

信澳量化多因子混合型证券投资基金
(LOF)
2025 年年度报告
2025 年 12 月 31 日

基金管理人：信达澳亚基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年三月三十日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（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 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	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.....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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.....	16
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.....	16
§6 审计报告	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 净资产变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况.....	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	95
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.....	95
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.....	96

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	96
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	96
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	96
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	96
8.12 投资组合报告附注	96
§9 基金份额持有人信息	97
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	97
9.2 期末上市基金前十名持有人	98
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	98
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	98
§10 开放式基金份额变动	98
§11 重大事件揭示	99
11.1 基金份额持有人大会决议	99
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	99
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	99
11.4 基金投资策略的改变	99
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	100
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	100
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	100
11.8 其他重大事件	102
§12 影响投资者决策的其他重要信息	103
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	103
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	103
§13 备查文件目录	104
13.1 备查文件目录	104
13.2 存放地点	104
13.3 查阅方式	104

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)	
基金简称	信澳量化多因子混合 (LOF)	
场内简称	多因子 LOF	
基金主代码	166107	
交易代码	166107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 11 月 6 日	
基金管理人	信达澳亚基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	71,487,785.01 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2019 年 11 月 28 日	
下属分级基金的基金简称	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C
下属分级基金的场内简称	多因子 LOF	-
下属分级基金的交易代码	166107	166108
报告期末下属分级基金的份额总额	28,881,583.10 份	42,606,201.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	利用定量投资模型，在严格控制风险的前提下，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金采用数量化模型驱动的选股策略为主导投资策略，结合适当的资产配置策略，并依靠严格的投资纪律和风险控制，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信达澳亚基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	余源志	许俊
	联系电话	0755-83172666	010-66596688

电子邮箱	service@fscinda.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话	400-8888-118	95566
传真	0755-83196151	010-66594942
注册地址	广东省深圳市南山区粤海街道海珠社区科苑南路 2666 号中国华润大厦 L1001	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518054	100818
法定代表人	朱永强	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fscinda.com
基金年度报告备置地点	广东省深圳市南山区粤海街道科苑南路 2666 号中国华润大厦 10 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	
	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C
本期已实现收益	3,841,748.02	15,080,122.18	121,422.15	-409,369.34	-3,488,822.88	-13,019,008.46
本期利润	4,327,180.38	15,621,292.85	115,214.50	446,423.23	-3,323,931.21	-13,899,623.20
加权平均基金	0.4547	0.4637	0.0162	0.0132	-0.2079	-0.2015

份额本期利润						
本期加权平均净值利润率	34.85%	37.30%	1.73%	1.48%	-20.27%	-20.28%
本期基金份额净值增长率	34.62%	33.55%	9.59%	8.69%	-6.77%	-7.51%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C
期末可供分配利润	12,692,294.02	15,677,359.66	340,108.90	251,071.98	-200,718.97	-4,765,467.48
期末可供分配基金份额利润	0.4395	0.3680	0.0693	0.0243	-0.0243	-0.0576
期末基金资产净值	41,573,877.12	58,283,561.57	5,250,511.14	10,576,440.97	8,066,443.71	77,972,969.11
期末基金份额净值	1.4395	1.3680	1.0693	1.0243	0.9757	0.9424
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C	信澳量化多因子混合(LOF) A	信澳量化多因子混合(LOF) C
基金份额累计净值增长率	43.95%	36.80%	6.93%	2.43%	-2.43%	-5.76%

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

2、上述业绩指标不包括持有人交易投资组合的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

信澳量化多因子混合（LOF）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	2.48%	0.94%	0.71%	1.18%	1.77%	-0.24%
过去六个月	19.58%	0.87%	24.81%	1.11%	-5.23%	-0.24%
过去一年	34.62%	1.07%	28.81%	1.20%	5.81%	-0.13%
过去三年	37.54%	1.23%	26.25%	1.30%	11.29%	-0.07%
过去五年	2.33%	1.28%	16.99%	1.23%	-14.66%	0.05%
自基金合同生效起至今	43.95%	1.33%	46.76%	1.28%	-2.81%	0.05%

信澳量化多因子混合（LOF）C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	2.27%	0.94%	0.71%	1.18%	1.56%	-0.24%
过去六个月	19.10%	0.87%	24.81%	1.11%	-5.71%	-0.24%
过去一年	33.55%	1.07%	28.81%	1.20%	4.74%	-0.13%
过去三年	34.26%	1.23%	26.25%	1.30%	8.01%	-0.07%
过去五年	-1.84%	1.28%	16.99%	1.23%	-18.83%	0.05%
自基金合同生效起至今	36.80%	1.33%	46.76%	1.28%	-9.96%	0.05%

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

信澳量化多因子混合（LOF）A 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2019年11月6日至2025年12月31日）



信澳量化多因子混合（LOF）C 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势
对比图

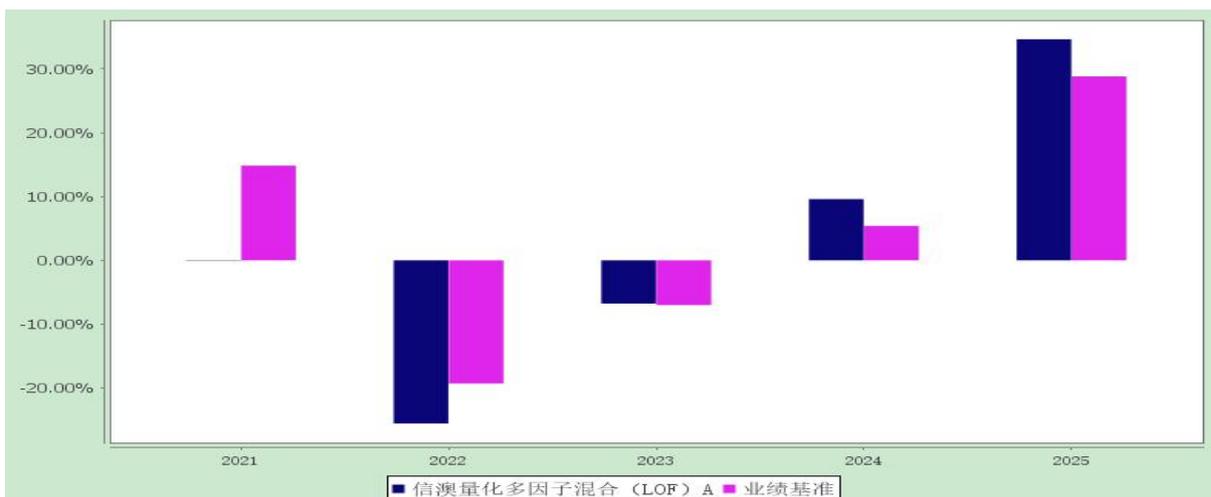
（2019 年 11 月 6 日至 2025 年 12 月 31 日）



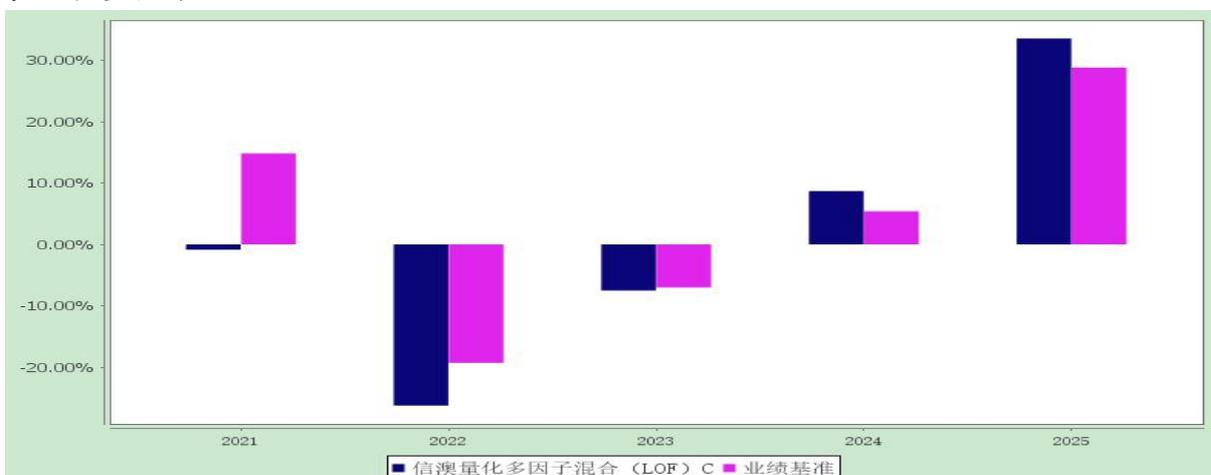
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

信澳量化多因子混合（LOF）A



信澳量化多因子混合 (LOF) C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年基金无利润分配情况。

§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

本基金管理人信达澳亚基金管理有限公司（原“信达澳银基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经中国证监会批准（批准文号：中国证监会证监基金字[2006]71号文）成立于2006年6月5日成立。公司注册资本1亿元人民币，总部设在中国深圳，在北京和上海设有分公司，是由中国信达资产管理股份有限公司（以下简称“中国信达”）和澳大利亚联邦银行全资子公司设立的合资公司。2015年5月22日，信达证券股份有限公司受让中国信达资产管理股份有限公司持有的股权，与 East Topco Limited 共同持有公

公司股份，持股比例分别为 54%和 46%。2022 年 3 月 21 日，由于公司外方股东的实际控制人变更，以及公司国际化发展战略需要，公司正式更名为信达澳亚基金管理有限公司。2025 年 6 月 5 日，经中国证券监督管理委员会核准，公司实际控制人由中华人民共和国财政部变更为中央汇金投资有限公司，公司控股股东仍为信达证券股份有限公司。截至 2025 年 12 月 31 日，公司共管理 94 只公募基金产品。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯玺祥	本基金的基金经理	2023-03-15	-	5.5 年	北京大学理学硕士。2020 年 2 月至 2022 年 9 月于桐昇通惠资产管理有限公司负责管理指数增强类产品。2022 年 10 月加入信达澳亚基金。曾任信澳鑫悦智选 6 个月持有期混合基金基金经理（2023 年 12 月 22 日起至 2025 年 1 月 7 日）、信澳宁隼智选混合基金基金经理（2023 年 12 月 19 日至 2025 年 12 月 30 日）、信澳量化先锋基金基金经理（2024 年 12 月 4 日起至 2026 年 1 月 15 日）。现任信澳量化多因子基金基金经理（2023 年 3 月 15 日至今）、信澳星耀智选混合基金基金经理（2023 年 8 月 22 日至今）、信澳双创智选混合基金基金经理（2023 年 10 月 16 日至今）、信澳星亮智选混合基金基金经理（2024 年 1 月 30 日起至今）、信澳星煜智选混合基金基金经理（2024 年 2 月 20 日起至今）。
张琦	本基金的基金经理	2022-03-23	2025-03-14	9 年	莱斯特大学应用数学博士。2016 年至 2017 年于鹏华基金任金融工程师，2018 年加入信达澳亚基金管理有限公司任投资经理，基金经理助理。任信澳量化多因子基金

					基金经理（2022 年 3 月 23 日至 2025 年 3 月 14 日）。
--	--	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期、离任日期为根据公司决定确定的任职或离任日期。
2、证券从业的含义遵从行业协会从业人员资格管理办法的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生损害基金持有人利益的行为。

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》和《信达澳亚基金管理有限公司公平交易实施办法》在投资决策、交易执行、风险监控等环节建立了严谨的内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，严谨的公平交易机制，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、业务流程和技术手段保证公平交易原则的贯彻，确保不同投资组合在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各投资组合间公平分配交易量，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

本基金管理人通过风险监控信息系统对不同投资组合同向交易进行公平交易分析，分别于每季度和每年度对本基金管理人管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别(股票、债券)的收益率差异等进行分析，形成公平交易制度执行情况分析报告。通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。若发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人已经建立了投资决策及交易内控制度，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，维护投资者的利益。本基金管理人建立了严谨的公平交易机制，确保

不同基金在买卖同一证券时，按照比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。公司对报告期内公司所管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析；利用数据统计和重点审查价差原因相结合的方法，对连续四个季度内、不同时间窗口（日内、3日内、5日内）公司管理的不同投资组合同向交易价差进行了分析；对部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易进行了审核和监控，未发现公司所管理的投资组合存在违反公平交易原则的情形。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司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未出现超过该证券当日成交量的 5%的情况。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

2025 年 A 股市场呈现震荡上行的结构性牛市特征，主要指数均实现显著上涨，成长与周期板块成为核心驱动力。一季度初始市场风险偏好降低，指数向下调整，成交额一度跌破万亿关口，春节前后，DeepSeek 等概念持续发酵，引发科技企业估值重估，AI 主题成为热点，带动投资者情绪回暖，小盘成长风格表现突出。三月中旬后，TMT 板块交易过热引发兑现压力，叠加关税政策不确定性，市场进入调整阶段，上证指数于 4 月 7 日一度跌至 3040 点。随后，市场情绪从极度恐慌转向结构性修复，指数展开显著反弹。进入 5 月，随着关税不确定性边际缓解及国内系列宽松政策出台，市场震荡上行，最终在 6 月下旬上证指数成功突破 3400 点整数关口。三季度，市场呈现加速上涨后调整的走势：7 月至 8 月底，随着宏观事件不确定性的减弱，市场情绪回暖，指数一路上行；9 月份以后随着获利盘的兑现，指数进行震荡调整阶段，市场呈现赛道高切低的行情。整个三季度的主线是以科技股为主的成长行情，其中龙头股表现更为突出，风格上前期强势的小微盘及红利价值股转弱。四季度市场走势呈震荡态势，随着十五五政策发布及关税问题的缓和，市场一路上行突破 4000 点；11 月中旬至 12 月中旬业绩及政策均处于空窗期，投资者情绪持续降温，前期强势的科技成长股回调，市场也一路下跌；12 月中旬以后，政治局会议与中央经济工作会议召开，强化改革与内需主线，带动市场情绪提

振，美联储降息落地，春季躁动有所提前，上证指数迎来连续上涨行情。

指数上来说，全年沪深 300 指数 17.66%，中证 500 指数 30.39%，中证 1000 指数 27.49%，中证 2000 指数 36.42%，创业板指 49.57%，科创 50 指数 35.92%，双创 50 指数 60.86%，中证红利全收益指数 3.76%。行业上来说，全年有色金属、通信、电子涨幅居前，食品饮料、煤炭是全年唯二下跌的行业。

风格上来看，小盘成长指数 40.84%，小盘价值指数 18.50%，中盘成长指数 27.46%，中盘价值指数 17.89%，大盘成长指数 28.16%，大盘价值指数 6.19%。总的来说，本报告期内，成长相对价值占优，小盘相对大盘占优。

本基金专注于“指数+”策略，采用量化方法，通过对基准的分析，选择合适的因子构建模型，在全市场范围内选择股票，并在风险模型的帮助下有效控制对基准的偏离，目标是在一定的跟踪误差范围内实现对基准的持续超越。相较于传统的主动量化策略，“指数+”策略更加重视对基准的分析和偏离；相较于传统指数增强策略，“指数+”策略摆脱了传统控制成分股暴露的限制，将主动风险放在更高性价比的地方。

基金以中证 500 为基准，对标中证 500 的行业和风格，运用多因子模型从全市场可投股票池中优选模型打分高的标的来配置。其中，量化打分逻辑从基本面价值出发，综合考虑个股的估值、质量、成长性和当前交易特征等多方面信息。我们更加注重基本面信息在模型中的作用，而不仅仅依赖于相对黑箱的机器学习技术，所有因子设计和策略设计都基于人类的洞见，可解释、可分析、可验证。在量化方法下，在行业和风格上我们对标中证 500，个股持仓方面会相对分散。本报告期内产品获取了正的超额收益，从归因上看，成长、市值因子为我们带来了正贡献，贝塔、反转等因子为我们带来了负贡献。在未来我们也会坚持既有模型和策略，在风格和行业上对标基准，注重在风格和行业内的多因子选股，发挥量化投资在分散化选股和跟踪误差管理方面的特色。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，A 类基金份额：基金份额净值为 1.4395 元，份额累计净值为 1.4395 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 34.62%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%。

截至报告期末，C 类基金份额：基金份额净值为 1.3680 元，份额累计净值为 1.3680 元，本报告期内，本基金份额净值增长率为 33.55%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年，全年实际 GDP 同比增长 5.0%，顺利达成预期目标，呈现“前高后低”走势。从生产端结构来看，第二产业 GDP 增速回落，第三产业 GDP 增速回升，二者相互对冲使得整体 GDP 增速较为稳定。结构看，供给强于需求，外需强于内需，具体数据上，全年工业增加值同比 5.9%，社零同比 3.7%，固定资产投资同比-3.8%，出口累计同比 5.5%。CPI、PPI 均有所走弱，CPI 同比中枢 0%；PPI 同比中枢-2.6%。

展望 2026 年，中央经济工作会议会议指出，要继续实施适度宽松的货币政策，把促进经济稳定增长、物价合理回升作为货币政策的重要考量，灵活高效运用降准降息等多种政策工具，保持流动性充裕。多数省份陆续确定各自“十五五”开局年目标，主要内容涵盖促进消费和投资、制造业转型升级、全方位扩大内需等，各地还因地制宜推出了很多个性化目标。A 股盈利有望延续温和复苏，继续支撑 A 股市场中期向上空间。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人严格按照规范运作、保障基金份额持有人利益出发的原则，对各业务条线、日常经营管理、投资交易、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期稽核检视，并定期制作监察稽核报告向公司董事会进行报告。本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作重点完成了以下几个方面：

(1) 根据法律法规、监管要求以及公司业务开展实际，适时调整公司内部控制制度，强化公司内部控制体系建设。

(2) 落实合规文化建设与合规文化宣导，着力提升员工的法律合规意识。

(3) 监督后台运营业务安全、准确运行，推进完善信息技术系统。

(4) 监督市场营销、基金销售的合规性。

(5) 加强对员工包括投资管理人员的监察监督，严格执行防范投资人员合规风险的有关措施。

本基金管理人将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值工作严格按照相关法律法规、基金合同以及《信达澳亚基

金管理有限公司估值委员会议事规则》进行。

为确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，本基金管理人设立了估值委员会；估值委员会负责人由分管运营的公司领导担任；估值委员会成员由权益投资部门、固收投资部门、风险控制部、监察稽核部、基金核算部指定专人并经公司经营管理委员会审议通过后担任；估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

基金经理对基金的估值原则和估值程序可以提出建议，但不参与最终决策和日常估值工作。参与估值流程各方包括基金托管人和会计师事务所，各方之间不存在任何重大利益冲突。

截止报告期末，本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票流动性折扣、预期信用损失等估值参考数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金管理人可以根据基金实际运作情况进行利润分配。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，截至报告期末本基金资产净值已达到五千万元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2026）审字第 70013104_H24 号

信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时，管理层负责评估信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于

舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)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信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

高鹤 姚磊

北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层

2026年3月27日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	8,938,047.16	1,210,069.51
结算备付金		632,820.34	149,879.19
存出保证金		44,193.59	17,012.24
交易性金融资产	7.4.7.2	92,753,480.13	14,535,680.20

其中：股票投资		92,753,480.13	14,535,680.20
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	-	-
应收清算款		-	2,660.72
应收股利		-	-
应收申购款		4,257,392.66	46,710.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		106,625,933.88	15,962,011.86
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024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		2,766,277.43	89.11
应付赎回款		3,646,334.08	34,337.96
应付管理人报酬		90,404.74	17,731.75
应付托管费		15,067.45	2,955.30
应付销售服务费		36,160.65	8,208.02
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	214,250.84	71,737.61
负债合计		6,768,495.19	135,059.75
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	71,487,785.01	15,235,771.23
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	28,369,653.68	591,180.88
净资产合计		99,857,438.69	15,826,952.11
负债和净资产总计		106,625,933.88	15,962,011.86

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 71,487,785.01 份。其中信澳量化多因子混合（LOF）A 基金份额净值 1.4395 元，基金份额总额 28,881,583.10 份；信澳量化多因子混合（LOF）C 基金份额净值 1.3680 元，基金份额总额 42,606,201.91 份。

7.2 利润表

会计主体：信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2025年1月1日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至 2024年12月31日
一、营业总收入		21,041,680.55	1,330,672.05
1. 利息收入		70,835.65	18,695.68
其中：存款利息收入	7.4.7.9	23,767.72	16,336.05
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		47,067.93	2,359.63
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,882,528.61	448,372.28
其中：股票投资收益	7.4.7.10	19,349,054.61	-224,456.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	533,474.00	672,829.07
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	1,026,603.03	849,584.92
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	61,713.26	14,019.17
减：二、营业总支出		1,093,207.32	769,034.32
1. 管理人报酬	7.4.10.2	633,019.19	446,764.69
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2	105,503.22	74,460.80
3. 销售服务费	7.4.10.2	324,822.13	244,154.29
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	7.4.7.16	-	-

7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.17	29,862.78	3,654.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		19,948,473.23	561,637.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		19,948,473.23	561,637.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		19,948,473.23	561,637.73

7.3 净资产变动表

会计主体：信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	15,235,771.23	591,180.88	15,826,952.11
二、本期期初净资产	15,235,771.23	591,180.88	15,826,952.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	56,252,013.78	27,778,472.80	84,030,486.58
（一）、综合收益总额	-	19,948,473.23	19,948,473.23
（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）	56,252,013.78	7,829,999.57	64,082,013.35
其中：1.基金申购款	290,697,698.28	65,342,264.72	356,039,963.00
2.基金赎回款	-234,445,684.50	-57,512,265.15	-291,957,949.65
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	71,487,785.01	28,369,653.68	99,857,438.69
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	91,005,599.27	-4,966,186.45	86,039,412.82
二、本期期初净资产	91,005,599.27	-4,966,186.45	86,039,412.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-75,769,828.04	5,557,367.33	-70,212,460.71
（一）、综合收益总额	-	561,637.73	561,637.73
（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）	-75,769,828.04	4,995,729.60	-70,774,098.44
其中：1. 基金申购款	65,663,151.71	-6,494,672.25	59,168,479.46
2. 基金赎回款	-141,432,979.75	11,490,401.85	-129,942,577.90
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	15,235,771.23	591,180.88	15,826,952.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

方敬

方敬

刘玉兰

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

信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 503 号《关于准予信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)注册的批复》核准,由信达澳银基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。募集期结束经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2019)验字第 60467227_H05 号验资报告后,向中国证监会备案。基金合同于 2019 年 11 月 6 日正式生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。首次设立募集的有效净认购资金(本金)为人民币 332,223,354.35 元,在首次募集期间有效认购资金产生的利息为人民币 107,414.46 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 332,330,768.81 元,折合 332,330,768.81 份基金份额。本基金的基金管理人为信达澳银基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。2022 年 3 月 21 日,基金管理人公司名称变更为“信达澳亚基金管理有限公司”。2022 年 06 月 01 日,本基金名称变更为“信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)”。

根据 2019 年 11 月 6 日生效的《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》(以下简称“基金合同”)及《信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)招募说明书》(以下简称“招募说明书”),信达澳银量化多因子混合型证券投资基金(LOF)根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用,而不从本类别基金资产中计提销售服务费的,为 A 类基金份额;在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的,为 C 类基金份额。两类基金份额单独设置基金代码,并分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及招募说明书的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、可转换债券、分离交易可转债、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、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许

基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票及存托凭证资产占基金资产的比例为 60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或

资产)或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值,是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债,假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行;不存在主要市场的,本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本

基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

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

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金

融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加、红利再投资所引起的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利

的权利已经确立；2) 与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3) 股利的金额能够可靠计量。

(3) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致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确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期间无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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。

(2) 增值税及附加

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人。

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（3）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄

存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	8,938,047.16	1,210,069.51
等于：本金	8,937,207.12	1,209,966.19
加：应计利息	840.04	103.32
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	8,938,047.16	1,210,069.51

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	91,898,594.82	-	92,753,480.13	854,885.31
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	91,898,594.82	-	92,753,480.13	854,885.31
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	14,707,397.92	-	14,535,680.20	-171,717.72
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	14,707,397.92	-	14,535,680.20	-171,717.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,261.27	0.58
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	202,660.80	71,737.03
其中：交易所市场	202,660.80	71,737.03
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	4,328.77	-
合计	214,250.84	71,737.61

7.4.7.7 实收基金

信澳量化多因子混合（LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,910,402.24	4,910,402.24
本期申购	44,886,087.92	44,886,087.92
本期赎回（以“-”号填列）	-20,914,907.06	-20,914,907.06
本期末	28,881,583.10	28,881,583.10

信澳量化多因子混合（LOF）C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	10,325,368.99	10,325,368.99
本期申购	245,811,610.36	245,811,610.36
本期赎回（以“-”号填列）	-213,530,777.44	-213,530,777.44
本期末	42,606,201.91	42,606,201.91

注：本基金申购含红利再投份额（如有）、转换入份额（如有）、级别调整入份额（如有）；赎回含转出份额（如有）。

7.4.7.8 未分配利润

信澳量化多因子混合（LOF）A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,054,150.13	-714,041.23	340,108.90
本期期初	1,054,150.13	-714,041.23	340,108.90
本期利润	3,841,748.02	485,432.36	4,327,180.38
本期基金份额交易产生的变动数	12,217,764.42	-4,192,759.68	8,025,004.74
其中：基金申购款	22,300,654.09	-6,869,914.35	15,430,739.74
基金赎回款	-10,082,889.67	2,677,154.67	-7,405,735.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,113,662.57	-4,421,368.55	12,692,294.02

信澳量化多因子混合 (LOF) C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,732,000.64	-1,480,928.66	251,071.98
本期期初	1,732,000.64	-1,480,928.66	251,071.98
本期利润	15,080,122.18	541,170.67	15,621,292.85
本期基金份额交易产生的变动数	5,284,096.35	-5,479,101.52	-195,005.17
其中：基金申购款	79,019,950.19	-29,108,425.21	49,911,524.98
基金赎回款	-73,735,853.84	23,629,323.69	-50,106,530.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,096,219.17	-6,418,859.51	15,677,359.66

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	21,186.29	10,555.51
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,387.38	5,051.61
其他	194.05	728.93
合计	23,767.72	16,336.05

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	523,443,623.60	482,455,857.79
减：卖出股票成本总额	503,258,658.80	481,810,127.28
减：交易费用	835,910.19	870,187.30
买卖股票差价收入	19,349,054.61	-224,456.79

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本期及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	533,474.00	672,829.07
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	533,474.00	672,829.07

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	1,026,603.03	849,584.92
——股票投资	1,026,603.03	849,584.92
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	1,026,603.03	849,584.92

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	61,713.26	14,019.17
合计	61,713.26	14,019.17

注：（1）本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产即

为基金赎回费收入。

(2)本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成,其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产即为基金转换费收入。

7.4.7.16 信用减值损失

本基金本期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	4,328.77	-
信息披露费	17,315.00	-
证券出借违约金	-	-
银行结算费用	8,219.01	3,654.54
合计	29,862.78	3,654.54

7.4.7.18 分部报告

截至本报告期末,本基金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。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日,本基金无需要说明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
信达澳亚基金管理有限公司 (“信达澳亚基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司 (“中国银行”)	基金托管人、基金代销机构
信达证券股份有限公司 (“信达证券”)	基金管理人的控股股东、基金代销机构

East Topco Limited	基金管理人的股东
惠达新兴（北京）项目管理有限公司	基金管理人的参股公司
中国信达资产管理股份有限公司	对公司法人股东直接持股 20%以上的股东

注：1、2024 年 7 月 10 日，经基金管理人的股东信达证券批准并完成审计评估后，基金管理人通过上海联合产权交易所公开挂牌转让其持有的信达新兴财富（北京）资产管理有限公司 60%的股权给贵州盛云投资有限公司；完成股权转让后，信达新兴财富（北京）资产管理有限公司于 2024 年 9 月 29 日办理工商变更，更名为惠达新兴（北京）项目管理有限公司。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	633,019.19	446,764.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	279,119.64	92,891.70
应支付基金管理人的净管理费	353,899.55	353,872.99

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	105,503.22	74,460.80

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提，每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.2%/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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C	合计
中国银行股份有限公司	-	270,771.73	270,771.73
信达澳亚基金公司	-	-	-
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	270,771.73	270,771.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C	合计
中国银行股份有限公司	-	200.16	200.16
信达澳亚基金公司	-	8,017.92	8,017.92
信达证券股份有限公司	-	-	-
合计	-	8,218.08	8,218.08

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类份额的年销售服务费率为 0.8%。销售服务费每日计提，按月支付，在次月初支付给信达澳亚基金公司，再由信达澳亚基金公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类份额的基金资产净值×0.8%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行转融通证券出借交易。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	信澳量化多因子混合 (LOF) A	信澳量化多因子混合 (LOF) C
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	1,255,209.65	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,255,209.65	-
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	1.76%	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本年度末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
中国银行 股份有限公司	8,938,047.16	21,186.29	1,210,069.51	10,555.51

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配情况。

7.4.12 期末（2025 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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	1,300	100,745.22	102,453.00	-

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

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无抵押债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有从事转融通证券出借业务交易的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围主要为具有良好流动性的股票投资和债券投资等。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由

董事会风险控制委员会、经营层风险管理委员会、督察长、风险控制部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在董事会下设立风险控制委员会，负责审定重大风险管理战略、风险政策和风险控制制度；在经营层面设立风险管理委员会，对公司风险管理和控制政策、程序的制定、风险限额的设定等提出意见和建议，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面的风险控制主要由风险控制部、监察稽核部负责督促与协调，各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务，员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行与该银行存款相关的信用风险不重大。

本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于本报告期末，本基金未持有债券投资。

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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》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开放式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模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2025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	8,938,047.16	-	-	-	8,938,047.16
结算备付金	632,820.34	-	-	-	632,820.34
存出保证金	44,193.59	-	-	-	44,193.59
交易性金融资产	-	-	-	92,753,480.13	92,753,480.13
应收申购款	-	-	-	4,257,392.66	4,257,392.66
资产总计	9,615,061.09	-	-	97,010,872.79	106,625,933.88
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,646,334.08	3,646,334.08
应付管理人报酬	-	-	-	90,404.74	90,404.74
应付托管费	-	-	-	15,067.45	15,067.45
应付清算款	-	-	-	2,766,277.43	2,766,277.43
应付销售服务费	-	-	-	36,160.65	36,160.65
其他负债	-	-	-	214,250.84	214,250.84
负债总计	-	-	-	6,768,495.19	6,768,495.19
利率敏感度缺口	9,615,061.09	-	-	90,242,377.60	99,857,438.69
上年度末 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	1,210,069.51	-	-	-	1,210,069.51
结算备付金	149,879.19	-	-	-	149,879.19
存出保证金	17,012.24	-	-	-	17,012.24
交易性金融资产	-	-	-	14,535,680.20	14,535,680.20
应收申购款	-	-	-	46,710.00	46,710.00
应收清算款	-	-	-	2,660.72	2,660.72
资产总计	1,376,960.94	-	-	14,585,050.92	15,962,011.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	34,337.96	34,337.96
应付管理人报酬	-	-	-	17,731.75	17,731.75
应付托管费	-	-	-	2,955.30	2,955.30
应付清算款	-	-	-	89.11	89.11

应付销售服务费	-	-	-	8,208.02	8,208.02
其他负债	-	-	-	71,737.61	71,737.61
负债总计	-	-	-	135,059.75	135,059.75
利率敏感度缺口	1,376,960.94	-	-	14,449,991.17	15,826,952.11

注：上表按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者对金融资产和金融负债的期限予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末，本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	92,753,480.13	92.89	14,535,680.20	91.84

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	92,753,480.13	92.89	14,535,680.20	91.84

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 500 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	中证 500 指数上升 5%	3,772,230.93	692,625.16
	中证 500 指数下降 5%	-3,772,230.93	-692,625.16

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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	92,651,027.13	14,535,680.20
第二层次	102,453.00	-
第三层次	-	-
合计	92,753,480.13	14,535,680.20

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一

致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于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 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

本基金于本期初及上年度期初均未持有公允价值归属于第三层次的金融工具，本基金于本期及上年度可比期间亦均未发生第三层次公允价值转入转出情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 03 月 27 日经本基金的基金管理人批准报出。

§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	项目	金额	占基金总资产的比例

号			(%)
1	权益投资	92,753,480.13	86.99
	其中：股票	92,753,480.13	86.99
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	9,570,867.50	8.98
8	其他各项资产	4,301,586.25	4.03
9	合计	106,625,933.88	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值	金额单位：人民币元 占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	99,224.00	0.10
B	采矿业	3,376,578.00	3.38
C	制造业	67,096,323.87	67.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,578,074.00	3.58
E	建筑业	1,348,559.00	1.35
F	批发和零售业	2,815,854.00	2.82
G	交通运输、仓储和邮政业	990,118.00	0.99
H	住宿和餐饮业	177,452.00	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,411,117.89	5.42
J	金融业	2,817,871.00	2.82
K	房地产业	1,087,607.00	1.09
L	租赁和商务服务业	1,393,419.00	1.40
M	科学研究和技术服务业	1,837,789.37	1.84
N	水利、环境和公共设施管理业	363,369.00	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,500.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	222,336.00	0.22
S	综合	117,288.00	0.12

合计	92,753,480.13	92.89
----	---------------	-------

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,300	844,698.00	0.85
2	002414	高德红外	48,800	715,896.00	0.72
3	688002	睿创微纳	6,668	672,134.40	0.67
4	688772	珠海冠宇	30,998	667,386.94	0.67
5	002156	通富微电	16,600	625,820.00	0.63
6	002236	大华股份	32,100	607,974.00	0.61
7	601991	大唐发电	167,400	584,226.00	0.59
8	688612	威迈斯	17,598	580,206.06	0.58
9	002511	中顺洁柔	67,500	577,800.00	0.58
10	002396	星网锐捷	18,600	563,580.00	0.56
11	601339	百隆东方	94,000	544,260.00	0.55
12	603259	药明康德	5,900	534,776.00	0.54
13	002402	和而泰	13,000	508,560.00	0.51
14	600011	华能国际	66,900	499,074.00	0.50
15	601899	紫金矿业	14,300	492,921.00	0.49
16	002281	光迅科技	7,000	489,650.00	0.49
17	002410	广联达	38,500	484,330.00	0.49
18	002258	利尔化学	36,700	478,935.00	0.48
19	301035	润丰股份	6,900	469,269.00	0.47
20	002415	海康威视	15,600	465,504.00	0.47
21	000050	深天马 A	51,400	464,142.00	0.46
22	603816	顾家家居	15,000	461,100.00	0.46
23	600496	精工钢构	107,200	444,880.00	0.45
24	600487	亨通光电	17,900	442,667.00	0.44
25	688008	澜起科技	3,756	442,456.80	0.44
26	000589	贵州轮胎	85,200	441,336.00	0.44
27	002340	格林美	52,600	439,736.00	0.44
28	000726	鲁泰 A	61,000	434,320.00	0.43
29	600549	厦门钨业	10,500	431,130.00	0.43
30	600031	三一重工	20,200	426,826.00	0.43
31	002206	海利得	72,300	422,955.00	0.42
32	300017	网宿科技	41,100	421,275.00	0.42
33	603379	三美股份	6,900	418,968.00	0.42

34	600578	京能电力	81,300	414,630.00	0.42
35	300389	艾比森	25,400	412,242.00	0.41
36	600873	梅花生物	39,800	403,174.00	0.40
37	000600	建投能源	47,100	401,763.00	0.40
38	600166	福田汽车	137,000	400,040.00	0.40
39	600057	厦门象屿	46,000	391,920.00	0.39
40	000733	振华科技	7,400	387,834.00	0.39
41	301283	聚胶股份	8,100	387,018.00	0.39
42	603019	中科曙光	4,500	385,380.00	0.39
43	002074	国轩高科	9,700	379,367.00	0.38
44	002913	奥士康	8,800	376,112.00	0.38
45	601808	中海油服	26,700	374,868.00	0.38
46	601717	中创智领	15,200	373,160.00	0.37
47	300723	一品红	11,100	372,405.00	0.37
48	600415	小商品城	23,300	371,635.00	0.37
49	603486	科沃斯	4,600	371,128.00	0.37
50	603993	洛阳钼业	18,500	370,000.00	0.37
51	300308	中际旭创	600	366,000.00	0.37
52	002625	光启技术	7,500	365,700.00	0.37
53	300824	北鼎股份	31,600	357,396.00	0.36
54	000729	燕京啤酒	31,800	357,114.00	0.36
55	002558	巨人网络	8,100	350,649.00	0.35
56	600517	国网英大	57,900	347,979.00	0.35
57	600649	城投控股	78,100	347,545.00	0.35
58	688025	杰普特	2,397	339,343.29	0.34
59	603444	吉比特	800	339,080.00	0.34
60	600378	昊华科技	10,600	338,776.00	0.34
61	601857	中国石油	31,900	332,079.00	0.33
62	600082	海泰发展	81,300	330,078.00	0.33
63	603296	华勤技术	3,600	326,664.00	0.33
64	002444	巨星科技	9,600	326,592.00	0.33
65	688256	寒武纪	238	322,620.90	0.32
66	002487	大金重工	6,200	321,966.00	0.32
67	600988	赤峰黄金	10,200	318,648.00	0.32
68	600704	物产中大	57,100	318,047.00	0.32
69	002111	威海广泰	30,100	316,652.00	0.32
70	601138	工业富联	5,100	316,455.00	0.32
71	600352	浙江龙盛	29,400	313,404.00	0.31
72	002293	罗莱生活	29,635	304,351.45	0.30
73	002556	辉隆股份	49,300	297,772.00	0.30
74	300373	扬杰科技	4,300	292,400.00	0.29
75	601168	西部矿业	10,500	290,220.00	0.29
76	600969	郴电国际	28,300	289,509.00	0.29

77	300003	乐普医疗	18,300	289,323.00	0.29
78	688166	博瑞医药	5,857	287,344.42	0.29
79	300662	科锐国际	11,300	286,229.00	0.29
80	688088	虹软科技	5,774	285,813.00	0.29
81	603629	利通电子	10,700	285,155.00	0.29
82	600051	宁波联合	37,500	282,750.00	0.28
83	600030	中信证券	9,800	281,358.00	0.28
84	688091	上海谊众	5,975	280,825.00	0.28
85	300999	金龙鱼	9,700	278,778.00	0.28
86	600742	富维股份	27,300	273,000.00	0.27
87	000959	首钢股份	55,600	272,440.00	0.27
88	300454	深信服	2,300	264,868.00	0.27
89	603306	华懋科技	4,200	264,642.00	0.27
90	688127	蓝特光学	6,735	259,230.15	0.26
91	600104	上汽集团	17,000	258,740.00	0.26
92	300502	新易盛	600	258,528.00	0.26
93	300274	阳光电源	1,500	256,560.00	0.26
94	688070	纵横股份	4,623	256,114.20	0.26
95	002916	深南电路	1,100	255,519.00	0.26
96	601233	桐昆股份	14,700	252,987.00	0.25
97	688259	创耀科技	6,043	252,597.40	0.25
98	300318	博晖创新	40,100	251,427.00	0.25
99	300550	和仁科技	17,200	249,572.00	0.25
100	601020	华钰矿业	9,200	247,112.00	0.25
101	301607	富特科技	6,100	244,671.00	0.25
102	688248	南网科技	5,467	244,593.58	0.24
103	688200	华峰测控	1,275	242,505.00	0.24
104	601881	中国银河	15,300	240,516.00	0.24
105	000100	TCL 科技	52,900	240,166.00	0.24
106	605580	恒盛能源	10,600	239,136.00	0.24
107	603799	华友钴业	3,500	238,910.00	0.24
108	002273	水晶光电	9,500	238,640.00	0.24
109	002823	凯中精密	14,800	237,688.00	0.24
110	601877	正泰电器	8,500	237,065.00	0.24
111	300073	当升科技	4,100	236,980.00	0.24
112	000800	一汽解放	34,600	234,588.00	0.23
113	601333	广深铁路	76,500	232,560.00	0.23
114	300850	新强联	5,600	231,672.00	0.23
115	002993	奥海科技	5,300	231,663.00	0.23
116	600282	南钢股份	43,700	229,862.00	0.23
117	688278	特宝生物	2,746	229,785.28	0.23
118	603233	大参林	13,000	229,060.00	0.23
119	605376	博迁新材	3,500	228,900.00	0.23

120	601117	中国化学	30,300	228,159.00	0.23
121	603185	弘元绿能	7,400	225,700.00	0.23
122	000060	中金岭南	38,500	225,225.00	0.23
123	300413	芒果超媒	9,200	224,664.00	0.22
124	001286	陕西能源	24,100	224,371.00	0.22
125	002440	闰土股份	29,900	223,353.00	0.22
126	688700	东威科技	6,324	223,110.72	0.22
127	603281	江瀚新材	8,000	222,000.00	0.22
128	002233	塔牌集团	24,600	221,646.00	0.22
129	688267	中触媒	7,832	220,627.44	0.22
130	605020	永和股份	8,200	220,498.00	0.22
131	002867	周大生	17,800	216,804.00	0.22
132	688213	思特威	2,279	216,710.11	0.22
133	600150	中国船舶	6,500	216,190.00	0.22
134	603808	歌力思	25,300	215,556.00	0.22
135	000157	中联重科	24,700	213,161.00	0.21
136	603815	交建股份	28,600	212,784.00	0.21
137	000933	神火股份	7,700	211,519.00	0.21
138	002202	金风科技	10,300	210,120.00	0.21
139	600989	宝丰能源	10,700	210,041.00	0.21
140	300496	中科创达	3,100	209,250.00	0.21
141	000528	柳工	17,300	205,351.00	0.21
142	000623	吉林敖东	10,500	205,065.00	0.21
143	002454	松芝股份	23,500	204,685.00	0.20
144	001696	宗申动力	9,400	203,886.00	0.20
145	688981	中芯国际	1,658	203,652.14	0.20
146	600160	巨化股份	5,300	203,626.00	0.20
147	300005	探路者	18,800	203,604.00	0.20
148	301285	鸿日达	3,000	203,340.00	0.20
149	600566	济川药业	7,700	202,510.00	0.20
150	603659	璞泰来	7,400	202,316.00	0.20
151	002367	康力电梯	25,100	202,306.00	0.20
152	002493	荣盛石化	17,200	201,412.00	0.20
153	688371	菲沃泰	10,855	200,491.85	0.20
154	300743	天地数码	8,900	198,648.00	0.20
155	002299	圣农发展	12,000	198,480.00	0.20
156	600335	国机汽车	30,300	197,253.00	0.20
157	688072	拓荆科技	596	196,680.00	0.20
158	002601	龙佰集团	10,000	195,800.00	0.20
159	603129	春风动力	700	195,076.00	0.20
160	600660	福耀玻璃	3,000	194,310.00	0.19
161	603787	新日股份	13,800	194,028.00	0.19
162	300012	华测检测	14,300	193,765.00	0.19

163	600372	中航机载	14,100	189,222.00	0.19
164	601288	农业银行	24,600	188,928.00	0.19
165	002552	宝鼎科技	11,400	188,214.00	0.19
166	600970	中材国际	18,100	188,059.00	0.19
167	002649	博彦科技	14,200	187,298.00	0.19
168	603856	东宏股份	15,000	187,050.00	0.19
169	688689	银河微电	6,576	186,626.88	0.19
170	002039	黔源电力	10,200	185,334.00	0.19
171	002448	中原内配	14,300	184,899.00	0.19
172	605058	澳弘电子	6,000	183,120.00	0.18
173	000498	山东路桥	30,300	182,709.00	0.18
174	603236	移远通信	1,900	181,279.00	0.18
175	002897	意华股份	3,300	178,431.00	0.18
176	600790	轻纺城	46,500	178,095.00	0.18
177	002984	森麒麟	8,400	177,828.00	0.18
178	001218	丽臣实业	7,800	177,684.00	0.18
179	600262	北方股份	6,800	177,004.00	0.18
180	002612	朗姿股份	8,600	175,784.00	0.18
181	600315	上海家化	7,800	175,656.00	0.18
182	603663	三祥新材	4,900	173,215.00	0.17
183	002008	大族激光	4,200	172,998.00	0.17
184	600449	宁夏建材	13,900	171,804.00	0.17
185	601108	财通证券	19,600	170,912.00	0.17
186	300681	英搏尔	6,800	170,408.00	0.17
187	000021	深科技	6,700	169,376.00	0.17
188	300257	开山股份	12,000	168,600.00	0.17
189	000899	赣能股份	17,000	168,300.00	0.17
190	300487	蓝晓科技	2,700	166,725.00	0.17
191	603187	海容冷链	10,600	166,314.00	0.17
192	301007	德迈仕	4,100	166,132.00	0.17
193	601898	中煤能源	13,300	165,452.00	0.17
194	002668	TCL 智家	15,900	165,042.00	0.17
195	002773	康弘药业	5,500	164,835.00	0.17
196	002616	长青集团	30,100	164,346.00	0.16
197	300458	全志科技	3,900	163,917.00	0.16
198	601636	旗滨集团	27,600	163,668.00	0.16
199	000831	中国稀土	3,500	162,540.00	0.16
200	600497	驰宏锌锗	22,100	161,551.00	0.16
201	000039	中集集团	16,000	161,440.00	0.16
202	603353	和顺石油	5,900	161,247.00	0.16
203	000029	深深房 A	7,300	160,746.00	0.16
204	688610	埃科光电	2,595	160,396.95	0.16
205	002375	亚厦股份	42,300	160,317.00	0.16

206	000960	锡业股份	5,600	156,128.00	0.16
207	600251	冠农股份	16,500	152,295.00	0.15
208	002595	豪迈科技	1,800	152,118.00	0.15
209	600098	广州发展	23,200	151,728.00	0.15
210	002517	恺英网络	6,900	150,903.00	0.15
211	000783	长江证券	18,500	150,775.00	0.15
212	601058	赛轮轮胎	9,300	150,474.00	0.15
213	600641	先导基电	8,500	149,940.00	0.15
214	000768	中航西飞	5,900	149,742.00	0.15
215	002284	亚太股份	10,000	149,300.00	0.15
216	002242	九阳股份	14,200	148,248.00	0.15
217	600038	中直股份	4,100	148,133.00	0.15
218	000778	新兴铸管	35,000	146,300.00	0.15
219	002664	信质集团	6,100	146,156.00	0.15
220	300567	精测电子	1,600	145,920.00	0.15
221	300206	理邦仪器	11,400	145,806.00	0.15
222	603456	九洲药业	8,100	144,990.00	0.15
223	600801	华新建材	5,900	144,786.00	0.14
224	002441	众业达	15,400	144,760.00	0.14
225	603326	我乐家居	15,900	141,510.00	0.14
226	300320	海达股份	15,100	140,883.00	0.14
227	600114	东睦股份	4,600	140,530.00	0.14
228	301381	赛维时代	6,800	140,012.00	0.14
229	603701	德宏股份	6,900	139,104.00	0.14
230	001914	招商积余	13,000	138,840.00	0.14
231	301059	金三江	11,000	138,600.00	0.14
232	300950	德固特	6,000	137,160.00	0.14
233	603566	普莱柯	11,000	136,730.00	0.14
234	300763	锦浪科技	1,900	135,679.00	0.14
235	300124	汇川技术	1,800	135,594.00	0.14
236	301080	百普赛斯	2,500	135,000.00	0.14
237	301115	联检科技	8,500	134,385.00	0.13
238	601601	中国太保	3,200	134,112.00	0.13
239	688798	艾为电子	1,759	133,877.49	0.13
240	600583	海油工程	24,300	133,407.00	0.13
241	002838	道恩股份	5,500	132,440.00	0.13
242	688126	沪硅产业	6,009	130,034.76	0.13
243	688525	佰维存储	1,130	129,712.70	0.13
244	603331	百达精工	9,100	129,675.00	0.13
245	002624	完美世界	7,900	129,481.00	0.13
246	688059	华锐精密	1,645	129,461.50	0.13
247	002398	垒知集团	23,000	129,260.00	0.13
248	603282	亚光股份	6,500	128,960.00	0.13

249	600019	宝钢股份	17,300	128,885.00	0.13
250	600754	锦江酒店	5,100	128,877.00	0.13
251	000576	甘化科工	12,200	128,466.00	0.13
252	300628	亿联网络	3,600	128,340.00	0.13
253	601958	金钼股份	8,200	127,756.00	0.13
254	688222	成都先导	5,417	127,028.65	0.13
255	688623	双元科技	1,349	126,671.10	0.13
256	688045	必易微	3,262	126,206.78	0.13
257	600901	江苏金租	20,200	123,624.00	0.12
258	601318	中国平安	1,800	123,120.00	0.12
259	301308	江波龙	500	122,420.00	0.12
260	601801	皖新传媒	18,600	122,388.00	0.12
261	605567	春雪食品	11,100	122,100.00	0.12
262	603565	中谷物流	12,100	121,484.00	0.12
263	000683	博源化工	16,300	121,272.00	0.12
264	000887	中鼎股份	5,200	120,692.00	0.12
265	300861	美畅股份	8,000	119,440.00	0.12
266	688439	振华风光	1,832	118,347.20	0.12
267	688041	海光信息	526	118,039.66	0.12
268	000708	中信特钢	7,200	117,864.00	0.12
269	301606	绿联科技	2,000	117,480.00	0.12
270	000063	中兴通讯	3,100	117,304.00	0.12
271	600805	悦达投资	21,600	117,288.00	0.12
272	688329	艾隆科技	5,491	116,903.39	0.12
273	002950	奥美医疗	10,700	116,844.00	0.12
274	605599	菜百股份	7,100	116,227.00	0.12
275	003013	地铁设计	8,200	116,194.00	0.12
276	000932	华菱钢铁	20,600	115,772.00	0.12
277	600100	同方股份	12,900	115,068.00	0.12
278	600584	长电科技	3,100	114,018.00	0.11
279	300363	博腾股份	4,900	113,876.00	0.11
280	603500	祥和实业	9,500	113,810.00	0.11
281	600768	宁波富邦	8,100	113,400.00	0.11
282	002222	福晶科技	2,000	112,680.00	0.11
283	600741	华域汽车	5,600	112,000.00	0.11
284	601211	国泰海通	5,400	110,970.00	0.11
285	688819	天能股份	3,339	110,921.58	0.11
286	603005	晶方科技	4,000	110,640.00	0.11
287	601216	君正集团	22,900	110,378.00	0.11
288	002203	海亮股份	8,700	110,142.00	0.11
289	688286	敏芯股份	1,395	110,135.25	0.11
290	000823	超声电子	8,100	109,836.00	0.11
291	002603	以岭药业	6,400	109,248.00	0.11

292	002465	海格通信	6,900	108,675.00	0.11
293	000776	广发证券	4,900	107,898.00	0.11
294	600507	方大特钢	18,300	107,787.00	0.11
295	600295	鄂尔多斯	8,700	107,532.00	0.11
296	600267	海正药业	10,800	106,812.00	0.11
297	002532	天山铝业	6,600	106,788.00	0.11
298	601766	中国中车	15,600	106,392.00	0.11
299	688396	华润微	2,011	106,301.46	0.11
300	603700	宁水集团	7,800	106,002.00	0.11
301	688508	芯朋微	1,739	105,905.10	0.11
302	603132	金徽股份	7,200	105,624.00	0.11
303	001283	豪鹏科技	1,500	105,000.00	0.11
304	600298	安琪酵母	2,400	104,976.00	0.11
305	600486	扬农化工	1,500	104,085.00	0.10
306	688677	海泰新光	2,398	103,497.68	0.10
307	603111	康尼机电	15,100	103,435.00	0.10
308	688235	百济神州	385	103,411.00	0.10
309	000703	恒逸石化	9,600	103,392.00	0.10
310	002468	申通快递	7,700	103,334.00	0.10
311	600522	中天科技	5,700	103,284.00	0.10
312	002452	长高电新	12,500	102,875.00	0.10
313	600933	爱柯迪	5,100	102,510.00	0.10
314	002049	紫光国微	1,300	102,453.00	0.10
315	300415	伊之密	3,900	101,634.00	0.10
316	000830	鲁西化工	6,100	101,077.00	0.10
317	601678	滨化股份	23,800	100,912.00	0.10
318	600216	浙江医药	7,200	99,792.00	0.10
319	600309	万华化学	1,300	99,684.00	0.10
320	300923	研奥股份	3,900	99,567.00	0.10
321	002472	双环传动	2,100	99,561.00	0.10
322	600257	大湖股份	15,800	99,224.00	0.10
323	002011	盾安环境	7,800	98,904.00	0.10
324	002373	千方科技	8,400	98,868.00	0.10
325	003015	日久光电	6,300	98,280.00	0.10
326	002959	小熊电器	2,300	97,129.00	0.10
327	000902	新洋丰	6,200	96,844.00	0.10
328	300033	同花顺	300	96,654.00	0.10
329	002409	雅克科技	1,300	96,330.00	0.10
330	600195	中牧股份	12,200	96,014.00	0.10
331	002483	润邦股份	13,400	95,676.00	0.10
332	688099	晶晨股份	1,096	95,604.08	0.10
333	000895	双汇发展	3,600	95,292.00	0.10
334	300193	佳士科技	10,600	94,870.00	0.10

335	002850	科达利	600	94,716.00	0.09
336	001301	尚太科技	1,100	94,391.00	0.09
337	601677	明泰铝业	6,300	93,177.00	0.09
338	603897	长城科技	3,400	92,480.00	0.09
339	300505	川金诺	4,100	91,799.00	0.09
340	688322	奥比中光	1,020	91,463.40	0.09
341	600050	中国联通	17,700	90,447.00	0.09
342	601156	东航物流	4,900	90,209.00	0.09
343	603341	龙旗科技	2,100	88,746.00	0.09
344	300316	晶盛机电	2,400	88,200.00	0.09
345	601577	长沙银行	9,000	87,300.00	0.09
346	300400	劲拓股份	4,400	87,120.00	0.09
347	603160	汇顶科技	1,100	86,900.00	0.09
348	300428	立中集团	3,700	86,395.00	0.09
349	300476	胜宏科技	300	86,274.00	0.09
350	688015	交控科技	3,777	86,040.06	0.09
351	000987	越秀资本	10,500	85,470.00	0.09
352	300940	南极光	3,000	85,380.00	0.09
353	600685	中船防务	3,000	85,350.00	0.09
354	688236	春立医疗	3,729	85,319.52	0.09
355	000975	山金国际	3,500	85,155.00	0.09
356	002475	立讯精密	1,500	85,065.00	0.09
357	603568	伟明环保	3,300	83,754.00	0.08
358	603606	东方电缆	1,400	83,650.00	0.08
359	601336	新华保险	1,200	83,640.00	0.08
360	688049	炬芯科技	1,569	82,529.40	0.08
361	688777	中控技术	1,671	82,447.14	0.08
362	600320	振华重工	16,000	82,400.00	0.08
363	000030	富奥股份	14,300	82,082.00	0.08
364	603558	健盛集团	7,300	81,979.00	0.08
365	603087	甘李药业	1,200	81,684.00	0.08
366	000893	亚钾国际	1,700	81,549.00	0.08
367	603587	地素时尚	6,100	81,496.00	0.08
368	688521	芯原股份	588	80,538.36	0.08
369	300450	先导智能	1,600	79,968.00	0.08
370	600064	南京高科	9,200	79,856.00	0.08
370	600027	华电国际	16,100	79,856.00	0.08
372	002734	利民股份	5,000	79,700.00	0.08
373	000915	华特达因	2,400	79,296.00	0.08
374	603182	嘉华股份	5,000	79,100.00	0.08
375	603200	上海洗霸	1,100	78,254.00	0.08
376	000333	美的集团	1,000	78,150.00	0.08
377	002216	三全食品	6,900	77,901.00	0.08

378	002185	华天科技	7,100	77,887.00	0.08
379	300790	宇瞳光学	2,600	77,766.00	0.08
380	600028	中国石化	12,500	77,250.00	0.08
381	600176	中国巨石	4,500	76,950.00	0.08
382	600867	通化东宝	9,400	76,798.00	0.08
383	688636	智明达	1,792	76,769.28	0.08
384	000739	普洛药业	4,700	76,469.00	0.08
385	001322	箭牌家居	8,600	76,282.00	0.08
386	688380	中微半导	2,371	76,227.65	0.08
387	301299	卓创资讯	1,400	76,132.00	0.08
388	600141	兴发集团	2,200	76,076.00	0.08
389	688029	南微医学	932	76,013.92	0.08
390	688097	博众精工	2,009	75,839.75	0.08
391	603043	广州酒家	4,300	75,809.00	0.08
392	600729	重庆百货	2,900	75,400.00	0.08
393	301219	腾远钴业	1,100	75,108.00	0.08
394	002152	广电运通	5,400	74,574.00	0.07
395	605507	国邦医药	3,000	74,400.00	0.07
396	300919	中伟股份	1,600	74,128.00	0.07
397	300347	泰格医药	1,300	73,710.00	0.07
398	601137	博威合金	3,400	72,658.00	0.07
399	002079	苏州固锝	7,600	72,580.00	0.07
400	002237	恒邦股份	5,400	72,468.00	0.07
401	000543	皖能电力	9,100	72,345.00	0.07
402	002687	乔治白	15,000	72,300.00	0.07
403	300083	创世纪	7,800	71,838.00	0.07
404	600863	内蒙华电	15,900	71,232.00	0.07
405	603357	设计总院	8,700	70,905.00	0.07
406	002817	黄山胶囊	9,300	70,680.00	0.07
407	300207	欣旺达	2,700	70,605.00	0.07
408	600795	国电电力	14,000	70,560.00	0.07
409	688237	超卓航科	1,445	70,443.75	0.07
410	688153	唯捷创芯	1,865	70,198.60	0.07
411	600820	隧道股份	10,800	70,092.00	0.07
412	600938	中国海油	2,300	69,414.00	0.07
413	600196	复星医药	2,600	68,874.00	0.07
414	000828	东莞控股	6,400	68,864.00	0.07
415	600959	江苏有线	20,000	68,800.00	0.07
416	601311	骆驼股份	7,500	68,775.00	0.07
417	000725	京东方 A	16,300	68,623.00	0.07
418	603529	爱玛科技	2,300	68,310.00	0.07
419	688138	清溢光电	2,419	68,119.04	0.07
420	688577	浙海德曼	703	68,092.58	0.07

421	000553	安道麦 A	12,400	67,952.00	0.07
422	600690	海尔智家	2,600	67,834.00	0.07
423	603699	纽威股份	1,300	67,561.00	0.07
424	002539	云图控股	5,700	67,374.00	0.07
425	688116	天奈科技	1,422	67,047.30	0.07
426	600096	云天化	2,000	66,820.00	0.07
427	600392	盛和资源	3,100	66,743.00	0.07
428	000938	紫光股份	2,700	66,420.00	0.07
429	002241	歌尔股份	2,300	66,079.00	0.07
430	600426	华鲁恒升	2,100	66,003.00	0.07
431	301589	诺瓦星云	400	65,820.00	0.07
432	688591	泰凌微	1,536	65,372.16	0.07
433	603267	鸿远电子	1,200	65,316.00	0.07
434	000156	华数传媒	8,600	65,102.00	0.07
435	601162	天风证券	15,600	64,896.00	0.06
436	605287	德才股份	2,500	64,800.00	0.06
437	603737	三棵树	1,400	64,778.00	0.06
438	300791	仙乐健康	2,500	64,650.00	0.06
439	002142	宁波银行	2,300	64,607.00	0.06
440	603986	兆易创新	300	64,275.00	0.06
441	688312	燕麦科技	1,928	63,971.04	0.06
442	603027	千禾味业	6,500	63,895.00	0.06
443	002023	海特高新	4,700	63,638.00	0.06
444	688120	华海清科	418	62,733.44	0.06
445	605001	威奥股份	8,100	61,803.00	0.06
446	000415	渤海租赁	15,200	61,560.00	0.06
447	603979	金诚信	800	60,920.00	0.06
448	688123	聚辰股份	483	60,655.14	0.06
449	300566	激智科技	3,300	60,555.00	0.06
450	600803	新奥股份	2,900	60,204.00	0.06
451	600004	白云机场	6,300	59,598.00	0.06
452	600572	康恩贝	13,200	58,872.00	0.06
453	600639	浦东金桥	5,700	58,539.00	0.06
454	301186	超达装备	1,200	58,272.00	0.06
455	605056	咸亨国际	3,500	57,750.00	0.06
456	000301	东方盛虹	5,300	57,717.00	0.06
457	300760	迈瑞医疗	300	57,135.00	0.06
458	688357	建龙微纳	1,710	56,515.50	0.06
459	300292	吴通控股	12,500	56,375.00	0.06
460	600760	中航沈飞	1,000	56,150.00	0.06
461	000630	铜陵有色	9,300	55,893.00	0.06
462	600009	上海机场	1,700	55,692.00	0.06
463	603345	安井食品	700	55,496.00	0.06

464	688185	康希诺	878	55,182.30	0.06
465	600125	铁龙物流	8,500	54,740.00	0.05
466	601919	中远海控	3,600	54,648.00	0.05
467	000166	申万宏源	10,300	54,281.00	0.05
468	301178	天亿马	1,100	53,988.00	0.05
469	600276	恒瑞医药	900	53,613.00	0.05
470	600060	海信视像	2,200	53,416.00	0.05
471	603298	杭叉集团	2,000	53,140.00	0.05
472	601800	中国交建	6,400	52,736.00	0.05
473	688536	思瑞浦	329	52,600.52	0.05
474	002606	大连电瓷	6,000	52,440.00	0.05
475	603188	亚邦股份	11,400	52,326.00	0.05
476	688063	派能科技	912	51,819.84	0.05
477	002027	分众传媒	7,000	51,590.00	0.05
478	688522	纳睿雷达	1,291	51,549.63	0.05
479	002690	美亚光电	2,500	51,425.00	0.05
480	600782	新钢股份	13,200	51,216.00	0.05
481	688484	南芯科技	1,259	51,190.94	0.05
482	002399	海普瑞	4,300	50,697.00	0.05
483	301507	民生健康	3,300	50,688.00	0.05
484	688096	京源环保	6,359	50,236.10	0.05
485	688411	海博思创	200	50,008.00	0.05
486	300011	鼎汉技术	5,800	49,764.00	0.05
487	002138	顺络电子	1,400	49,742.00	0.05
488	601900	南方传媒	3,700	49,617.00	0.05
489	002328	新朋股份	7,500	49,575.00	0.05
490	688334	西高院	2,547	49,309.92	0.05
491	001979	招商蛇口	5,700	49,248.00	0.05
492	600066	宇通客车	1,500	49,050.00	0.05
493	001389	广合科技	600	48,978.00	0.05
494	000065	北方国际	3,900	48,594.00	0.05
495	601865	福莱特	3,100	48,577.00	0.05
496	600258	首旅如家	2,900	48,575.00	0.05
497	002635	安洁科技	3,500	48,510.00	0.05
498	300976	达瑞电子	800	48,056.00	0.05
499	000792	盐湖股份	1,700	47,872.00	0.05
500	002001	新和成	1,900	47,861.00	0.05
501	603885	吉祥航空	3,200	47,616.00	0.05
502	301061	匠心家居	500	47,400.00	0.05
503	002092	中泰化学	9,500	47,310.00	0.05
504	688100	威胜信息	1,202	47,238.60	0.05
505	000878	云南铜业	2,300	47,173.00	0.05
506	002056	横店东磁	2,400	46,800.00	0.05

507	600869	远东股份	5,800	46,690.00	0.05
508	600935	华塑股份	19,000	46,550.00	0.05
509	002508	老板电器	2,400	46,440.00	0.05
510	600623	华谊集团	6,000	46,260.00	0.05
511	300230	永利股份	9,600	45,888.00	0.05
512	605305	中际联合	1,100	45,826.00	0.05
513	300636	同和药业	6,100	45,811.00	0.05
514	301163	宏德股份	1,700	45,543.00	0.05
515	600909	华安证券	6,700	45,426.00	0.05
516	688608	恒玄科技	200	45,388.00	0.05
517	603338	浙江鼎力	800	45,312.00	0.05
518	688347	华虹公司	420	45,305.40	0.05
519	600435	北方导航	2,900	44,718.00	0.04
520	300232	洲明科技	6,300	44,667.00	0.04
521	300813	泰林生物	1,800	44,226.00	0.04
522	688372	伟测科技	403	43,963.27	0.04
523	001319	铭科精技	1,600	43,952.00	0.04
524	601068	中铝国际	8,300	43,907.00	0.04
525	601963	重庆银行	4,000	43,320.00	0.04
526	300602	飞荣达	1,300	43,108.00	0.04
527	000419	通程控股	6,700	42,813.00	0.04
528	000936	华西股份	5,200	42,796.00	0.04
529	300596	利安隆	1,000	42,210.00	0.04
530	603519	立霸股份	3,500	42,105.00	0.04
531	600109	国金证券	4,500	41,850.00	0.04
532	688578	艾力斯	399	41,555.85	0.04
533	601163	三角轮胎	2,900	41,441.00	0.04
534	002048	宁波华翔	1,300	40,898.00	0.04
535	601966	玲珑轮胎	2,800	40,684.00	0.04
536	300394	天孚通信	200	40,606.00	0.04
537	300239	东宝生物	6,900	40,434.00	0.04
538	688475	萤石网络	1,330	40,046.30	0.04
539	600020	中原高速	9,400	40,044.00	0.04
540	688065	凯赛生物	804	40,039.20	0.04
541	603577	汇金通	3,800	39,976.00	0.04
542	002588	史丹利	4,000	39,920.00	0.04
543	001219	青岛食品	2,800	39,900.00	0.04
544	688183	生益电子	415	39,711.35	0.04
545	000988	华工科技	500	39,665.00	0.04
546	601918	新集能源	6,000	39,660.00	0.04
547	688162	巨一科技	1,285	39,578.00	0.04
548	600278	东方创业	5,200	39,520.00	0.04
549	601128	常熟银行	5,600	39,424.00	0.04

550	601319	中国人保	4,300	38,485.00	0.04
551	688187	时代电气	743	38,108.47	0.04
552	002818	富森美	3,400	37,774.00	0.04
553	300709	精研科技	800	37,728.00	0.04
554	600866	星湖科技	5,400	37,530.00	0.04
555	300735	光弘科技	1,500	37,290.00	0.04
556	688558	国盛智科	1,287	37,232.91	0.04
557	300615	欣天科技	2,800	37,184.00	0.04
558	600409	三友化工	6,000	37,140.00	0.04
559	000560	我爱我家	12,700	37,084.00	0.04
560	601388	怡球资源	12,300	37,023.00	0.04
561	601330	绿色动力	5,500	37,015.00	0.04
562	002576	通达动力	2,100	36,540.00	0.04
563	002782	可立克	2,000	36,320.00	0.04
564	688271	联影医疗	289	36,269.50	0.04
565	000338	潍柴动力	2,100	36,120.00	0.04
566	603151	邦基科技	2,000	36,040.00	0.04
567	600531	豫光金铅	3,000	35,250.00	0.04
568	601390	中国中铁	6,500	35,165.00	0.04
569	301215	中汽股份	5,100	34,935.00	0.03
570	688080	映翰通	684	34,542.00	0.03
571	605228	神通科技	2,300	34,339.00	0.03
572	603583	捷昌驱动	900	34,263.00	0.03
573	600266	城建发展	6,700	33,969.00	0.03
574	000404	长虹华意	5,000	33,850.00	0.03
575	002004	华邦健康	7,000	33,460.00	0.03
576	000977	浪潮信息	500	33,300.00	0.03
577	688600	皖仪科技	1,321	33,091.05	0.03
578	002119	康强电子	2,000	32,940.00	0.03
579	300014	亿纬锂能	500	32,880.00	0.03
580	601088	中国神华	800	32,400.00	0.03
581	688352	颀中科技	2,556	32,231.16	0.03
582	002746	仙坛股份	5,300	32,171.00	0.03
583	002250	联化科技	2,400	32,112.00	0.03
584	300408	三环集团	700	32,025.00	0.03
585	002671	龙泉股份	6,100	31,964.00	0.03
586	000006	深振业A	3,200	31,840.00	0.03
587	688599	天合光能	1,918	31,742.90	0.03
588	002831	裕同科技	1,100	31,361.00	0.03
589	300904	威力传动	500	31,305.00	0.03
590	002091	江苏国泰	3,400	30,702.00	0.03
591	300562	乐心医疗	2,300	30,659.00	0.03
592	002312	川发龙蟒	2,800	30,604.00	0.03

593	002223	鱼跃医疗	800	30,568.00	0.03
594	301303	真兰仪表	2,000	30,280.00	0.03
595	688219	会通股份	2,431	30,193.02	0.03
596	688686	奥普特	242	30,039.46	0.03
597	601186	中国铁建	3,900	29,913.00	0.03
598	688728	格科微	1,970	29,431.80	0.03
599	688618	三旺通信	1,100	29,326.00	0.03
600	301029	怡合达	1,100	29,172.00	0.03
601	688220	翱捷科技	347	28,665.67	0.03
602	002587	奥拓电子	4,200	28,392.00	0.03
603	600248	陕建股份	8,000	28,240.00	0.03
604	688383	新益昌	360	28,177.20	0.03
605	603218	日月股份	2,100	27,825.00	0.03
606	002182	宝武镁业	1,800	27,540.00	0.03
607	603999	读者传媒	3,900	27,417.00	0.03
608	603029	天鹅股份	1,500	27,360.00	0.03
609	600438	通威股份	1,300	26,676.00	0.03
609	603385	惠达卫浴	3,900	26,676.00	0.03
611	603260	合盛硅业	500	26,350.00	0.03
612	300406	九强生物	2,000	26,140.00	0.03
613	301263	泰恩康	900	26,091.00	0.03
614	601872	招商轮船	2,900	26,042.00	0.03
615	600887	伊利股份	900	25,740.00	0.03
616	601608	中信重工	3,900	25,701.00	0.03
617	002065	东华软件	2,800	25,620.00	0.03
618	300416	苏试试验	1,400	24,976.00	0.03
619	688023	安恒信息	485	24,933.85	0.02
620	603271	永杰新材	600	24,648.00	0.02
621	688665	四方光电	505	24,628.85	0.02
622	601995	中金公司	700	24,500.00	0.02
623	688362	甬矽电子	747	24,210.27	0.02
624	002663	普邦股份	12,800	24,192.00	0.02
625	600478	科力远	3,500	24,115.00	0.02
626	605118	力鼎光电	800	24,088.00	0.02
627	601398	工商银行	3,000	23,790.00	0.02
628	002815	崇达技术	1,700	23,222.00	0.02
628	002999	天禾股份	3,400	23,222.00	0.02
630	600750	华润江中	1,000	23,170.00	0.02
631	300725	药石科技	600	23,136.00	0.02
632	603309	维力医疗	1,700	23,103.00	0.02
633	600596	新安股份	2,000	22,940.00	0.02
634	301052	果麦文化	600	22,914.00	0.02
635	300787	海能实业	1,900	22,325.00	0.02

636	002101	广东鸿图	1,800	22,176.00	0.02
637	300041	回天新材	2,000	22,160.00	0.02
638	603611	诺力股份	900	22,005.00	0.02
639	688087	英科再生	703	21,666.46	0.02
640	600183	生益科技	300	21,423.00	0.02
641	603489	八方股份	700	21,406.00	0.02
642	002863	今飞凯达	3,600	21,132.00	0.02
643	301097	天益医疗	400	20,648.00	0.02
644	002063	远光软件	3,400	20,638.00	0.02
645	000581	威孚高科	1,000	20,620.00	0.02
646	002673	西部证券	2,600	20,514.00	0.02
647	600661	昂立教育	2,000	20,500.00	0.02
648	600888	新疆众和	2,500	20,475.00	0.02
649	300146	汤臣倍健	1,700	20,417.00	0.02
650	300845	捷安高科	1,800	20,286.00	0.02
651	603289	泰瑞机器	2,000	20,240.00	0.02
652	003030	祖名股份	1,000	20,190.00	0.02
653	688208	道通科技	545	20,056.00	0.02
654	000421	南京公用	2,900	20,039.00	0.02
655	688588	凌志软件	1,391	19,905.21	0.02
656	600460	士兰微	700	19,887.00	0.02
657	600210	紫江企业	2,700	19,845.00	0.02
658	003011	海象新材	900	19,836.00	0.02
659	002978	安宁股份	600	19,830.00	0.02
660	600499	科达制造	1,400	19,418.00	0.02
661	688103	国力电子	313	18,964.67	0.02
662	000635	英力特	2,100	18,669.00	0.02
663	002821	凯莱英	200	18,586.00	0.02
664	600967	内蒙一机	1,100	18,480.00	0.02
665	300613	富瀚微	400	18,424.00	0.02
666	600029	南方航空	2,300	18,423.00	0.02
667	002406	远东传动	2,300	18,262.00	0.02
668	600177	雅戈尔	2,400	18,240.00	0.02
669	301608	博实结	200	18,108.00	0.02
670	002334	英威腾	2,000	18,040.00	0.02
671	002590	万安科技	1,200	18,000.00	0.02
672	002139	拓邦股份	1,300	17,914.00	0.02
673	300590	移为通信	1,400	17,752.00	0.02
674	301628	强达电路	200	17,750.00	0.02
675	603678	火炬电子	500	17,660.00	0.02
676	603901	永创智能	1,200	17,040.00	0.02
677	000548	湖南投资	3,100	16,864.00	0.02
678	300953	震裕科技	100	16,802.00	0.02

679	688093	世华科技	450	16,582.50	0.02
680	600128	苏豪弘业	1,500	16,485.00	0.02
681	688112	鼎阳科技	438	16,403.10	0.02
682	002051	中工国际	1,800	16,326.00	0.02
683	300286	安科瑞	700	16,156.00	0.02
684	002489	浙江永强	4,200	16,086.00	0.02
685	002449	国星光电	1,900	16,074.00	0.02
686	688073	毕得医药	259	15,811.95	0.02
687	000598	兴蓉环境	2,200	15,774.00	0.02
688	603511	爱慕股份	1,000	15,490.00	0.02
689	688561	奇安信	434	15,441.72	0.02
690	603153	上海建科	900	15,300.00	0.02
691	002997	瑞鹄模具	400	14,960.00	0.01
692	600850	电科数字	500	14,820.00	0.01
693	000927	中国铁物	5,600	14,616.00	0.01
694	603038	华立股份	900	14,490.00	0.01
695	603662	柯力传感	200	14,400.00	0.01
696	600643	爱建集团	2,600	14,378.00	0.01
697	688252	天德钰	679	14,374.43	0.01
698	300535	达威股份	800	14,288.00	0.01
699	688378	奥来德	518	14,141.40	0.01
700	300610	晨化股份	1,200	13,932.00	0.01
701	601968	宝钢包装	2,600	13,884.00	0.01
702	688308	欧科亿	433	13,700.12	0.01
703	600827	百联股份	1,500	13,485.00	0.01
704	000612	焦作万方	1,200	13,224.00	0.01
705	601615	明阳智能	900	13,032.00	0.01
706	002155	湖南黄金	600	12,654.00	0.01
707	002368	太极股份	500	12,245.00	0.01
708	002170	芭田股份	1,000	12,180.00	0.01
709	300433	蓝思科技	400	12,108.00	0.01
710	600894	广日股份	1,300	12,025.00	0.01
711	600380	健康元	1,000	11,550.00	0.01
712	603170	宝立食品	800	11,424.00	0.01
713	605198	安德利	300	11,286.00	0.01
714	688391	钜泉科技	395	11,190.35	0.01
715	002060	广东建工	3,100	11,160.00	0.01
716	601600	中国铝业	900	10,998.00	0.01
717	600585	海螺水泥	500	10,930.00	0.01
718	002933	新兴装备	300	10,860.00	0.01
719	603025	大豪科技	600	10,776.00	0.01
720	000426	兴业银锡	300	10,680.00	0.01
721	301190	善水科技	500	10,605.00	0.01

722	600338	西藏珠峰	700	10,528.00	0.01
723	300800	力合科技	900	10,467.00	0.01
724	000027	深圳能源	1,600	10,432.00	0.01
725	002609	捷顺科技	1,100	10,219.00	0.01
726	301419	阿莱德	300	10,164.00	0.01
727	688458	美芯晟	255	10,108.20	0.01
728	688288	鸿泉技术	372	9,973.32	0.01
729	600333	长春燃气	1,800	9,954.00	0.01
730	002626	金达威	500	9,855.00	0.01
731	300674	宇信科技	400	9,704.00	0.01
732	600961	株冶集团	600	9,660.00	0.01
733	002608	江苏国信	1,300	9,607.00	0.01
734	605258	协和电子	300	9,381.00	0.01
735	601009	南京银行	800	9,144.00	0.01
736	000034	神州数码	200	7,782.00	0.01

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	300750	宁德时代	2,523,436.00	15.94
2	600487	亨通光电	2,174,376.00	13.74
3	000988	华工科技	2,044,577.00	12.92
4	000050	深天马 A	1,747,776.00	11.04
5	603486	科沃斯	1,684,975.00	10.65
6	002396	星网锐捷	1,665,434.00	10.52
7	300476	胜宏科技	1,593,491.00	10.07
8	600031	三一重工	1,541,652.00	9.74
9	600498	烽火通信	1,531,684.00	9.68
10	603259	药明康德	1,523,671.00	9.63
11	300308	中际旭创	1,430,742.00	9.04
12	002340	格林美	1,426,232.00	9.01
13	002558	巨人网络	1,412,027.00	8.92
14	601857	中国石油	1,409,622.00	8.91
15	002236	大华股份	1,386,397.00	8.76
16	600352	浙江龙盛	1,361,144.00	8.60
17	601138	工业富联	1,358,421.00	8.58
18	002414	高德红外	1,351,719.05	8.54
19	000726	鲁泰 A	1,345,617.00	8.50
20	002202	金风科技	1,337,382.00	8.45
21	002273	水晶光电	1,283,254.00	8.11

22	601899	紫金矿业	1,273,432.00	8.05
23	300232	洲明科技	1,266,409.00	8.00
24	000733	振华科技	1,263,715.00	7.98
25	603444	吉比特	1,244,277.00	7.86
26	300017	网宿科技	1,235,770.00	7.81
27	000960	锡业股份	1,220,322.00	7.71
28	600742	富维股份	1,213,262.00	7.67
29	000729	燕京啤酒	1,194,341.00	7.55
30	603129	春风动力	1,180,633.00	7.46
31	601877	正泰电器	1,178,654.00	7.45
32	601991	大唐发电	1,160,217.00	7.33
33	600372	中航机载	1,148,453.00	7.26
34	600496	精工钢构	1,145,647.00	7.24
35	002410	广联达	1,118,678.00	7.07
36	688002	睿创微纳	1,113,246.27	7.03
37	002415	海康威视	1,108,590.00	7.00
38	688015	交控科技	1,107,276.66	7.00
39	603799	华友钴业	1,097,601.20	6.94
40	603993	洛阳钼业	1,057,246.00	6.68
41	601168	西部矿业	1,043,639.00	6.59
42	600704	物产中大	1,043,090.00	6.59
43	600578	京能电力	1,040,074.00	6.57
44	300502	新易盛	1,039,408.00	6.57
45	000932	华菱钢铁	1,039,050.00	6.57
46	002913	奥士康	1,030,611.00	6.51
47	000157	中联重科	1,026,890.00	6.49
48	000959	首钢股份	1,025,313.00	6.48
49	688235	百济神州	1,024,984.72	6.48
50	000039	中集集团	1,014,287.00	6.41
51	600298	安琪酵母	1,009,759.00	6.38
52	688612	威迈斯	1,005,422.87	6.35
53	600741	华域汽车	994,787.00	6.29
54	688772	珠海冠宇	988,343.91	6.24
55	002284	亚太股份	982,553.00	6.21
56	601311	骆驼股份	965,715.00	6.10
57	688008	澜起科技	962,486.32	6.08
58	301221	光庭信息	960,779.00	6.07
59	603893	瑞芯微	952,467.00	6.02
60	000936	华西股份	949,528.00	6.00
61	002299	圣农发展	945,846.00	5.98
62	000600	建投能源	943,367.00	5.96
63	605058	澳弘电子	937,119.00	5.92
64	600989	宝丰能源	934,767.00	5.91

65	603236	移远通信	930,153.00	5.88
66	002156	通富微电	926,719.00	5.86
67	601339	百隆东方	920,626.00	5.82
68	601318	中国平安	919,282.00	5.81
69	600109	国金证券	919,162.00	5.81
70	601717	中创智领	902,707.00	5.70
71	002918	蒙娜丽莎	917,969.00	5.80
72	601615	明阳智能	914,091.00	5.78
73	000021	深科技	912,302.00	5.76
74	300207	欣旺达	905,899.00	5.72
75	600011	华能国际	904,127.00	5.71
76	000725	京东方 A	901,981.00	5.70
77	301035	润丰股份	900,314.00	5.69
78	688122	西部超导	890,754.66	5.63
79	002444	巨星科技	886,672.00	5.60
80	300088	长信科技	885,557.00	5.60
81	600582	天地科技	883,560.00	5.58
82	603379	三美股份	877,166.00	5.54
83	600166	福田汽车	876,712.00	5.54
84	000878	云南铜业	863,636.00	5.46
85	600315	上海家化	862,303.00	5.45
86	600219	南山铝业	858,487.00	5.42
87	000528	柳工	857,533.00	5.42
88	600879	航天电子	854,135.00	5.40
89	001696	宗申动力	852,860.00	5.39
90	300373	扬杰科技	850,774.00	5.38
91	002138	顺络电子	847,854.00	5.36
92	000589	贵州轮胎	845,836.00	5.34
93	600170	上海建工	844,542.00	5.34
94	688686	奥普特	844,462.97	5.34
95	000977	浪潮信息	840,974.00	5.31
96	688469	芯联集成	839,231.35	5.30
97	688329	艾隆科技	838,871.41	5.30
98	000060	中金岭南	834,279.50	5.27
99	603341	龙旗科技	833,517.00	5.27
100	600060	海信视像	833,339.00	5.27
101	688538	和辉光电	832,624.63	5.26
102	600335	国机汽车	826,812.00	5.22
103	600699	均胜电子	823,734.00	5.20
104	603233	大参林	816,590.20	5.16
105	600873	梅花生物	816,164.00	5.16
106	688380	中微半导	815,387.86	5.15
107	688249	晶合集成	814,941.02	5.15

108	300304	云意电气	814,015.00	5.14
109	600038	中直股份	812,950.00	5.14
110	002281	光迅科技	812,925.00	5.14
111	002373	千方科技	809,819.00	5.12
112	600497	驰宏锌锗	807,572.00	5.10
113	300602	飞荣达	807,464.00	5.10
114	002511	中顺洁柔	807,358.00	5.10
115	601728	中国电信	801,526.00	5.06
116	002375	亚厦股份	800,623.00	5.06
117	002517	恺英网络	797,725.00	5.04
118	688099	晶晨股份	795,598.44	5.03
119	600998	九州通	793,634.00	5.01
120	603380	易德龙	793,437.00	5.01
121	002782	可立克	789,301.00	4.99
122	688387	信科移动	784,419.96	4.96
123	002206	海利得	784,111.00	4.95
124	600988	赤峰黄金	784,093.00	4.95
125	603160	汇顶科技	779,167.00	4.92
126	300469	信息发展	779,132.00	4.92
127	603111	康尼机电	777,490.00	4.91
128	002081	金螳螂	763,714.00	4.83
129	002773	康弘药业	760,580.00	4.81
130	600660	福耀玻璃	759,961.00	4.80
131	002532	天山铝业	759,199.00	4.80
132	002258	利尔化学	759,171.00	4.80
133	600649	城投控股	757,069.00	4.78
134	688371	菲沃泰	756,973.00	4.78
135	605507	国邦医药	755,681.00	4.77
136	603787	新日股份	755,133.00	4.77
137	002008	大族激光	750,896.50	4.74
138	600114	东睦股份	745,517.00	4.71
139	688123	聚辰股份	742,871.29	4.69
140	002625	光启技术	742,466.00	4.69
141	600460	士兰微	740,802.00	4.68
142	603456	九洲药业	739,364.00	4.67
143	603386	骏亚科技	738,848.00	4.67
144	600685	中船防务	737,740.00	4.66
145	600517	国网英大	735,799.00	4.65
146	603659	璞泰来	729,184.00	4.61
147	300389	艾比森	721,402.00	4.56
148	688819	天能股份	719,013.99	4.54
149	300274	阳光电源	717,441.00	4.53
150	603816	顾家家居	714,875.00	4.52

151	002487	大金重工	714,241.00	4.51
152	002399	海普瑞	711,587.00	4.50
153	600100	同方股份	708,193.00	4.47
154	300257	开山股份	707,055.00	4.47
155	603678	火炬电子	706,385.00	4.46
156	600057	厦门象屿	705,459.00	4.46
157	600096	云天化	704,851.00	4.45
158	301039	中集车辆	703,898.00	4.45
159	002230	科大讯飞	697,981.00	4.41
160	600056	中国医药	697,339.00	4.41
161	688322	奥比中光	696,309.01	4.40
162	603296	华勤技术	695,370.00	4.39
163	600549	厦门钨业	693,569.00	4.38
164	300193	佳士科技	692,403.00	4.37
165	002859	洁美科技	690,297.00	4.36
166	002595	豪迈科技	688,294.00	4.35
167	600282	南钢股份	688,136.00	4.35
168	601319	中国人保	688,024.00	4.35
169	688091	上海谊众	687,498.04	4.34
170	688208	道通科技	686,624.18	4.34
171	002293	罗莱生活	685,500.85	4.33
172	600176	中国巨石	685,189.00	4.33
173	601233	桐昆股份	682,641.00	4.31
174	688521	芯原股份	681,482.84	4.31
175	688484	南芯科技	678,059.34	4.28
176	300496	中科创达	677,866.00	4.28
177	000636	风华高科	677,554.00	4.28
178	688097	博众精工	677,048.31	4.28
179	002950	奥美医疗	676,884.00	4.28
180	000401	金隅冀东	676,508.00	4.27
181	000623	吉林敖东	675,819.00	4.27
182	600728	佳都科技	672,576.00	4.25
183	300763	锦浪科技	672,430.00	4.25
184	600866	星湖科技	670,350.00	4.24
185	300369	绿盟科技	669,669.00	4.23
186	000902	新洋丰	665,272.00	4.20
187	600801	华新建材	662,452.00	4.19
188	600104	上汽集团	661,814.00	4.18
189	002353	杰瑞股份	660,939.00	4.18
190	000783	长江证券	659,956.90	4.17
191	603629	利通电子	656,770.00	4.15
192	688088	虹软科技	652,864.28	4.13
193	300454	深信服	652,690.00	4.12

194	688558	国盛智科	646,267.54	4.08
195	600362	江西铜业	644,136.00	4.07
196	000728	国元证券	643,512.00	4.07
197	300857	协创数据	642,521.00	4.06
198	605020	永和股份	642,353.00	4.06
199	601117	中国化学	641,872.00	4.06
200	600141	兴发集团	641,622.00	4.05
201	000063	中兴通讯	641,557.00	4.05
202	688981	中芯国际	639,350.99	4.04
203	002939	长城证券	637,637.00	4.03
204	688256	寒武纪	636,665.94	4.02
205	002560	通达股份	632,108.00	3.99
206	601678	滨化股份	629,911.00	3.98
207	600019	宝钢股份	629,081.00	3.97
208	002222	福晶科技	628,900.00	3.97
209	603019	中科曙光	626,967.00	3.96
210	300765	新诺威	626,324.00	3.96
211	000030	富奥股份	617,090.00	3.90
212	300595	欧普康视	616,939.00	3.90
213	600718	东软集团	616,697.00	3.90
214	600760	中航沈飞	614,090.00	3.88
215	301165	锐捷网络	611,805.00	3.87
216	688166	博瑞医药	610,601.55	3.86
217	603228	景旺电子	608,313.00	3.84
218	000830	鲁西化工	608,075.00	3.84
219	603858	步长制药	607,065.00	3.84
220	601555	东吴证券	607,002.00	3.84
221	002624	完美世界	606,774.00	3.83
222	002402	和而泰	606,718.00	3.83
223	603987	康德莱	606,696.00	3.83
224	002111	威海广泰	606,217.00	3.83
225	300850	新强联	605,652.00	3.83
226	603565	中谷物流	604,724.00	3.82
227	600210	紫江企业	604,682.00	3.82
228	688209	英集芯	604,193.89	3.82
229	688007	光峰科技	602,904.90	3.81
230	600888	新疆众和	602,113.00	3.80
231	688382	益方生物	601,929.59	3.80
232	000553	安道麦 A	601,441.07	3.80
233	002957	科瑞技术	601,296.00	3.80
234	688248	南网科技	600,025.49	3.79
235	600356	恒丰纸业	597,854.00	3.78
236	002080	中材科技	596,627.00	3.77

237	002091	江苏国泰	592,854.00	3.75
238	600969	郴电国际	592,129.00	3.74
239	603759	海天股份	591,881.00	3.74
240	002612	朗姿股份	591,070.00	3.73
241	600050	中国联通	590,245.00	3.73
242	605168	三人行	590,189.00	3.73
243	688141	杰华特	588,691.24	3.72
244	600459	贵研铂业	587,713.60	3.71
245	600183	生益科技	586,161.00	3.70
246	600765	中航重机	585,011.00	3.70
247	688261	东微半导	580,652.55	3.67
248	002170	芭田股份	580,624.00	3.67
249	688668	鼎通科技	577,202.15	3.65
250	688286	敏芯股份	576,830.61	3.64
251	002970	锐明技术	573,411.00	3.62
252	002004	华邦健康	572,711.00	3.62
253	002241	歌尔股份	571,446.00	3.61
254	603773	沃格光电	565,085.00	3.57
255	301606	绿联科技	564,904.00	3.57
256	000031	大悦城	563,875.00	3.56
257	600820	隧道股份	563,703.00	3.56
258	000027	深圳能源	562,938.00	3.56
259	600051	宁波联合	562,795.00	3.56
260	000893	亚钾国际	559,387.00	3.53
261	601677	明泰铝业	558,444.00	3.53
262	603979	金诚信	557,772.00	3.52
263	300699	光威复材	557,410.00	3.52
264	688023	安恒信息	557,173.65	3.52
265	002472	双环传动	555,797.00	3.51
266	002807	江阴银行	554,018.00	3.50
267	002539	云图控股	552,208.00	3.49
268	601636	旗滨集团	551,330.00	3.48
269	688588	凌志软件	550,889.13	3.48
270	600959	江苏有线	549,411.00	3.47
271	300919	中伟股份	548,059.00	3.46
272	600713	南京医药	546,068.00	3.45
273	688041	海光信息	542,589.37	3.43
274	600623	华谊集团	542,468.00	3.43
275	301018	申菱环境	541,749.00	3.42
276	688728	格科微	540,835.87	3.42
277	002011	盾安环境	539,594.00	3.41
278	300241	瑞丰光电	538,533.00	3.40
279	300487	蓝晓科技	537,438.00	3.40

280	601766	中国中车	537,246.00	3.39
281	000987	越秀资本	535,591.00	3.38
282	000034	神州数码	535,341.00	3.38
283	002027	分众传媒	534,766.00	3.38
284	688108	赛诺医疗	534,736.64	3.38
285	002850	科达利	534,694.00	3.38
286	002233	塔牌集团	533,843.00	3.37
287	600028	中国石化	532,243.00	3.36
288	601369	陕鼓动力	530,790.00	3.35
289	600160	巨化股份	530,749.00	3.35
290	688066	航天宏图	530,615.86	3.35
291	600262	北方股份	528,926.00	3.34
292	003011	海象新材	528,542.00	3.34
293	002079	苏州固锟	527,815.00	3.33
294	002423	中粮资本	526,297.00	3.33
295	603278	大业股份	525,511.00	3.32
296	000100	TCL 科技	525,064.00	3.32
297	300003	乐普医疗	525,041.00	3.32
298	600547	山东黄金	520,747.00	3.29
299	002649	博彦科技	520,581.00	3.29
300	600522	中天科技	520,167.00	3.29
301	600236	桂冠电力	519,451.00	3.28
302	601137	博威合金	519,249.00	3.28
303	601607	上海医药	518,279.00	3.27
304	688226	威腾电气	518,088.51	3.27
305	600064	南京高科	518,066.00	3.27
306	300999	金龙鱼	517,492.00	3.27
307	000333	美的集团	516,601.00	3.26
308	002056	横店东磁	515,930.00	3.26
309	600507	方大特钢	515,133.00	3.25
310	002387	维信诺	514,405.00	3.25
311	300662	科锐国际	513,743.00	3.25
312	688025	杰普特	513,651.56	3.25
313	300140	节能环保	512,516.00	3.24
314	001301	尚太科技	508,720.00	3.21
315	603025	大豪科技	508,175.00	3.21
316	603733	仙鹤股份	507,856.00	3.21
317	300604	长川科技	507,638.00	3.21
318	601333	广深铁路	506,870.00	3.20
319	605118	力鼎光电	506,753.00	3.20
320	300400	劲拓股份	505,943.00	3.20
321	600694	大商股份	505,925.00	3.20
322	300124	汇川技术	504,697.00	3.19

323	603808	歌力思	504,648.00	3.19
324	688185	康希诺	502,783.47	3.18
325	603187	海容冷链	502,531.00	3.18
326	000156	华数传媒	500,538.00	3.16
327	600030	中信证券	498,000.00	3.15
328	301285	鸿日达	496,314.00	3.14
329	688512	慧智微	495,790.81	3.13
330	300723	一品红	494,885.00	3.13
331	603087	甘李药业	494,624.00	3.13
332	002049	紫光国微	494,090.00	3.12
333	002664	信质集团	491,650.00	3.11
334	603569	长久物流	490,799.00	3.10
335	000898	鞍钢股份	489,919.00	3.10
336	600584	长电科技	489,429.00	3.09
337	002151	北斗星通	488,484.00	3.09
338	000807	云铝股份	488,161.00	3.08
339	688072	拓荆科技	487,728.28	3.08
340	605589	圣泉集团	487,566.00	3.08
341	002212	天融信	486,741.00	3.08
342	300788	中信出版	485,293.00	3.07
343	300101	振芯科技	484,827.00	3.06
344	600566	济川药业	484,199.00	3.06
345	603929	亚翔集成	483,827.00	3.06
346	300012	华测检测	483,610.00	3.06
347	601808	中海油服	483,483.00	3.05
348	002367	康力电梯	482,183.00	3.05
349	300768	迪普科技	481,982.00	3.05
350	600415	小商品城	481,347.00	3.04
351	002074	国轩高科	481,202.00	3.04
352	000708	中信特钢	480,752.00	3.04
353	002545	东方铁塔	478,707.00	3.02
354	603173	福斯达	478,501.00	3.02
355	002546	新联电子	477,064.00	3.01
356	000768	中航西飞	476,373.00	3.01
357	688343	云天励飞	475,857.39	3.01
358	002203	海亮股份	475,153.00	3.00
359	002993	奥海科技	473,941.00	2.99
360	601668	中国建筑	469,349.00	2.97
361	600258	首旅酒店	467,490.00	2.95
362	300073	当升科技	465,941.00	2.94
363	300251	光线传媒	465,758.00	2.94
364	600729	重庆百货	464,659.00	2.94
365	603508	思维列控	463,598.00	2.93

366	000823	超声电子	463,479.00	2.93
367	300136	信维通信	462,977.00	2.93
368	600499	科达制造	462,046.00	2.92
369	000887	中鼎股份	461,827.00	2.92
370	300724	捷佳伟创	461,816.00	2.92
371	688267	中触媒	461,769.11	2.92
372	001979	招商蛇口	460,469.00	2.91
373	300395	菲利华	460,104.00	2.91
374	000791	甘肃能源	459,502.00	2.90
375	600862	中航高科	458,809.00	2.90
376	300950	德固特	457,534.00	2.89
377	002823	凯中精密	456,933.00	2.89
378	600673	东阳光	456,823.00	2.89
379	600267	海正药业	456,784.00	2.89
380	688259	创耀科技	456,734.93	2.89
381	603815	交建股份	455,587.00	2.88
382	301283	聚胶股份	454,757.00	2.87
383	688162	巨一科技	454,612.65	2.87
384	300320	海达股份	454,041.00	2.87
385	000404	长虹华意	451,517.00	2.85
386	600970	中材国际	451,455.00	2.85
387	000498	山东路桥	451,238.00	2.85
388	001914	招商积余	450,981.00	2.85
389	600378	昊华科技	450,756.00	2.85
390	002948	青岛银行	450,465.00	2.85
391	600039	四川路桥	449,976.00	2.84
392	600429	三元股份	446,925.00	2.82
393	300726	宏达电子	446,612.00	2.82
394	002139	拓邦股份	446,274.00	2.82
395	300415	伊之密	445,094.00	2.81
396	601601	中国太保	444,875.00	2.81
397	002048	宁波华翔	442,229.00	2.79
398	603267	鸿远电子	441,815.00	2.79
399	300627	华测导航	440,768.20	2.78
400	688127	蓝特光学	440,371.09	2.78
401	603568	伟明环保	440,210.00	2.78
402	600583	海油工程	438,094.00	2.77
403	002454	松芝股份	436,998.00	2.76
404	600098	广州发展	436,266.00	2.76
405	002152	广电运通	435,928.00	2.75
406	688030	山石网科	435,806.42	2.75
407	688368	晶丰明源	434,936.59	2.75
408	688082	盛美上海	434,744.18	2.75

409	601898	中煤能源	433,283.00	2.74
410	002468	申通快递	433,154.00	2.74
411	600196	复星医药	433,116.00	2.74
412	300182	捷成股份	432,512.00	2.73
413	301090	华润材料	431,618.00	2.73
414	603282	亚光股份	431,414.00	2.73
415	300270	中威电子	431,257.00	2.72
416	002063	远光软件	430,526.00	2.72
417	300098	高新兴	430,395.00	2.72
418	002690	美亚光电	430,168.00	2.72
419	300365	恒华科技	428,334.00	2.71
420	300491	通合科技	427,730.00	2.70
421	002405	四维图新	427,681.00	2.70
422	688428	诺诚健华	427,657.93	2.70
423	002838	道恩股份	427,442.00	2.70
424	600977	中国电影	426,680.00	2.70
425	301052	果麦文化	425,364.00	2.69
426	002552	宝鼎科技	424,873.00	2.68
427	600021	上海电力	424,416.00	2.68
428	603856	东宏股份	424,364.00	2.68
429	002947	恒铭达	424,351.00	2.68
430	601777	千里科技	424,120.00	2.68
431	002434	万里扬	423,181.00	2.67
432	001283	豪鹏科技	422,142.00	2.67
433	600061	国投资本	421,034.00	2.66
434	688425	铁建重工	420,137.22	2.65
435	688777	中控技术	419,572.87	2.65
436	002266	浙富控股	419,461.00	2.65
437	000895	双汇发展	418,580.00	2.64
438	601618	中国中冶	418,224.00	2.64
439	601872	招商轮船	417,439.00	2.64
440	688029	南微医学	416,856.99	2.63
441	300743	天地数码	416,331.00	2.63
442	301589	诺瓦星云	416,319.00	2.63
443	000501	武商集团	416,209.00	2.63
444	600486	扬农化工	415,529.00	2.63
445	000425	徐工机械	415,503.00	2.63
446	601886	江河集团	414,272.00	2.62
447	300803	指南针	413,478.00	2.61
448	003031	中瓷电子	411,286.00	2.60
449	600089	特变电工	411,183.00	2.60
450	300708	聚灿光电	411,165.00	2.60
451	300445	康斯特	411,085.00	2.60

452	002897	意华股份	410,643.00	2.59
453	000915	华特达因	409,237.00	2.59
454	002815	崇达技术	408,530.00	2.58
455	600768	宁波富邦	406,275.00	2.57
456	300988	津荣天宇	406,169.00	2.57
457	600380	健康元	406,142.00	2.57
458	002653	海思科	406,127.00	2.57
459	300916	朗特智能	405,278.00	2.56
460	603365	水星家纺	403,986.00	2.55
461	300450	先导智能	403,789.00	2.55
462	301029	怡合达	402,875.00	2.55
463	000029	深深房 A	402,473.00	2.54
464	688288	鸿泉技术	402,365.14	2.54
465	688070	纵横股份	402,197.95	2.54
466	000975	山金国际	401,974.00	2.54
467	300458	全志科技	401,819.00	2.54
468	000899	赣能股份	400,960.20	2.53
469	300223	北京君正	399,837.00	2.53
470	000408	藏格矿业	399,155.00	2.52
471	600268	国电南自	398,392.00	2.52
472	002368	太极股份	397,162.00	2.51
473	300636	同和药业	396,454.00	2.50
474	300824	北鼎股份	396,255.00	2.50
475	601288	农业银行	395,741.00	2.50
476	300005	探路者	394,711.00	2.49
477	688636	智明达	394,656.51	2.49
478	600369	西南证券	394,119.00	2.49
479	600216	浙江医药	393,136.00	2.48
480	002185	华天科技	392,562.00	2.48
481	300303	聚飞光电	391,860.00	2.48
482	688334	西高院	391,653.19	2.47
483	600273	嘉化能源	391,414.00	2.47
484	688328	深科达	390,745.40	2.47
485	002746	仙坛股份	390,520.00	2.47
486	603309	维力医疗	389,652.00	2.46
487	002635	安洁科技	389,072.00	2.46
488	301263	泰恩康	388,837.00	2.46
489	002603	以岭药业	388,828.00	2.46
490	001286	陕西能源	388,595.00	2.46
491	600933	爱柯迪	387,617.00	2.45
492	603700	宁水集团	387,060.00	2.45
493	600764	中国海防	386,482.00	2.44
494	688608	恒玄科技	386,219.78	2.44

495	300014	亿纬锂能	385,651.00	2.44
496	300206	理邦仪器	385,280.00	2.43
497	301059	金三江	385,137.00	2.43
498	601633	长城汽车	384,903.00	2.43
499	000534	万泽股份	384,679.00	2.43
500	601958	金钼股份	384,424.00	2.43
501	605499	东鹏饮料	383,958.00	2.43
502	603281	江瀚新材	383,479.00	2.42
503	603529	爱玛科技	383,045.00	2.42
504	002997	瑞鹄模具	382,618.00	2.42
505	605305	中际联合	381,037.00	2.41
506	002817	黄山胶囊	380,942.00	2.41
507	600901	江苏金租	379,268.00	2.40
508	600266	城建发展	378,812.00	2.39
509	300228	富瑞特装	377,448.00	2.38
510	600850	电科数字	376,292.00	2.38
511	301397	溯联股份	375,961.00	2.38
512	688657	浩辰软件	375,845.64	2.37
513	300596	利安隆	375,810.00	2.37
514	603739	蔚蓝生物	375,321.00	2.37
515	688027	国盾量子	374,198.79	2.36
516	300413	芒果超媒	374,083.00	2.36
517	601628	中国人寿	373,752.00	2.36
518	600489	中金黄金	373,200.00	2.36
519	600082	海泰发展	372,920.00	2.36
520	002714	牧原股份	371,398.00	2.35
521	601186	中国铁建	371,050.00	2.34
522	600710	苏美达	370,636.00	2.34
523	600875	东方电气	370,042.00	2.34
524	002928	华夏航空	369,691.00	2.34
525	688113	联测科技	369,558.99	2.33
526	600884	杉杉股份	369,557.00	2.33
527	301061	匠心家居	368,782.00	2.33
528	300615	欣天科技	367,043.00	2.32
529	600587	新华医疗	366,945.00	2.32
530	301007	德迈仕	366,846.00	2.32
531	600655	豫园股份	366,436.00	2.32
532	688270	臻镭科技	366,343.28	2.31
533	300318	博晖创新	365,482.00	2.31
534	000042	中洲控股	364,098.00	2.30
535	002036	联创电子	363,363.00	2.30
536	601216	君正集团	362,743.00	2.29
537	001258	立新能源	360,403.00	2.28

538	003013	地铁设计	360,324.00	2.28
539	301095	广立微	360,107.00	2.28
540	002352	顺丰控股	359,886.00	2.27
541	605056	咸亨国际	359,364.00	2.27
542	300259	新天科技	359,186.00	2.27
543	002906	华阳集团	359,016.00	2.27
544	300083	创世纪	357,837.00	2.26
545	002448	中原内配	357,387.00	2.26
546	688630	芯碁微装	357,199.52	2.26
547	600020	中原高速	356,667.00	2.25
548	002335	科华数据	356,345.00	2.25
549	000166	申万宏源	355,603.00	2.25
550	601600	中国铝业	354,871.00	2.24
551	000028	国药一致	354,448.00	2.24
552	688200	华峰测控	353,915.94	2.24
553	300306	远方信息	352,610.00	2.23
554	688051	佳华科技	352,480.92	2.23
555	000651	格力电器	352,343.00	2.23
556	688026	洁特生物	352,295.18	2.23
557	002133	广宇集团	352,257.00	2.23
558	603035	常熟汽饰	351,704.00	2.22
559	002215	诺普信	351,453.00	2.22
560	688700	东威科技	351,356.57	2.22
561	688063	派能科技	351,331.45	2.22
562	600703	三安光电	351,098.00	2.22
563	002440	闰土股份	351,068.00	2.22
564	002465	海格通信	350,591.00	2.22
565	300842	帝科股份	350,472.00	2.21
566	600153	建发股份	349,684.00	2.21
567	688233	神工股份	349,408.07	2.21
568	603197	保隆科技	348,446.00	2.20
569	688610	埃科光电	347,603.60	2.20
570	600690	海尔智家	346,389.00	2.19
571	688045	必易微	344,939.77	2.18
572	002484	江海股份	344,574.00	2.18
573	601888	中国中免	344,533.00	2.18
574	600332	白云山	344,165.00	2.17
575	600707	彩虹股份	344,133.00	2.17
576	688739	成大生物	343,092.55	2.17
577	600528	中铁工业	341,959.00	2.16
578	000738	航发控制	341,404.00	2.16
579	600795	国电电力	341,071.00	2.16
580	000612	焦作万方	340,270.00	2.15

581	603612	索通发展	339,771.00	2.15
582	600785	新华百货	339,329.00	2.14
583	688567	孚能科技	339,265.19	2.14
584	600329	达仁堂	339,129.00	2.14
585	300319	麦捷科技	339,123.00	2.14
586	002847	盐津铺子	339,042.00	2.14
587	601179	中国西电	337,768.00	2.13
588	300034	钢研高纳	337,480.00	2.13
589	601669	中国电建	337,409.00	2.13
590	603167	渤海轮渡	336,504.00	2.13
591	688623	双元科技	335,748.49	2.12
592	002039	黔源电力	334,390.00	2.11
593	603699	纽威股份	334,274.00	2.11
594	002745	木林森	332,877.00	2.10
595	688523	航天环宇	332,809.72	2.10
596	002364	中恒电气	332,234.00	2.10
597	300812	易天股份	332,100.00	2.10
598	600120	浙江东方	331,559.00	2.09
599	300150	世纪瑞尔	331,381.00	2.09
600	300037	新宙邦	331,119.00	2.09
601	688418	震有科技	330,719.43	2.09
602	603312	西典新能	330,712.00	2.09
603	688128	中国电研	330,624.79	2.09
604	600118	中国卫星	329,643.00	2.08
605	002984	森麒麟	328,487.00	2.08
606	000630	铜陵有色	328,462.00	2.08
607	601068	中铝国际	328,366.00	2.07
608	603357	设计总院	327,570.00	2.07
609	002334	英威腾	327,471.00	2.07
610	600754	锦江酒店	327,218.00	2.07
611	002556	辉隆股份	327,013.00	2.07
612	605567	春雪食品	326,584.00	2.06
613	002976	瑞玛精密	326,103.00	2.06
614	002916	深南电路	326,002.00	2.06
615	601800	中国交建	325,647.00	2.06
616	605376	博迁新材	325,631.00	2.06
617	688278	特宝生物	325,534.93	2.06
618	688213	思特威	325,461.32	2.06
619	000938	紫光股份	325,449.00	2.06
620	002601	龙佰集团	325,136.00	2.05
621	002344	海宁皮城	324,482.00	2.05
622	601881	中国银河	324,313.00	2.05
623	002489	浙江永强	323,727.00	2.05

624	002736	国信证券	323,708.00	2.05
625	300218	安利股份	322,060.00	2.03
626	601108	财通证券	321,726.00	2.03
627	301503	智迪科技	321,658.00	2.03
628	601020	华钰矿业	320,855.00	2.03
629	002863	今飞凯达	320,775.00	2.03
630	002594	比亚迪	319,486.00	2.02
631	000049	德赛电池	319,153.00	2.02
632	600299	安迪苏	319,000.00	2.02
633	600150	中国船舶	318,688.00	2.01
634	002992	宝明科技	318,377.00	2.01
635	300566	激智科技	318,283.00	2.01
636	688586	江航装备	317,870.79	2.01
637	600867	通化东宝	317,841.00	2.01
638	300001	特锐德	317,768.00	2.01
639	002441	众业达	317,268.00	2.00

注：本表中累计买入金额是按照买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	000988	华工科技	2,444,855.00	15.45
2	600487	亨通光电	2,116,134.00	13.37
3	300476	胜宏科技	1,930,235.00	12.20
4	300750	宁德时代	1,751,505.00	11.07
5	600498	烽火通信	1,667,084.00	10.53
6	002202	金风科技	1,446,390.00	9.14
7	000050	深天马 A	1,420,703.00	8.98
8	603486	科沃斯	1,402,082.00	8.86
9	300232	洲明科技	1,313,920.00	8.30
10	000960	锡业股份	1,305,127.00	8.25
11	002396	星网锐捷	1,269,355.00	8.02
12	002558	巨人网络	1,244,890.00	7.87
13	002273	水晶光电	1,214,209.00	7.67
14	600031	三一重工	1,189,879.00	7.52
15	300308	中际旭创	1,180,705.00	7.46
16	601138	工业富联	1,179,331.00	7.45
17	600352	浙江龙盛	1,151,290.00	7.27
18	601877	正泰电器	1,138,931.00	7.20
19	002340	格林美	1,121,285.00	7.08

20	601857	中国石油	1,109,658.00	7.01
21	603259	药明康德	1,086,468.00	6.86
22	603893	瑞芯微	1,085,554.00	6.86
23	300207	欣旺达	1,056,110.00	6.67
24	603799	华友钴业	1,054,414.00	6.66
25	688235	百济神州	1,054,405.51	6.66
26	688249	晶合集成	1,048,102.93	6.62
27	603129	春风动力	1,045,612.00	6.61
28	688122	西部超导	1,039,856.69	6.57
29	601899	紫金矿业	1,036,934.00	6.55
30	600298	安琪酵母	1,021,104.00	6.45
31	688015	交控科技	1,014,184.99	6.41
32	601615	明阳智能	1,004,467.00	6.35
33	301221	光庭信息	984,078.00	6.22
34	600372	中航机载	981,358.00	6.20
35	000936	华西股份	979,227.00	6.19
36	000932	华菱钢铁	977,604.00	6.18
37	600219	南山铝业	975,267.00	6.16
38	688469	芯联集成	971,086.17	6.14
39	000039	中集集团	968,807.00	6.12
40	601168	西部矿业	966,045.00	6.10
41	002284	亚太股份	964,004.00	6.09
42	601311	骆驼股份	963,305.00	6.09
43	002918	蒙娜丽莎	960,639.00	6.07
44	601318	中国平安	957,524.00	6.05
45	600742	富维股份	952,240.00	6.02
46	603444	吉比特	950,541.00	6.01
47	600741	华域汽车	946,771.00	5.98
48	000878	云南铜业	944,845.00	5.97
49	600170	上海建工	944,584.00	5.97
50	600109	国金证券	944,211.00	5.97
51	000977	浪潮信息	941,795.00	5.95
52	000726	鲁泰 A	940,689.00	5.94
53	300088	长信科技	939,616.00	5.94
54	002939	长城证券	932,709.00	5.89
55	000733	振华科技	926,769.00	5.86
56	600879	航天电子	921,890.00	5.82
57	300304	云意电气	919,839.00	5.81
58	600699	均胜电子	905,958.00	5.72
59	002782	可立克	903,458.00	5.71
60	000725	京东方 A	897,123.00	5.67
61	300602	飞荣达	894,636.00	5.65
62	000021	深科技	894,610.00	5.65

63	300502	新易盛	891,986.60	5.64
64	688538	和辉光电	888,870.29	5.62
65	002138	顺络电子	886,944.00	5.60
66	600582	天地科技	885,125.00	5.59
67	688387	信科移动	882,656.47	5.58
68	600096	云天化	875,390.00	5.53
69	300469	信息发展	865,942.00	5.47
70	603236	移远通信	857,025.00	5.41
71	000157	中联重科	851,141.00	5.38
72	601728	中国电信	847,023.00	5.35
73	300017	网宿科技	844,343.00	5.33
74	603993	洛阳钼业	839,895.00	5.31
75	600704	物产中大	832,408.00	5.26
76	000729	燕京啤酒	812,552.00	5.13
77	603380	易德龙	809,298.00	5.11
78	603341	龙旗科技	809,282.00	5.11
79	688380	中微半导	807,266.86	5.10
80	002414	高德红外	798,311.00	5.04
81	600362	江西铜业	798,256.00	5.04
82	000959	首钢股份	794,626.00	5.02
83	002236	大华股份	794,353.00	5.02
84	688686	奥普特	790,485.52	4.99
85	600989	宝丰能源	783,741.00	4.95
86	600496	精工钢构	778,014.00	4.92
87	600998	九州通	774,623.00	4.89
88	600460	士兰微	771,495.00	4.87
89	002299	圣农发展	765,890.00	4.84
90	002913	奥士康	765,140.00	4.83
91	600060	海信视像	763,399.00	4.82
92	002373	千方科技	762,587.00	4.82
93	603386	骏亚科技	762,234.00	4.82
94	002532	天山铝业	761,125.00	4.81
95	688099	晶晨股份	744,671.15	4.71
96	000636	风华高科	744,498.00	4.70
97	600728	佳都科技	743,682.00	4.70
98	600718	东软集团	743,287.00	4.70
99	002081	金螳螂	739,909.00	4.67
100	002008	大族激光	737,583.00	4.66
101	301039	中集车辆	734,764.00	4.64
102	002230	科大讯飞	734,607.00	4.64
103	605058	澳弘电子	725,418.00	4.58
104	600497	驰宏锌锗	715,092.00	4.52
105	002353	杰瑞股份	713,456.00	4.51

106	600056	中国医药	712,173.00	4.50
107	603160	汇顶科技	708,337.00	4.48
108	688329	艾隆科技	708,211.00	4.47
109	600578	京能电力	707,083.00	4.47
110	688668	鼎通科技	705,960.34	4.46
111	002517	恺英网络	699,344.00	4.42
112	688208	道通科技	698,877.11	4.42
113	300857	协创数据	696,598.00	4.40
114	601319	中国人保	692,225.00	4.37
115	002560	通达股份	692,124.00	4.37
116	688322	奥比中光	690,947.57	4.37
117	000060	中金岭南	689,640.00	4.36
118	000528	柳工	688,848.00	4.35
119	603111	康尼机电	688,195.00	4.35
120	603678	火炬电子	686,767.00	4.34
121	688123	聚辰股份	685,801.19	4.33
122	601717	中创智领	683,852.00	4.32
123	600315	上海家化	677,615.00	4.28
124	600176	中国巨石	676,392.00	4.27
125	002859	洁美科技	675,387.00	4.27
126	605507	国邦医药	673,777.00	4.26
127	688819	天能股份	672,014.31	4.25
128	603858	步长制药	670,621.00	4.24
129	603228	景旺电子	668,886.00	4.23
130	600114	东睦股份	665,030.00	4.20
131	001696	宗申动力	663,482.00	4.19
132	000401	金隅冀东	661,901.00	4.18
133	002399	海普瑞	661,877.00	4.18
134	300369	绿盟科技	659,920.00	4.17
135	603987	康德莱	658,368.00	4.16
136	600356	恒丰纸业	655,867.00	4.14
137	002415	海康威视	654,342.00	4.13
138	600183	生益科技	653,347.00	4.13
139	000728	国元证券	652,948.00	4.13
140	600038	中直股份	647,500.00	4.09
141	688558	国盛智科	647,135.37	4.09
142	688484	南芯科技	644,847.39	4.07
143	002080	中材科技	642,869.00	4.06
144	301165	锐捷网络	641,111.00	4.05
145	600141	兴发集团	640,135.00	4.04
146	002091	江苏国泰	636,869.00	4.02
147	688141	杰华特	635,806.79	4.02
148	002957	科瑞技术	635,673.00	4.02

149	601555	东吴证券	635,408.00	4.01
150	688209	英集芯	635,039.36	4.01
151	000063	中兴通讯	634,002.00	4.01
152	600685	中船防务	633,812.00	4.00
153	002375	亚厦股份	629,272.00	3.98
154	300595	欧普康视	626,187.00	3.96
155	002595	豪迈科技	624,782.00	3.95
156	603773	沃格光电	623,940.00	3.94
157	300373	扬杰科技	622,999.00	3.94
158	600210	紫江企业	620,639.00	3.92
159	600866	星湖科技	620,010.00	3.92
160	002970	锐明技术	619,361.00	3.91
161	300763	锦浪科技	619,300.00	3.91
162	002004	华邦健康	618,774.00	3.91
163	600335	国机汽车	617,927.00	3.90
164	603456	九洲药业	615,658.00	3.89
165	688588	凌志软件	615,462.48	3.89
166	603659	璞泰来	613,471.00	3.88
167	002410	广联达	612,304.00	3.87
168	600888	新疆众和	611,945.00	3.87
169	002170	芭田股份	611,489.00	3.86
170	688007	光峰科技	610,582.14	3.86
171	688521	芯原股份	610,367.07	3.86
172	600459	贵研铂业	609,839.00	3.85
173	603759	海天股份	608,606.00	3.85
174	688066	航天宏图	608,524.86	3.84
175	688382	益方生物	605,820.16	3.83
176	002212	天融信	605,361.00	3.82
177	600100	同方股份	599,948.00	3.79
178	600660	福耀玻璃	598,110.00	3.78
179	002241	歌尔股份	597,778.00	3.78
180	600988	赤峰黄金	592,396.00	3.74
181	600547	山东黄金	591,590.00	3.74
182	300604	长川科技	590,312.00	3.73
183	002950	奥美医疗	589,921.00	3.73
184	000902	新洋丰	589,129.00	3.72
185	300919	中伟股份	587,867.00	3.71
186	300193	佳士科技	586,405.00	3.71
187	600765	中航重机	584,109.00	3.69
188	601369	陕鼓动力	583,022.00	3.68
189	603233	大参林	580,362.00	3.67
190	603025	大豪科技	580,234.40	3.67
191	600760	中航沈飞	578,434.00	3.65

192	603787	新日股份	577,640.00	3.65
193	300699	光威复材	575,946.00	3.64
194	603379	三美股份	574,960.00	3.63
195	688261	东微半导	573,279.72	3.62
196	300765	新诺威	572,882.00	3.62
197	000807	云铝股份	571,487.00	3.61
198	000830	鲁西化工	571,002.00	3.61
199	300241	瑞丰光电	570,489.00	3.60
200	688097	博众精工	570,323.98	3.60
201	300724	捷佳伟创	568,562.00	3.59
202	002222	福晶科技	568,522.00	3.59
203	000034	神州数码	566,717.00	3.58
204	002444	巨星科技	566,488.00	3.58
205	601991	大唐发电	566,456.00	3.58
206	300257	开山股份	565,842.00	3.58
207	600820	隧道股份	564,304.00	3.57
208	605168	三人行	563,370.00	3.56
209	000027	深圳能源	561,928.16	3.55
210	000783	长江证券	561,036.00	3.54
211	688002	睿创微纳	559,668.74	3.54
212	603979	金诚信	559,655.00	3.54
213	301018	申菱环境	556,687.00	3.52
214	300395	菲利华	555,565.00	3.51
215	002773	康弘药业	555,434.00	3.51
216	002423	中粮资本	554,666.00	3.50
217	000030	富奥股份	553,111.00	3.49
218	002545	东方铁塔	552,973.00	3.49
219	603929	亚翔集成	550,988.00	3.48
220	002027	分众传媒	550,677.00	3.48
221	600064	南京高科	547,936.00	3.46
222	688226	威腾电气	546,777.50	3.45
223	003011	海象新材	546,635.00	3.45
224	600801	华新建材	542,234.00	3.43
225	600713	南京医药	541,500.00	3.42
226	600050	中国联通	539,817.00	3.41
227	603278	大业股份	539,533.00	3.41
228	002472	双环传动	538,377.00	3.40
229	601678	滨化股份	538,032.00	3.40
230	002807	江阴银行	536,322.00	3.39
231	002624	完美世界	535,478.00	3.38
232	000031	大悦城	534,255.00	3.38
233	300496	中科创达	534,119.00	3.37
234	000893	亚钾国际	531,856.00	3.36

235	688008	澜起科技	531,820.11	3.36
236	002539	云图控股	531,076.00	3.36
237	002151	北斗星通	531,060.00	3.36
238	000600	建投能源	528,042.00	3.34
239	000623	吉林敖东	525,732.00	3.32
240	300140	节能环境	524,530.00	3.31
241	605118	力鼎光电	524,376.00	3.31
242	688108	赛诺医疗	523,047.83	3.30
243	300101	振芯科技	515,916.00	3.26
244	603173	福斯达	511,823.00	3.23
245	688425	铁建重工	511,549.94	3.23
246	000553	安道麦 A	508,123.00	3.21
247	300768	迪普科技	504,178.00	3.19
248	000333	美的集团	503,786.00	3.18
249	002056	横店东磁	502,758.00	3.18
250	600673	东阳光	501,868.00	3.17
251	601607	上海医药	501,724.00	3.17
252	600236	桂冠电力	500,955.00	3.17
253	600694	大商股份	499,283.50	3.15
254	688082	盛美上海	499,066.60	3.15
255	600623	华谊集团	497,769.00	3.15
256	601618	中国中冶	497,695.00	3.14
257	601677	明泰铝业	497,179.00	3.14
258	688343	云天励飞	496,395.12	3.14
259	688512	慧智微	496,156.79	3.13
260	002387	维信诺	496,009.00	3.13
261	600499	科达制造	495,467.00	3.13
262	603733	仙鹤股份	492,158.00	3.11
263	600959	江苏有线	491,952.00	3.11
264	688023	安恒信息	490,401.01	3.10
265	600019	宝钢股份	489,799.00	3.09
266	601233	桐昆股份	489,419.00	3.09
267	688728	格科微	489,247.28	3.09
268	002434	万里扬	489,182.00	3.09
269	603565	中谷物流	487,308.00	3.08
270	300136	信维通信	486,407.00	3.07
271	002850	科达利	484,340.80	3.06
272	605589	圣泉集团	483,380.00	3.05
273	300788	中信出版	483,032.00	3.05
274	002546	新联电子	480,619.00	3.04
275	603087	甘李药业	479,869.00	3.03
276	600282	南钢股份	478,872.00	3.03
277	000898	鞍钢股份	478,565.00	3.02

278	688286	敏芯股份	478,270.87	3.02
279	300400	劲拓股份	478,168.00	3.02
280	600021	上海电力	477,963.00	3.02
281	000408	藏格矿业	477,231.00	3.02
282	600166	福田汽车	476,541.00	3.01
283	600429	三元股份	476,171.00	3.01
284	600977	中国电影	473,839.00	2.99
285	688371	菲沃泰	473,436.15	2.99
286	300627	华测导航	472,561.00	2.99
287	002714	牧原股份	472,532.00	2.99
288	300274	阳光电源	472,211.00	2.98
289	002079	苏州固锴	471,390.00	2.98
290	601777	千里科技	469,787.00	2.97
291	000156	华数传媒	469,620.00	2.97
292	300726	宏达电子	466,021.00	2.94
293	002139	拓邦股份	465,673.00	2.94
294	300182	捷成股份	465,598.00	2.94
295	600258	首旅酒店	464,753.00	2.94
296	601886	江河集团	464,018.00	2.93
297	688981	中芯国际	462,084.03	2.92
298	688162	巨一科技	461,190.63	2.91
299	600039	四川路桥	460,876.00	2.91
300	002653	海思科	460,254.00	2.91
301	603569	长久物流	458,316.00	2.90
302	002266	浙富控股	458,067.00	2.89
303	601117	中国化学	457,948.00	2.89
304	605020	永和股份	457,612.00	2.89
305	300270	中威电子	456,895.00	2.89
306	601766	中国中车	455,122.00	2.88
307	601668	中国建筑	454,865.00	2.87
308	600380	健康元	454,797.00	2.87
309	300251	光线传媒	454,785.00	2.87
310	600028	中国石化	454,354.00	2.87
311	603508	思维列控	453,008.00	2.86
312	002487	大金重工	452,067.00	2.86
313	002011	盾安环境	451,617.00	2.85
314	688041	海光信息	449,987.49	2.84
315	600522	中天科技	449,174.00	2.84
316	000987	越秀资本	448,726.00	2.84
317	601137	博威合金	448,345.00	2.83
318	002405	四维图新	447,599.00	2.83
319	300365	恒华科技	445,036.00	2.81
320	000534	万泽股份	444,960.00	2.81

321	002947	恒铭达	444,841.00	2.81
322	300098	高新兴	443,715.00	2.80
323	600517	国网英大	443,149.00	2.80
324	301606	绿联科技	442,864.00	2.80
325	002948	青岛银行	442,650.00	2.80
326	301397	溯联股份	441,888.00	2.79
327	688030	山石网科	440,256.26	2.78
328	003031	中瓷电子	439,891.00	2.78
329	688185	康希诺	439,718.97	2.78
330	600489	中金黄金	439,047.00	2.77
331	300803	指南针	438,965.40	2.77
332	688368	晶丰明源	437,610.31	2.76
333	300223	北京君正	434,823.00	2.75
334	688027	国盾量子	434,345.43	2.74
335	600061	国投资本	434,339.00	2.74
336	000791	甘肃能源	433,720.00	2.74
337	002048	宁波华翔	433,579.00	2.74
338	600089	特变电工	433,309.00	2.74
339	002063	远光软件	433,099.00	2.74
340	301035	润丰股份	431,587.00	2.73
341	000425	徐工机械	431,399.00	2.73
342	688328	深科达	430,495.17	2.72
343	300491	通合科技	430,365.00	2.72
344	300445	康斯特	430,286.00	2.72
345	300988	津荣天宇	428,484.00	2.71
346	688608	恒玄科技	426,179.63	2.69
347	688428	诺诚健华	425,858.20	2.69
348	002049	紫光国微	425,670.00	2.69
349	300454	深信服	425,402.00	2.69
350	000501	武商集团	422,173.00	2.67
351	601628	中国人寿	421,860.00	2.67
352	000404	长虹华意	421,050.00	2.66
353	600507	方大特钢	420,972.00	2.66
354	600862	中航高科	420,597.00	2.66
355	001301	尚太科技	420,390.00	2.66
356	600268	国电南自	419,432.00	2.65
357	600196	复星医药	419,351.00	2.65
358	688233	神工股份	418,220.40	2.64
359	001979	招商蛇口	417,884.00	2.64
360	002612	朗姿股份	417,609.00	2.64
361	000589	贵州轮胎	417,279.00	2.64
362	300916	朗特智能	416,673.00	2.63
363	600584	长电科技	416,339.00	2.63

364	601872	招商轮船	415,946.00	2.63
365	600104	上汽集团	415,937.00	2.63
366	002928	华夏航空	415,615.00	2.63
367	300303	聚飞光电	414,592.00	2.62
368	002293	罗莱生活	412,117.00	2.60
369	300708	聚灿光电	411,808.50	2.60
370	688657	浩辰软件	411,076.33	2.60
371	300228	富瑞特装	410,538.00	2.59
372	002815	崇达技术	410,488.00	2.59
373	002745	木林森	408,753.00	2.58
374	688091	上海谊众	407,073.69	2.57
375	600011	华能国际	406,900.00	2.57
376	301090	华润材料	404,382.00	2.56
377	688630	芯碁微装	402,366.78	2.54
378	600703	三安光电	401,592.00	2.54
379	002368	太极股份	401,335.00	2.54
380	300289	利德曼	399,899.00	2.53
381	600710	苏美达	399,503.00	2.52
382	600649	城投控股	399,235.00	2.52
383	002352	顺丰控股	398,764.00	2.52
384	600369	西南证券	398,574.00	2.52
385	600884	杉杉股份	398,533.00	2.52
386	002690	美亚光电	398,207.00	2.52
387	301529	福赛科技	397,643.00	2.51
388	601339	百隆东方	395,477.00	2.50
389	600118	中国卫星	395,405.00	2.50
390	600655	豫园股份	394,901.00	2.50
391	600587	新华医疗	394,607.00	2.49
392	600875	东方电气	393,949.00	2.49
393	688612	威迈斯	393,944.64	2.49
394	688288	鸿泉技术	393,872.66	2.49
395	301029	怡合达	393,459.00	2.49
396	601633	长城汽车	392,108.00	2.48
397	600764	中国海防	391,997.00	2.48
398	300850	新强联	391,665.00	2.47
399	600273	嘉化能源	391,288.00	2.47
400	002203	海亮股份	391,028.00	2.47
401	603296	华勤技术	391,014.00	2.47
402	603612	索通发展	390,747.00	2.47
403	000708	中信特钢	390,715.00	2.47
404	300037	新宙邦	389,686.00	2.46
405	603365	水星家纺	389,486.00	2.46
406	600528	中铁工业	388,651.00	2.46

407	605305	中际联合	388,490.00	2.45
408	002906	华阳集团	388,272.00	2.45
409	002594	比亚迪	388,101.00	2.45
410	300001	特锐德	387,522.00	2.45
411	301095	广立微	387,266.00	2.45
412	000975	山金国际	386,763.00	2.44
413	000651	格力电器	386,702.00	2.44
414	300014	亿纬锂能	386,300.00	2.44
415	600873	梅花生物	386,124.00	2.44
416	603035	常熟汽饰	385,431.00	2.44
417	688270	臻镭科技	385,337.57	2.43
418	300124	汇川技术	384,513.00	2.43
419	300842	帝科股份	383,836.00	2.43
420	600329	达仁堂	383,748.00	2.42
421	605499	东鹏饮料	382,730.00	2.42
422	688586	江航装备	382,719.84	2.42
423	600850	电科数字	382,697.00	2.42
424	300487	蓝晓科技	382,499.00	2.42
425	688128	中国电研	381,762.15	2.41
426	688088	虹软科技	381,030.71	2.41
427	603267	鸿远电子	379,855.00	2.40
428	600266	城建发展	379,326.00	2.40
429	603187	海容冷链	378,749.00	2.39
430	000823	超声电子	377,281.00	2.38
431	601636	旗滨集团	376,258.00	2.38
432	603568	伟明环保	375,895.00	2.38
433	300433	蓝思科技	375,635.00	2.37
434	002335	科华数据	374,596.00	2.37
435	601669	中国电建	374,347.00	2.37
436	002468	申通快递	374,174.00	2.36
437	601888	中国中免	373,783.00	2.36
438	600895	张江高科	373,476.00	2.36
439	000042	中洲控股	373,405.00	2.36
440	600969	郴电国际	372,472.00	2.35
441	603629	利通电子	371,505.00	2.35
442	600729	重庆百货	371,400.00	2.35
443	688026	洁特生物	369,609.92	2.34
444	601601	中国太保	369,199.00	2.33
445	002364	中恒电气	369,084.00	2.33
446	688523	航天环宇	369,076.81	2.33
447	600745	闻泰科技	368,999.00	2.33
448	002036	联创电子	368,488.00	2.33
449	301263	泰恩康	366,928.00	2.32

450	688051	佳华科技	366,773.64	2.32
451	601600	中国铝业	366,592.00	2.32
452	688113	联测科技	366,242.66	2.31
453	000887	中鼎股份	366,158.00	2.31
454	002206	海利得	365,235.00	2.31
455	603309	维力医疗	364,074.00	2.30
456	000895	双汇发展	363,234.00	2.30
457	300443	金雷股份	362,574.00	2.29
458	300596	利安隆	362,025.00	2.29
459	002185	华天科技	361,264.00	2.28
460	600160	巨化股份	360,894.00	2.28
461	002635	安洁科技	360,460.00	2.28
462	600785	新华百货	360,412.00	2.28
463	002625	光启技术	360,287.00	2.28
464	300259	新天科技	360,024.00	2.27
465	688167	炬光科技	359,670.30	2.27
466	000612	焦作万方	359,043.00	2.27
467	301052	果麦文化	358,951.00	2.27
468	688334	西高院	357,758.37	2.26
469	002997	瑞鹄模具	357,646.00	2.26
470	002746	仙坛股份	357,580.00	2.26
471	000028	国药一致	357,085.80	2.26
472	002664	信质集团	357,044.00	2.26
473	688072	拓荆科技	356,985.59	2.26
474	002736	国信证券	356,938.00	2.26
475	688777	中控技术	356,830.52	2.25
476	600153	建发股份	356,584.00	2.25
477	300450	先导智能	356,416.00	2.25
478	002152	广电运通	356,305.00	2.25
479	300812	易天股份	356,201.00	2.25
480	002281	光迅科技	356,085.00	2.25
481	300034	钢研高纳	355,718.00	2.25
482	688256	寒武纪	355,544.12	2.25
483	002133	广宇集团	355,544.00	2.25
484	300331	苏大维格	355,451.00	2.25
485	688029	南微医学	354,510.40	2.24
486	300415	伊之密	354,158.00	2.24
487	600332	白云山	354,129.00	2.24
488	601179	中国西电	353,047.00	2.23
489	600262	北方股份	352,627.00	2.23
490	300319	麦捷科技	351,752.00	2.22
491	688567	孚能科技	350,311.18	2.21
492	301589	诺瓦星云	348,924.00	2.20

493	002534	西子洁能	348,791.00	2.20
494	002249	大洋电机	348,580.00	2.20
495	603699	纽威股份	347,409.00	2.20
496	600057	厦门象屿	347,252.00	2.19
497	603739	蔚蓝生物	347,191.00	2.19
498	300636	同和药业	345,767.00	2.18
499	688063	派能科技	345,390.50	2.18
500	002847	盐津铺子	344,514.00	2.18
501	001283	豪鹏科技	344,360.00	2.18
502	600267	海正药业	343,180.00	2.17
503	001258	立新能源	343,064.00	2.17
504	003022	联泓新科	343,046.00	2.17
505	000049	德赛电池	342,815.00	2.17
506	002430	杭氧股份	341,662.00	2.16
507	600707	彩虹股份	341,143.00	2.16
508	688418	震有科技	341,110.27	2.16
509	002156	通富微电	340,660.00	2.15
510	300306	远方信息	340,654.00	2.15
511	002215	诺普信	340,529.00	2.15
512	301061	匠心家居	340,223.00	2.15
513	002484	江海股份	339,647.00	2.15
514	603312	西典新能	339,121.00	2.14
515	600299	安迪苏	338,925.00	2.14
516	300218	安利股份	338,779.00	2.14
517	603167	渤海轮渡	338,373.00	2.14
518	601186	中国铁建	338,073.00	2.14
519	300150	世纪瑞尔	337,783.00	2.13
520	600120	浙江东方	337,713.00	2.13
521	600216	浙江医药	336,449.00	2.13
522	000768	中航西飞	335,960.00	2.12
523	600323	瀚蓝环境	335,749.00	2.12
524	688739	成大生物	335,428.20	2.12
525	603197	保隆科技	335,230.00	2.12
526	688248	南网科技	333,950.95	2.11
527	002838	道恩股份	332,070.00	2.10
528	002768	国恩股份	331,905.00	2.10
529	002233	塔牌集团	331,782.00	2.10
530	601231	环旭电子	331,590.00	2.10
531	002394	联发股份	330,376.00	2.09
532	002976	瑞玛精密	329,180.00	2.08
533	000738	航发控制	328,983.00	2.08
534	002344	海宁皮城	328,476.00	2.08
535	300323	华灿光电	328,178.00	2.07

536	002777	久远银海	328,129.00	2.07
537	600486	扬农化工	328,063.00	2.07
538	300389	艾比森	327,371.00	2.07
539	300950	德固特	327,210.00	2.07
540	000919	金陵药业	326,004.00	2.06
541	002204	大连重工	325,349.00	2.06
542	603358	华达科技	324,117.00	2.05
543	600933	爱柯迪	324,014.00	2.05
544	002960	青鸟消防	323,578.00	2.04
545	002649	博彦科技	323,440.00	2.04
546	605056	咸亨国际	323,424.00	2.04
547	688658	悦康药业	323,388.37	2.04
548	688772	珠海冠宇	322,812.45	2.04
549	301488	豪恩汽电	322,615.00	2.04
550	301503	智迪科技	322,303.00	2.04
551	600271	航天信息	321,639.00	2.03
552	600115	中国东航	321,633.00	2.03
553	002228	合兴包装	321,202.00	2.03
554	688456	有研粉材	321,012.14	2.03
555	688166	博瑞医药	320,456.42	2.02
556	600755	厦门国贸	319,211.00	2.02
557	002863	今飞凯达	318,544.00	2.01
558	300615	欣天科技	317,754.00	2.01
559	603229	奥翔药业	317,679.00	2.01

注：本表中累计卖出金额是按照卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	580,449,855.70
卖出股票的收入（成交）总额	523,443,623.60

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金未参与投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金未参与投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金未参与投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库的情形。

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	44,193.59
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,257,392.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,301,586.25

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
信澳量化多 因子混合 (LOF) A	747	38,663.43	8,171,913.49	28.29%	20,709,669.61	71.71%
信澳量化多 因子混合 (LOF) C	537	79,341.16	11,090,094.48	26.03%	31,516,107.43	73.97%
合计	1,284	55,675.85	19,262,007.97	26.94%	52,225,777.04	73.06%

9.2 期末上市基金前十名持有人

信澳量化多因子混合（LOF）A

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比 例
1	郭锐	244,892.00	10.96%
2	杨凯	210,448.00	9.42%
3	毛伟松	204,998.00	9.17%
4	张啸然	81,999.00	3.67%
5	任恒恒	59,300.00	2.65%
6	蔡洪梅	57,732.00	2.58%
7	崔冰	50,001.00	2.24%
8	周波	38,061.00	1.70%
9	林俊汉	34,166.00	1.53%
10	殷密仙	31,903.00	1.43%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 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	信澳量化多因子混合 (LOF) A	84,169.19	0.29%
	信澳量化多因子混合 (LOF) C	8,566.72	0.02%
	合计	92,735.91	0.13%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理 人员、基金投资和 研究部门负责人 持有本开放式基 金	信澳量化多因子混合 (LOF) A	0
	信澳量化多因子混合 (LOF) C	0
	合计	0
本基金基金经理 持有本开放式基 金	信澳量化多因子混合 (LOF) A	0~10
	信澳量化多因子混合 (LOF) C	0
	合计	0~10

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	信澳量化多因子混合	信澳量化多因子混合
----	-----------	-----------

	(LOF) A	(LOF) C
基金合同生效日(2019年11月6日)基金份额总额	225,841,133.97	106,489,634.84
本报告期期初基金份额总额	4,910,402.24	10,325,368.99
本报告期基金总申购份额	44,886,087.92	245,811,610.36
减:本报告期基金总赎回份额	20,914,907.06	213,530,777.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	28,881,583.10	42,606,201.91

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内,未召开基金份额持有人大会,未有相关决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2025年3月12日,本基金管理人经第六届董事会第三十三次会议决定,潘广建先生离任副董事长。2025年3月21日,公司新任命余源志先生为公司督察长,原督察长黄晖女士离任。2025年3月31日,本基金第六届董事会第三十四次会议决定,宋加旺先生离任副总经理,张丽洁女士担任公司副总经理。2025年5月7日,本基金第六届董事会第三十六次会议决定,魏庆孔先生离任副总经理。2025年7月28日,本基金管理人经第六届董事会第三十七次会议决定,王建华先生离任公司副总经理。2025年8月22日,第六届董事会第三十八次会议决定,祝瑞敏离任董事长职务,商健代为履行董事长职务。2025年9月5日,第六届董事会第三十九次会议决定,朱永强先生到龄退休,由方敬先生代为履行公司总经理职务。2025年12月5日,第六届董事会第四十一次会议决定,任命方敬先生担任公司总经理。2025年12月25日,第六届董事会第四十三次会议决定,任命唐伦飞先生担任公司董事长,鲁力先生离任副总经理。

本报告期内,经中国银行股份有限公司研究决定,聘任边济东先生为资产托管部总经理。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

报告期内,未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内,未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金管理人继续聘任安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金的外部审计机构。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为 4328.77 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

无。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

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	
中泰证券	2	457,612,816.57	41.45%	208,601.44	41.46%	-
中信证券	1	367,064,724.59	33.25%	167,224.61	33.24%	-
光大证券	2	128,356,003.68	11.63%	58,497.92	11.63%	-
长江证券	1	105,060,725.16	9.52%	47,900.56	9.52%	-

中银国际	2	45,799,209.30	4.15%	20,882.28	4.15%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准：

- (1) 财务状况良好；
- (2) 经营行为规范；
- (3) 最近三年内没有因重大违法违规行为、重大失信行为被监管部门采取行政处罚或者刑事处罚；
- (4) 不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；
- (5) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；
- (6) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期不定期地向公司提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据公司所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；
- (7) 提供券商结算业务的证券公司应具备相应的风险控制能力；
- (8) 能协助公司拓展资产管理业务和能力，促进公司业务发展。

2、基金管理人根据以上标准进行考察后确定合作的证券公司。基金管理人与被选择的证券公司签订相关协议。

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
中泰证券	-	-	3,756,000.00	0.43%	-	-
中信证券	-	-	873,900,000.00	99.57%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

国联民生	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	信达澳亚基金管理有限公司关于对个人投资者通过超级现金宝交易实施费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2025-01-14
2	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2024年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-21
3	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2025-03-15
4	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) (信澳量化多因子混合(LOF) C) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-03-18
5	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) (信澳量化多因子混合(LOF) A) 基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-03-18
6	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2025-03-18
7	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-22
8	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
9	信达澳亚基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2024年度)	中国证监会规定媒介	2025-03-31
10	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-02
11	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2025年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-21
12	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-05-08
13	信达澳亚基金管理有限公司关于实际控制人变更获得中国证监会核准的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-10
14	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2025年第二季度报告	中国证监会规定媒介	2025-07-18
15	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-07-30
16	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-08-21
17	信达澳亚基金管理有限公司关于董事长离任及代行董事长职务的公告	中国证监会规定媒介	2025-08-23
18	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF) 2025	中国证监会规	2025-08-29

	年中期报告	定媒介	
19	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-09-04
20	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-09-06
21	信达澳亚基金管理有限公司关于提醒投资者防范金融诈骗的提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-10-16
22	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-16
23	信达澳亚基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-18
24	信达澳亚基金管理有限公司关于旗下基金费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-23
25	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)2025年第三季度报告	中国证监会规定媒介	2025-10-27
26	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-06
27	信达澳亚基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-27
28	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)招募说明书更新	中国证监会规定媒介	2025-12-29
29	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)C)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-12-29
30	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)(信澳量化多因子混合(LOF)A)基金产品资料概要更新	中国证监会规定媒介	2025-12-29
31	信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)A类份额二级市场交易价格溢价风险提示	中国证监会规定媒介	2025-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《信澳量化多因子混合型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、本报告期内公开披露的基金资产净值、基金份额净值及其他临时公告；
- 8、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及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。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。

客户服务中心电话：400-8888-118

网址：www.fscinda.com

信达澳亚基金管理有限公司

二〇二六年三月三十日