1 月 22 日
4	国海证券股份有限公司基金行业高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 2 月 6 日
5	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	2024 年 2 月 7 日
6	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 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 3 月 29 日
7	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 年年度管理报告	中国证监会规定网站	2024 年 3 月 29 日
8	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 2024 年第一季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 4 月 22 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 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定网站	2024 年 4 月 22 日
10	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	2024 年 5 月 15 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（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	2024 年 6 月 28 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（国海量化优选一年持有股票 C 份额）基金产品资料概要更新	中国证监会规定网站	2024 年 6 月 28 日
13	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 2024 年第二季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 7 月 19 日
14	国海证券量化优选一年持有期股票	中国证监会规定网站	2024 年 7 月 19 日

	型集合资产管理计划 2024 年第 2 季度报告		
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	2024 年 8 月 15 日
16	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暂停申购、定期定额投资公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 8 月 16 日
17	国海证券股份有限公司关于国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 8 月 20 日
18	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（更新）	中国证监会规定网站	2024 年 8 月 20 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招募说明书更新	中国证监会规定网站	2024 年 8 月 20 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（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（2024 年 8 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 8 月 20 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（国海量化优选一年持有股票 C 份额）基金产品资料概要更新（2024 年 8 月）	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 8 月 20 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基金恢复申购、定期定额投资公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 8 月 30 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基金暂停大额申购公告	中国证监会规定报刊及规定网站	2024 年 8 月 30 日
24	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 2024 年中期报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 8 月 30 日
25	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2024 年中期报告	中国证监会规定网站	2024 年 8 月 30 日
26	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 2024 年第三季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊	2024 年 10 月 25 日
27	国海证券股份有限公司基金行业高	中国证监会规定报刊及	2024 年 10 月 31 日

	级管理人员变更公告	规定网站	
28	国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定网站	2024 年 10 月 25 日
29	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	2024 年 11 月 14 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：本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会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

2025 年 3 月 31 日