

中欧量化驱动混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 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	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	110
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	110
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	110
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	110
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	110
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	110

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	111
8.12 投资组合报告附注.....	111
§9 基金份额持有人信息.....	112
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	112
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	112
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	112
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	113
§10 开放式基金份额变动.....	113
§11 重大事件揭示.....	113
11.1 基金份额持有人大会决议.....	113
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.....	113
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	113
11.4 基金投资策略的改变.....	113
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	114
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	114
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	114
11.8 其他重大事件.....	118
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	120
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.....	120
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	120
§13 备查文件目录.....	121
13.1 备查文件目录.....	121
13.2 存放地点.....	121
13.3 查阅方式.....	121

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧量化驱动混合型证券投资基金
基金简称	中欧量化驱动混合
基金主代码	001980
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2018年05月16日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,344,719,022.64份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	根据本基金的投资目标、投资理念和投资范围，采用战术型资产配置策略。即不断评估各类资产的风险收益状况，以调整投资组合中的大类资产配置，从变化的市场条件中获利，并强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。
业绩比较基准	创业板指数收益率*95%+中债综合指数收益率*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和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

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		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	021-68609700、400-700-9700	95588
传真	021-33830351	(010) 66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号上海中心大厦8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	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01-12室
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号8层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021年	2020年	2019年
本期已实现收益	82,161,599.27	42,933,043.06	22,065,470.08

本期利润	74,434,909.82	58,040,312.14	26,315,282.58
加权平均基金份额本期利润	0.1045	0.3680	0.3973
本期加权平均净值利润率	5.58%	30.99%	39.00%
本期基金份额净值增长率	33.37%	28.28%	31.91%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	1,209,835,045.97	73,394,238.48	8,901,446.55
期末可供分配基金份额利润	0.8997	0.4244	0.1104
期末基金资产净值	2,554,554,068.61	246,331,523.28	89,511,677.62
期末基金份额净值	1.8997	1.4244	1.1104
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	89.97%	42.44%	11.04%

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-0.59%	0.82%	2.33%	1.05%	-2.92%	-0.23%
过去六个月	5.04%	1.02%	-4.09%	1.47%	9.13%	-0.45%
过去一年	33.37%	1.28%	11.69%	1.66%	21.68%	-0.38%
过去三年	125.67%	1.25%	140.23%	1.64%	-14.56%	-0.39%
自基金合同 生效起至今	89.97%	1.29%	96.05%	1.56%	-6.08%	-0.27%

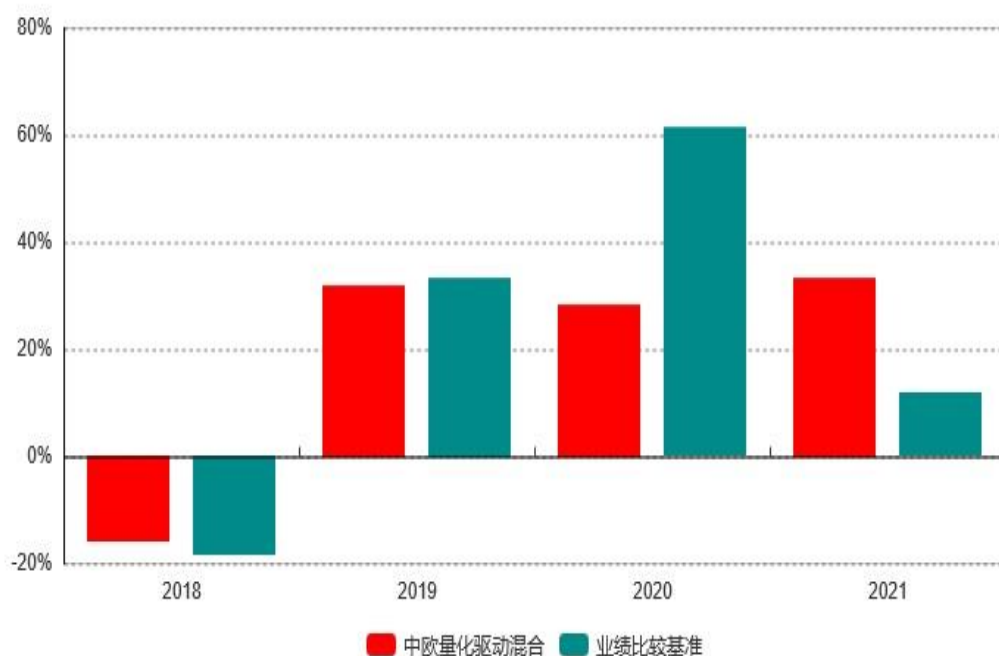
注：本基金业绩比较基准为：创业板指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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



注：2019年4月26日，业绩基准变更为创业板指数收益率*95%+中债综合指数收益率*5%。

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



注：本基金合同生效日为2018年5月16日，2018年度数据为2018年5月16日至2018年12月31日数据。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至2021年12月31日，本基金管理人共管理106只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基	证	说明
----	----	--------	---	----

		金经理（助理） 期限		券 从 业 年 限	
		任职 日期	离任 日期		
曲径	量化投资总监/基金经理/ 投资经理	2018- 05-16	-	15 年	历任千禧年基金量化基金 经理，博煊资产管理有限 公司量化投资分析师、量 化投资经理，中信证券股 份有限公司另类投资业务 线高级副总裁。2015/04/0 1加入中欧基金管理有限 公司。
钱亚 婷	基金经理助理	2019- 04-23	2021- 11-03	5 年	2016/04/05加入中欧基金 管理有限公司, 历任中欧 基金管理有限公司分析 师。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、根据本公司公告，曲径于2021年7月1日至2021年9月29日之间休假，休假期间由张跃鹏代行履职。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
曲径	公募基金	3	6,243,526,240.47	2015-05-18
	私募资产管理计划	2	485,285,959.53	2021-12-14
	其他组合	-	-	-
	合计	5	6,728,812,200.00	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，离任产品情况：

- 1) 产品类型：公募，离任数量：0只，离任时间：无；
- 2) 产品类型：私募资产管理计划，离任数量：1只；离任时间：20211208。

4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

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循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，相同投资策略同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

对于同向交易，本基金管理人采集连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）不同投资组合的同向交易计算交易价差，并结合同向交易占优比、溢价率等进行综合分析，来判断是否存在组合之间利益输送。

综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

对于涉及基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的组合，本基金管理人按照《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》及公司内部相关制度等规定，特别地增加检查程序，将反向交易和同向交易的检查时间窗延长至10个交易日，并结合成交顺序、价格偏差、产品规模、成交量等因素对是否存在不公平对待的情形进行分析。综合而言，本报告期内，公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，涉及兼任的基金经理管理的多个组合间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有32次，为量化组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控已对该交易进行事后审核。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2021年，市场风格转换很快，对基本面投资是挑战，对我们基本面与量化结合的投资，同样也是很大的考验。2017年、2018年的价值投资，2019年、2020年的成长赛道投资，如果说那几年对于基本面投资来说是河宽水静，那么2021年可以说是激流湍急。从一月的食品医药引领开门红，到二月市场震荡回调，再到后来周期板块应验全球流动性宽松带来上涨，而临近年底，PPI指数的冲高回落本应给中游制造的成本缓解压力，但数据上看居民消费继续走弱，又在需求上压制了景气。基于以上情况，本基金在过去一年能够提供超越基准的回报，很大程度得益于基本面量化这种行业覆盖较宽的投资方式。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为33.37%，同期业绩比较基准收益率为11.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以前很少在基金年报中提及我们的基本面和量化结合的方法论，总觉得提到“量化”太复杂，持有人不容易理解，因而我们选择用净值说话，以业绩证明自己。但是，最近两年关注和理解量化的投资人越来越多了，我觉得值得谈谈我们在做什么。简单来说，

“基本面量化”就是我们把自己能力范围内能够梳理的、成体系的基本面逻辑，都写进模型里，然后让模型去输出交易信号，形成基金的投资组合。

回顾我自己从业的前10年，都是在做传统多因子模型，浅显易懂的例子是PE-ROE-GROWTH三因子模型，PE是估值，ROE是好公司，GROWTH是具备成长性，简单的说就是具有成长性的又不贵的好公司，其实这也是基本面量化的雏形，是一种极大抽象的选股方式。这种在上个世纪的美国流行起来的投资框架，基于财务报表等公开的信息，以及Oracle等结构化数据库的技术支持。不能否认，这样的投资方式在当时就是“先进生产力”。而站在现在的世界，谁还能说自己有一个Oracle数据库就是先进科技了呢？我们的团队也时常论证自己投资框架的稳健性，意识到危机后摆在我们面前有两个选择，一个是选择以AI等科技应用为基础的中高频交易，另一个是选择下沉到更基础的研究层面——以逻辑驱动的基本面量化，考虑到公募基金的特点和客群，我们最终选择了基本面量化，即在美国被称为“Quantamental”的投资框架，并基于这个框架开拓了数年，最近的业绩效果就是研究结果的呈现。

所谓“Quantamental”，即基本面量化，是一种基本面逻辑驱动叠加数据赋能的投资方式。投资框架里最重要的是行业底层选股逻辑以及通过技术手段得到的细分数据。在寻找基本面逻辑上，我们下沉一步，寻找行业专家们真正看的东西，用它来建模。举个例子：汽车研究员会去看乘联会和中汽协，每个月的汽车销量批发数据，还会跟踪社会库存，并考虑到购置税减免的周期、乘用车补贴的周期，我们把这些都应用到数学建模里。数据赋能的层面，我们不仅采用传统因子的报表数据和分析师数据，更把大数据技术获得的各类另类数据作为模型输入。基于这样的建模结果，我们就可以与基本面研究在一个维度上去对话，这才是真的基本面与量化相结合。

当然，我们做量化的必须承认自己的短板，一个数学模型建得再好，也不如最优秀的基本面研究人员对行业和个股钻研那么深入，但是量化的好处大家也都知道，是以宽度对抗深度。我们希望通过多行业覆盖的“雷达扫描”般的投资方式，在更多的板块和个股上，挖掘到投资机会。当然，我们也会因为分散型的投资，业绩很少在短期内非常突出，但长期来看，希望积少成多，累积更好的长期回报。

因为带上了“基本面”三个字，对于我们的这种基本面量化，人们可能会有诸多误解。常被问到的一个问题是：基本面量化是不是量化选股票池，再通过人的主观判断筛一遍？我们在中欧的实践中，选用了另一条路，我称作“基本面逻辑前置”的方式。这种方式是尽量把能想到的各种逻辑和角度都写进模型里，在投资中不采取人工干预，而是相信模型的“理性”优于人的“贪婪和恐惧”。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

（一）落实法律法规，培养合规文化

2021年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后第一时间内通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读；同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、风险案例研讨、员工合规测试等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

（二）完善制度体系，提高运作效率

2021年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年共制订或修订制度流程55项，内容涵盖投资研究、合规管理、信息技术、反洗钱等各项内容。

（三）加强内部审计，强化风险管理

2021年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

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，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧量化驱动混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，中欧量化驱动混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧量化驱动混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧量化驱动混合型证券投资基金2021年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2022）审字第61362990_B33号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧量化驱动混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中欧量化驱动混合型证券投资基金的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中欧量化驱动混合型证券投资基金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，公允反映了中欧量化驱动混合型证券投资基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中欧量化驱动混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中欧量化驱动混合型证券投资基金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。

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，管理层负责评估中欧量化驱动混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。治理层负责监督中欧量化驱动混合型证券投资基金的财务报告过程。
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，就可能导致对中欧量化驱动混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性

	得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中欧量化驱动混合型证券投资基金不能持续经营。(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。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈露、张亚旒
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2022-03-30

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	218,771,107.34	25,176,082.72
结算备付金		22,117,252.76	3,048,322.27
存出保证金		951,665.50	73,798.40
交易性金融资产	7.4.7.2	2,206,910,201.47	218,733,783.33
其中：股票投资		2,206,910,201.47	218,733,783.33
基金投资		-	-

债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		92,343,349.56	6,426,330.94
应收利息	7.4.7.5	-15,958.00	4,271.25
应收股利		-	-
应收申购款		77,236,801.85	51,335.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,618,314,420.48	253,513,923.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020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		-	-
应付证券清算款		47,334,474.32	6,086,429.60
应付赎回款		1,502,519.25	5,862.73
应付管理人报酬		2,445,519.68	240,745.21
应付托管费		407,586.60	40,124.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	11,987,148.46	679,232.26
应交税费		-	0.04
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	83,103.56	130,006.67

负债合计		63,760,351.87	7,182,400.71
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,344,719,022.64	172,937,284.80
未分配利润	7.4.7.10	1,209,835,045.97	73,394,238.48
所有者权益合计		2,554,554,068.61	246,331,523.28
负债和所有者权益总计		2,618,314,420.48	253,513,923.99

注：报告截止日2021年12月31日，基金份额净值为人民币1.8997元，基金份额总额1,344,719,022.64份。

7.2 利润表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		134,075,812.70	63,742,715.84
1. 利息收入		949,920.21	1,079,075.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	847,641.27	120,238.04
债券利息收入		266.64	11.28
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		102,012.30	958,826.01
证券出借利息收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		133,105,642.64	47,317,301.36
其中：股票投资收益	7.4.7.12	126,289,440.52	44,741,538.26
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	73,298.66	17,923.39

资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	1,122,019.42
股利收益	7.4.7.15	6,742,903.46	1,435,820.29
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-7,726,689.45	15,107,269.08
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	7,746,939.30	239,070.07
减：二、费用		59,640,902.88	5,702,403.70
1. 管理人报酬		15,994,218.35	2,214,452.31
2. 托管费		2,665,702.99	369,075.38
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	40,780,017.91	2,984,246.71
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	4,039.30
7. 其他费用	7.4.7.19	200,963.63	130,590.00
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		74,434,909.82	58,040,312.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		74,434,909.82	58,040,312.14

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧量化驱动混合型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
-----	----

	2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	172,937,284.80	73,394,238.48	246,331,523.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	74,434,909.82	74,434,909.82
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,171,781,737.84	1,062,005,897.67	2,233,787,635.51
其中：1. 基金申购款	2,479,476,279.83	2,152,344,367.94	4,631,820,647.77
2. 基金赎回款	-1,307,694,541.99	-1,090,338,470.27	-2,398,033,012.26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,344,719,022.64	1,209,835,045.97	2,554,554,068.61
项 目	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	80,610,231.07	8,901,446.55	89,511,677.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,040,312.14	58,040,312.14

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	92,327,053.73	6,452,479.79	98,779,533.52
其中：1. 基金申购款	183,803,537.19	16,010,202.16	199,813,739.35
2. 基金赎回款	-91,476,483.46	-9,557,722.37	-101,034,205.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	172,937,284.80	73,394,238.48	246,331,523.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

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

中欧量化驱动混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2366号文《关于准予中欧中证银联智策大数据100指数型证券投资基金注册的批复》及[2017]1519号文《关于准予中欧中证银联智策大数据100指数型证券投资基金变更注册的批复》（准予中欧中证银联智策大数据100指数型证券投资基金变更注册为中欧量化驱动混合型证券投资基金）核准，由中欧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《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集244,603,768.62元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2018）验字第61336106_B08号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》于2018年5月16日正式

生效，基金合同生效日的基金份额总额为244,633,211.97份基金份额，其中包含认购利息折合29,443.35份基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、现金、权证、股指期货、股票期权、国债期货、货币市场工具以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。本基金投资组合中：股票投资占基金资产的比例为60%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%。

本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率 $\times$ 95%+中债综合指数收益率 $\times$ 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自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分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资和债券投资等；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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的股票和不作为有效套期工具的衍生工具等，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；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；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。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

（1）股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于成交日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（2）债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

（3）权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

（4）股指期货/国债期货投资

买入或卖出股指期货/国债期货投资于成交日确认为股指期货/国债期货投资。股指期货/国债期货初始合约价值按成交金额确认；

股指期货/国债期货平仓于成交日确认衍生工具投资收益，股指期货/国债期货的初始合约价值按移动加权平均法于成交日结转；

（5）分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

（6）回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

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。

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

（2）债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

（3）资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

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

（5）股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

（6）债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

（7）资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 股指/国债期货投资收益/(损失)于平仓日确认,并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账;

(9) 权证收益/(损失)于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账;

(10) 股利收益于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账;

(11) 公允价值变动收益/(损失)系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

(12) 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的时候确认。

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在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(3) 每一基金份额享有同等分配权;

(4) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.5 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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 增值税

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，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、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，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增

值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

4. 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[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
----	--------------------	---------------------

活期存款	218,771,107.34	25,176,082.72
定期存款	-	-
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	-	-
合计	218,771,107.34	25,176,082.72

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,196,672,589.00	2,206,910,201.47	10,237,612.47
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,196,672,589.00	2,206,910,201.47	10,237,612.47
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		200,769,481.41	218,733,783.33	17,964,301.92
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	200,769,481.41	218,733,783.33	17,964,301.92	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	33,831.45	2,726.96
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	10,946.87	1,507.77
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-61,207.34	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	471.02	36.52
合计	-15,958.00	4,271.25

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	11,987,148.46	679,232.26
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	11,987,148.46	679,232.26

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	2,925.08	6.67
应付证券出借违约金	—	—
预提费用-审计费	80,000.00	50,000.00
应付转出费	178.48	—
预提费用-信息披露费	—	80,000.00
合计	83,103.56	130,006.67

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	172,937,284.80	172,937,284.80
本期申购	2,479,476,279.83	2,479,476,279.83
本期赎回（以“-”号填列）	-1,307,694,541.99	-1,307,694,541.99

本期末	1,344,719,022.64	1,344,719,022.64
-----	------------------	------------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	106,280,086.26	-32,885,847.78	73,394,238.48
本期利润	82,161,599.27	-7,726,689.45	74,434,909.82
本期基金份额交易产生的变动数	1,559,769,763.28	-497,763,865.61	1,062,005,897.67
其中：基金申购款	3,178,825,804.67	-1,026,481,436.73	2,152,344,367.94
基金赎回款	-1,619,056,041.39	528,717,571.12	-1,090,338,470.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,748,211,448.81	-538,376,402.84	1,209,835,045.97

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	683,103.33	84,198.65
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	158,434.41	35,287.94
其他	6,103.53	751.45
合计	847,641.27	120,238.04

7.4.7.12 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
----	----	---------

	2021年01月01日至2021年 12月31日	2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	12,986,751,959.45	945,680,720.69
减：卖出股票成本总额	12,860,462,518.93	900,939,182.43
买卖股票差价收入	126,289,440.52	44,741,538.26

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 （、债转股及债券到期兑付） 差价收入	73,298.66	17,923.39
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	73,298.66	17,923.39

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转 股及债券到期兑 付）成交总额	484,565.30	106,034.97
减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	411,000.00	88,100.00
减：应收利息总额	266.64	11.58

买卖债券差价收入	73,298.66	17,923.39
----------	-----------	-----------

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间收益 金额 2020年01月01日至2020年12月31日
期货投资	-	1,155,680.00
减：期货投资差价收入增值税抵减	-	33,660.58
合计	-	1,122,019.42

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,742,903.46	1,435,820.29
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	6,742,903.46	1,435,820.29

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
------	-------------------------------	------------------------------------

	月31日	月31日
1. 交易性金融资产	-7,726,689.45	15,107,269.08
——股票投资	-7,726,689.45	15,107,269.08
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-7,726,689.45	15,107,269.08

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	6,496,582.45	203,873.27
转换费收入	1,250,356.85	35,196.80
合计	7,746,939.30	239,070.07

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	40,780,017.91	2,982,843.92
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	-	1,402.79

合计	40,780,017.91	2,984,246.71
----	---------------	--------------

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	80,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	—	—
汇划手续费	963.63	590.00
合计	200,963.63	130,590.00

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司（“万盛基业”）	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a（“意大利银联银行”）	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）（“上海睦亿合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司（“中欧盛世资产”）	基金管理人的全资子公司

管”)	
上海中欧财富基金销售有限公司(“中欧财富”)	基金管理人的控股子公司
中欧基金国际有限公司(“中欧国际”)	基金管理人的全资子公司

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、经中国证券监督管理委员会批准，公司原股东北京百骏投资有限公司将其持有的公司 20%股权转让给自然人股东窦玉明先生，本次股权变更的工商变更登记手续已于 2021年7月27日办理完毕。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	11,049,699,293.84	39.72%	37,539,849.79	1.92%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

无。

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年12月31日
-------	-------------------------------

	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国都证券	10,290,631.18	40.77%	3,935,098.17	32.83%
关联方名 称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国都证券	34,960.86	1.92%	34,960.86	5.15%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至202 1年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,994,218.35	2,214,452.31
其中：支付销售机构的客户维护费	1,534,521.06	71,806.76

注：1、本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺

延。

2、根据基金管理人中欧基金管理有限公司2019年9月24日《中欧基金管理有限公司关于中欧量化驱动混合型证券投资基金降低管理费、托管费并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自2019年9月24日起，本基金管理费率由1.50%/年调整为1.20%/年。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,665,702.99	369,075.38

注：1、本基金的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 2 个工作日内、按照指定的账户路径进行支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

2、根据基金管理人中欧基金管理有限公司2019年9月24日《中欧基金管理有限公司关于中欧量化驱动混合型证券投资基金降低管理费、托管费并修改基金合同的公告》的规定，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自2019年9月24日起，本基金托管费率由0.25%/年调整为0.20%/年。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	1,057.87	0.00%	0.00	0.00%

注：

- 1、本报告期及上年度可比期间，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。
- 2、截至本报告期末，自然人股东持有本基金份额的比例为0.0001%，上表展示的比例是四舍五入后的结果。

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 2021年01月01日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	218,771,107.34	683,103.33	25,176,082.72	84,198.65

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688176	亚虹医药	2021-12-29	2022-01-07	新股未上市	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	新股流通受限	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	新股流通受限	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
688255	凯尔达	2021-10-	2022-04-	新股流通	47.11	37.87	1,648	77,637.2	62,409.7	-

		14	25	受限				8	6	
3010 50	雷电 微力	2021 -08- 17	2022 -02- 24	新股 流通 受限	60.6 4	234. 74	233	14,1 29.1 2	54,6 94.4 2	-
6882 72	富吉 瑞	2021 -10- 08	2022 -04- 18	新股 流通 受限	22.5 6	39.0 9	1,263	28,4 93.2 8	49,3 70.6 7	-
3010 35	润丰 股份	2021 -07- 21	2022 -01- 28	新股 流通 受限	22.0 4	56.2 8	644	14,1 93.7 6	36,2 44.3 2	-
3012 11	亨迪 药业	2021 -12- 14	2022 -06- 22	新股 流通 受限	25.8 0	33.6 5	967	24,9 48.6 0	32,5 39.5 5	-
3010 39	中集 车辆	2021 -07- 01	2022 -01- 10	新股 流通 受限	6.96	12.5 1	2,064	14,3 65.4 4	25,8 20.6 4	-
3010 96	百诚 医药	2021 -12- 13	2022 -06- 20	新股 流通 受限	79.6 0	78.5 3	272	21,6 51.2 0	21,3 60.1 6	-
3010 93	华兰 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	新股 流通 受限	58.0 8	49.8 5	409	23,7 54.7 2	20,3 88.6 5	-
3010 18	申菱 环境	2021 -06- 28	2022 -01- 07	新股 流通 受限	8.29	26.0 6	782	6,48 2.78	20,3 78.9 2	-
3011 49	隆华 新材	2021 -11- 03	2022 -05- 10	新股 流通 受限	10.0 7	16.7 6	1,214	12,2 24.9 8	20,3 46.6 4	-
3010 82	久盛 电气	2021 -10- 14	2022 -04- 27	新股 流通 受限	15.4 8	21.5 3	915	14,1 64.2 0	19,6 99.9 5	-
3009 94	久祺 股份	2021 -08- -	2022 -02- -	新股 流通	11.9 0	45.4 5	420	4,99 8.00	19,0 89.0	-

		02	14	受限					0	
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	新股流通受限	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	新股流通受限	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301190	善水科技	2021-12-17	2022-06-24	新股流通受限	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	新股流通受限	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021-11-25	2022-06-06	新股流通受限	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021-12-01	2022-06-08	新股流通受限	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	新股流通受限	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	新股流通受限	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021-11-04	2022-05-11	新股流通受限	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	新股流通受限	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021-11-	2022-06-	新股流通	29.28	32.00	402	11,770.5	12,864.0	-

		30	07	受限				6	0	
3011 38	华研 精机	2021 -12- 08	2022 -06- 15	新股 流通 受限	26.1 7	44.8 6	285	7,45 8.45	12,7 85.1 0	-
3011 26	达嘉 维康	2021 -11- 30	2022 -06- 07	新股 流通 受限	12.3 7	19.2 3	662	8,18 8.94	12,7 30.2 6	-
3011 85	鸥玛 软件	2021 -11- 11	2022 -05- 19	新股 流通 受限	11.8 8	21.1 6	578	6,86 6.64	12,2 30.4 8	-
3010 21	英诺 激光	2021 -06- 28	2022 -01- 06	新股 流通 受限	9.46	41.4 3	290	2,74 3.40	12,0 14.7 0	-
3010 92	争光 股份	2021 -10- 21	2022 -05- 05	新股 流通 受限	36.3 1	35.5 2	323	11,7 28.1 3	11,4 72.9 6	-
3010 28	东亚 机械	2021 -07- 12	2022 -01- 20	新股 流通 受限	5.31	13.5 0	733	3,89 2.23	9,89 5.50	-
3010 45	天禄 科技	2021 -08- 06	2022 -02- 17	新股 流通 受限	15.8 1	28.3 7	335	5,29 6.35	9,50 3.95	-
3007 74	倍杰 特	2021 -07- 26	2022 -02- 16	新股 流通 受限	4.57	21.0 8	444	2,02 9.08	9,35 9.52	-
3010 40	中环 海陆	2021 -07- 26	2022 -02- 07	新股 流通 受限	13.5 7	38.5 1	241	3,27 0.37	9,28 0.91	-
3010 25	读客 文化	2021 -07- 06	2022 -01- 24	新股 流通 受限	1.55	20.8 8	403	624. 65	8,41 4.64	-
3010 66	万事 利	2021 -09- 03	2022 -03-	新股 流通	5.24	22.8 4	344	1,80 2.56	7,85 6.96	-

		13	22	受限						
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	新股流通受限	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301133	金钟股份	2021-11-19	2022-05-26	新股流通受限	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-
301198	喜悦智行	2021-11-25	2022-06-02	新股流通受限	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	新股流通受限	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	新股流通受限	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	新股流通受限	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	新股流通受限	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	新股流通受限	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	新股流通受限	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-	2022-03-	新股流通	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

		22	29	受限						
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	新股流通受限	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	新股流通受限	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	新股流通受限	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	新股流通受限	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	新股流通受限	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	新股流通受限	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	新股流通受限	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	新股流通受限	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

注：上述流通受限证券所披露可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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。本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2021年12月31日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的银行存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注7.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

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。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	218,771,107.34	-	-	-	218,771,107.34
结算备付金	22,114,974.55	-	-	2,278.21	22,117,252.76
存出保证金	951,665.50	-	-	-	951,665.50
交易性金融资产	-	-	-	2,206,910,201.47	2,206,910,201.47
应收证券清算款	-	-	-	92,343,349.56	92,343,349.56
应收利息	-	-	-	-15,958.00	-15,958.00
应收申购款	-	-	-	77,236,801.85	77,236,801.85
资产总计	241,837,747.39	-	-	2,376,476,673.09	2,618,314,420.48
负债					
应付证券清算款	-	-	-	47,334,474.32	47,334,474.32
应付赎回款	-	-	-	1,502,519.25	1,502,519.25

应付管理人报酬	-	-	-	2,445,519.68	2,445,519.68
应付托管费	-	-	-	407,586.60	407,586.60
应付交易费用	-	-	-	11,987,148.46	11,987,148.46
其他负债	-	-	-	83,103.56	83,103.56
负债总计	-	-	-	63,760,351.87	63,760,351.87
利率敏感度缺口	241,837,747.39	-	-	2,312,716,321.22	2,554,554,068.61
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,176,082.72	-	-	-	25,176,082.72
结算备付金	3,046,044.06	-	-	2,278.21	3,048,322.27
存出保证金	73,798.40	-	-	-	73,798.40
交易性金融资产	-	-	-	218,733,783.33	218,733,783.33
应收证券清算款	-	-	-	6,426,330.94	6,426,330.94
应收利息	-	-	-	4,271.25	4,271.25
应收申购款	-	-	-	51,335.08	51,335.08
资产总计	28,295,925.18	-	-	225,217,998.81	253,513,923.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	6,086,429.60	6,086,429.60
应付赎回款	-	-	-	5,862.73	5,862.73
应付管理人报	-	-	-	240,745.21	240,745.21

酬					
应付托 管费	-	-	-	40,124.20	40,124.20
应付交 易费用	-	-	-	679,232.26	679,232.26
应交税 费	-	-	-	0.04	0.04
其他负 债	-	-	-	130,006.67	130,006.67
负债总 计	-	-	-	7,182,400.71	7,182,400.71
利率敏 感度缺 口	28,295,925.18	-	-	218,035,598.10	246,331,523.28

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为0.00% (2020年12月31日:0.00%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2020年12月31日: 同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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 2021年12月31日		上年度末 2020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	2,206,910,201.47	86.39	218,733,783.33	88.80
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,206,910,201.47	86.39	218,733,783.33	88.80

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	67,264,763.38	6,615,457.10
	2. 业绩比较基准下降5%	-67,264,763.38	-6,615,457.10

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款、应收款项以及其他金融负债，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

1.2 以公允价值计量的金融工具

1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，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中属于第一层次的余额为人民币2,204,688,420.66元，属于第二层次的余额为人民币1,253,239.55元，属于第三层次的余额为人民币968,541.26元(2020年12月31日：属于第一层次的余额为人民币216,701,695.36元，属于第二层次的余额为人民币2,032,087.97元，属于第三层次的余额为人民币0.00元)。

1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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工具第三层次公允价值期末余额为人民币968,541.26元，期初余额为人民币0.00元，本期增加人民币968,541.26元。

2. 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。

3. 其他事项

根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。

除上述事项外，截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

4. 财务报表的批准

本财务报表已于2022年3月30日经本基金的基金管理人批准。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,206,910,201.47	84.29

	其中：股票	2,206,910,201.47	84.29
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	240,888,360.10	9.20
8	其他各项资产	170,515,858.91	6.51
9	合计	2,618,314,420.48	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,096,788.00	0.20
B	采矿业	30,473,956.00	1.19
C	制造业	1,748,150,543.60	68.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,204,254.00	1.06
E	建筑业	26,091,449.35	1.02
F	批发和零售业	19,065,909.30	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	19,080,747.20	0.75
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,206,442.23	5.61
J	金融业	102,881,119.51	4.03
K	房地产业	40,846,784.00	1.60
L	租赁和商务服务业	2,350,629.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	21,932,108.80	0.86

N	水利、环境和公共设施管理业	20,516,447.84	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	8,414.64	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,206,910,201.47	86.39

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	002756	永兴材料	162,800	24,097,656.00	0.94
2	601677	明泰铝业	538,100	23,724,829.00	0.93
3	300073	当升科技	272,076	23,635,242.12	0.93
4	688019	安集科技	80,200	21,910,640.00	0.86
5	300408	三环集团	482,300	21,510,580.00	0.84
6	603568	伟明环保	561,200	20,500,636.00	0.80
7	002815	崇达技术	1,196,542	20,161,732.70	0.79
8	603737	三棵树	144,553	20,114,549.95	0.79
9	600745	闻泰科技	153,300	19,821,690.00	0.78
10	300751	迈为股份	30,700	19,718,610.00	0.77
11	000733	振华科技	158,100	19,648,668.00	0.77
12	002929	润建股份	535,542	19,354,487.88	0.76
13	688608	恒玄科技	59,998	18,299,390.00	0.72
14	603916	苏博特	698,240	17,986,662.40	0.70
15	300327	中颖电子	257,200	17,463,880.00	0.68
16	002643	万润股份	733,800	17,347,032.00	0.68

17	000568	泸州老窖	67,008	17,011,320.96	0.67
18	002386	天原股份	1,314,600	16,734,858.00	0.66
19	002371	北方华创	48,000	16,656,960.00	0.65
20	000858	五 粮 液	73,700	16,410,042.00	0.64
21	600522	中天科技	950,700	16,123,872.00	0.63
22	002241	歌尔股份	293,600	15,883,760.00	0.62
23	600809	山西汾酒	49,100	15,504,798.00	0.61
24	600702	舍得酒业	68,000	15,456,400.00	0.61
25	002129	中环股份	369,900	15,443,325.00	0.60
26	000661	长春高新	56,900	15,442,660.00	0.60
27	600487	亨通光电	1,011,300	15,290,856.00	0.60
28	600519	贵州茅台	7,400	15,170,000.00	0.59
29	002881	美格智能	351,900	15,089,472.00	0.59
30	300450	先导智能	202,100	15,030,177.00	0.59
31	601012	隆基股份	172,200	14,843,640.00	0.58
32	600116	三峡水利	1,271,400	14,824,524.00	0.58
33	002139	拓邦股份	791,300	14,789,397.00	0.58
34	300088	长信科技	1,108,700	14,723,536.00	0.58
35	003022	联泓新科	396,149	14,435,669.56	0.57
36	300059	东方财富	388,120	14,403,133.20	0.56
37	300776	帝尔激光	55,900	14,304,810.00	0.56
38	300769	德方纳米	29,100	14,292,756.00	0.56
39	600873	梅花生物	1,802,000	13,821,340.00	0.54
40	300294	博雅生物	348,800	13,376,480.00	0.52
41	000860	顺鑫农业	345,600	13,195,008.00	0.52
42	000768	中航西飞	357,900	13,063,350.00	0.51
43	002043	兔 宝 宝	1,032,600	12,473,808.00	0.49
44	688596	正帆科技	481,095	12,436,305.75	0.49
45	688233	神工股份	136,901	12,074,668.20	0.47
46	000977	浪潮信息	336,300	12,049,629.00	0.47
47	688561	奇安信	137,000	12,045,040.00	0.47

48	688518	联赢激光	241,794	11,913,190.38	0.47
49	300198	纳川股份	2,957,600	11,889,552.00	0.47
50	300037	新宙邦	105,200	11,887,600.00	0.47
51	002142	宁波银行	307,660	11,777,224.80	0.46
52	603260	合盛硅业	86,800	11,454,996.00	0.45
53	603995	甬金股份	183,800	10,634,668.00	0.42
54	600900	长江电力	462,700	10,503,290.00	0.41
55	688360	德马科技	321,400	10,477,640.00	0.41
56	002271	东方雨虹	195,000	10,272,600.00	0.40
57	603707	健友股份	241,931	10,161,102.00	0.40
58	605166	聚合顺	637,400	10,147,408.00	0.40
59	600030	中信证券	382,607	10,104,650.87	0.40
60	002372	伟星新材	413,800	10,063,616.00	0.39
61	300035	中科电气	326,300	9,870,575.00	0.39
62	600875	东方电气	455,900	9,765,378.00	0.38
63	300782	卓胜微	29,700	9,705,960.00	0.38
64	603517	绝味食品	138,100	9,436,373.00	0.37
65	300274	阳光电源	64,000	9,331,200.00	0.37
66	300750	宁德时代	15,600	9,172,800.00	0.36
67	603659	璞泰来	56,794	9,121,684.34	0.36
68	601166	兴业银行	477,491	9,091,428.64	0.36
69	600690	海尔智家	303,500	9,071,615.00	0.36
70	002832	比音勒芬	352,400	8,968,580.00	0.35
71	688169	石头科技	11,000	8,943,000.00	0.35
72	600383	金地集团	685,100	8,885,747.00	0.35
73	601699	潞安环能	779,100	8,811,621.00	0.34
74	603986	兆易创新	50,091	8,808,502.35	0.34
75	002706	良信股份	491,890	8,765,479.80	0.34
76	300772	运达股份	197,900	8,703,642.00	0.34
77	300260	新莱应材	184,300	8,693,431.00	0.34
78	600765	中航重机	171,500	8,659,035.00	0.34

79	688017	绿的谐波	49,000	8,553,440.00	0.33
80	688559	海目星	142,800	8,526,588.00	0.33
81	688668	鼎通科技	120,471	8,490,796.08	0.33
82	600036	招商银行	173,500	8,451,185.00	0.33
83	688568	中科星图	105,900	8,363,982.00	0.33
84	688066	航天宏图	113,700	8,265,990.00	0.32
85	688188	柏楚电子	20,700	7,979,022.00	0.31
86	002025	航天电器	94,500	7,933,275.00	0.31
87	002410	广联达	123,757	7,917,972.86	0.31
88	002850	科达利	49,200	7,888,728.00	0.31
89	300014	亿纬锂能	66,400	7,847,152.00	0.31
90	300531	优博讯	382,700	7,818,561.00	0.31
91	002979	雷赛智能	302,000	7,812,740.00	0.31
92	000537	广宇发展	322,700	7,777,070.00	0.30
93	300390	天华超净	95,900	7,767,900.00	0.30
94	688670	金迪克	102,100	7,726,928.00	0.30
95	002153	石基信息	268,500	7,716,690.00	0.30
96	002009	天奇股份	319,300	7,714,288.00	0.30
97	688598	金博股份	21,700	7,704,368.00	0.30
98	300124	汇川技术	111,880	7,674,968.00	0.30
99	688257	新锐股份	115,900	7,672,580.00	0.30
100	002918	蒙娜丽莎	267,000	7,644,210.00	0.30
101	600110	诺德股份	479,000	7,640,050.00	0.30
102	600584	长电科技	246,000	7,630,920.00	0.30
103	603610	麒盛科技	294,900	7,626,114.00	0.30
104	300833	浩洋股份	94,100	7,624,923.00	0.30
105	002430	杭氧股份	253,400	7,604,534.00	0.30
106	600460	士兰微	140,200	7,598,840.00	0.30
107	601388	怡球资源	1,707,300	7,597,485.00	0.30
108	002013	中航机电	417,200	7,584,696.00	0.30
109	300451	创业慧康	677,300	7,572,214.00	0.30

110	002128	电投能源	509,300	7,563,105.00	0.30
111	300487	蓝晓科技	76,100	7,484,435.00	0.29
112	300982	苏文电能	101,545	7,472,696.55	0.29
113	601101	昊华能源	1,002,900	7,421,460.00	0.29
114	300659	中孚信息	163,000	7,392,050.00	0.29
115	002258	利尔化学	218,600	7,373,378.00	0.29
116	688388	嘉元科技	58,500	7,344,675.00	0.29
117	300604	长川科技	126,900	7,296,750.00	0.29
118	600039	四川路桥	599,700	7,220,388.00	0.28
119	000786	北新建材	199,200	7,137,336.00	0.28
120	002648	卫星化学	177,900	7,121,337.00	0.28
121	002465	海格通信	651,200	7,111,104.00	0.28
122	300682	朗新科技	192,000	7,109,760.00	0.28
123	603885	吉祥航空	399,380	7,088,995.00	0.28
124	603516	淳中科技	343,400	6,964,152.00	0.27
125	002791	坚朗五金	38,300	6,954,897.00	0.27
126	300725	药石科技	48,900	6,952,113.00	0.27
127	600703	三安光电	184,600	6,933,576.00	0.27
128	002352	顺丰控股	100,600	6,933,352.00	0.27
129	300496	中科创达	49,744	6,885,564.48	0.27
130	600570	恒生电子	110,760	6,883,734.00	0.27
131	300054	鼎龙股份	282,400	6,873,616.00	0.27
132	002216	三全食品	338,870	6,848,562.70	0.27
133	300799	左江科技	72,700	6,833,800.00	0.27
134	688023	安恒信息	26,904	6,745,908.96	0.26
135	300033	同花顺	46,600	6,737,428.00	0.26
136	600141	兴发集团	177,400	6,719,912.00	0.26
137	000968	蓝焰控股	714,200	6,677,770.00	0.26
138	300737	科顺股份	405,400	6,587,750.00	0.26
139	002745	木林森	430,300	6,510,439.00	0.25
140	601865	福莱特	111,100	6,437,134.00	0.25

141	002841	视源股份	78,800	6,414,320.00	0.25
142	603558	健盛集团	543,100	6,397,718.00	0.25
143	600919	江苏银行	1,090,700	6,358,781.00	0.25
144	300009	安科生物	481,656	6,304,877.04	0.25
145	601155	新城控股	214,300	6,242,559.00	0.24
146	688356	键凯科技	18,470	6,226,791.10	0.24
147	688016	心脉医疗	24,900	6,193,626.00	0.24
148	300896	爱美客	11,500	6,165,265.00	0.24
149	300832	新产业	138,600	6,105,330.00	0.24
150	300763	锦浪科技	26,200	6,066,610.00	0.24
151	600779	水井坊	49,900	5,987,501.00	0.23
152	600801	华新水泥	309,300	5,969,490.00	0.23
153	600048	保利发展	381,600	5,964,408.00	0.23
154	600176	中国巨石	324,900	5,913,180.00	0.23
155	688516	奥特维	23,500	5,774,420.00	0.23
156	000002	万 科 A	289,500	5,720,520.00	0.22
157	603816	顾家家居	74,000	5,709,840.00	0.22
158	300911	亿田智能	69,200	5,668,864.00	0.22
159	002304	洋河股份	34,300	5,650,239.00	0.22
160	603906	龙蟠科技	152,500	5,648,600.00	0.22
161	300601	康泰生物	57,300	5,646,342.00	0.22
162	600114	东睦股份	479,300	5,631,775.00	0.22
163	600276	恒瑞医药	110,300	5,593,313.00	0.22
164	300648	星云股份	92,800	5,585,632.00	0.22
165	002821	凯莱英	12,700	5,524,500.00	0.22
166	002459	晶澳科技	58,800	5,450,760.00	0.21
167	603939	益丰药房	96,600	5,323,626.00	0.21
168	300709	精研科技	88,400	5,299,580.00	0.21
169	002939	长城证券	409,000	5,296,550.00	0.21
170	601658	邮储银行	1,037,200	5,289,720.00	0.21
171	600438	通威股份	117,500	5,282,800.00	0.21

172	603259	药明康德	43,900	5,205,662.00	0.20
173	002212	天融信	268,100	5,139,477.00	0.20
174	000776	广发证券	208,100	5,117,179.00	0.20
175	002541	鸿路钢构	95,334	5,104,182.36	0.20
176	605080	浙江自然	68,200	5,101,360.00	0.20
177	300761	立华股份	134,800	5,096,788.00	0.20
178	300748	金力永磁	112,800	5,063,592.00	0.20
179	603129	春风动力	29,200	5,051,600.00	0.20
180	300790	宇瞳光学	111,400	5,033,052.00	0.20
181	605186	健麾信息	138,500	5,022,010.00	0.20
182	688006	杭可科技	46,500	5,002,470.00	0.20
183	002311	海大集团	67,600	4,955,080.00	0.19
184	002081	金螳螂	804,800	4,893,184.00	0.19
185	600516	方大炭素	451,500	4,885,230.00	0.19
186	301061	匠心家居	61,600	4,854,080.00	0.19
187	002597	金禾实业	94,500	4,852,575.00	0.19
188	002920	德赛西威	34,200	4,839,642.00	0.19
189	002687	乔治白	674,700	4,770,129.00	0.19
190	000510	新金路	807,100	4,769,961.00	0.19
191	603444	吉比特	11,300	4,766,905.00	0.19
192	002837	英维克	115,300	4,714,617.00	0.18
193	600309	万华化学	46,550	4,701,550.00	0.18
194	300575	中旗股份	209,100	4,694,295.00	0.18
195	600486	扬农化工	35,600	4,670,720.00	0.18
196	601208	东材科技	267,800	4,646,330.00	0.18
197	002080	中材科技	135,900	4,623,318.00	0.18
198	300829	金丹科技	100,600	4,597,420.00	0.18
199	603681	永冠新材	116,600	4,582,380.00	0.18
200	002158	汉钟精机	170,300	4,535,089.00	0.18
201	688308	欧科亿	63,400	4,481,112.00	0.18
202	688005	容百科技	38,600	4,461,388.00	0.17

203	300347	泰格医药	34,900	4,460,220.00	0.17
204	300887	谱尼测试	65,800	4,454,660.00	0.17
205	600456	宝钛股份	61,682	4,427,533.96	0.17
206	002886	沃特股份	143,000	4,410,120.00	0.17
207	600426	华鲁恒升	139,500	4,366,350.00	0.17
208	688059	华锐精密	27,300	4,332,510.00	0.17
209	002135	东南网架	369,200	4,267,952.00	0.17
210	002961	瑞达期货	173,000	4,262,720.00	0.17
211	002126	银轮股份	338,402	4,250,329.12	0.17
212	601882	海天精工	170,600	4,225,762.00	0.17
213	688499	利元亨	14,400	4,219,200.00	0.17
214	300951	博硕科技	46,800	4,209,660.00	0.16
215	601838	成都银行	349,200	4,190,400.00	0.16
216	002870	香山股份	109,400	4,152,824.00	0.16
217	000683	远兴能源	567,800	4,144,940.00	0.16
218	601126	四方股份	197,400	4,125,660.00	0.16
219	603822	嘉澳环保	98,900	4,113,251.00	0.16
220	603055	台华新材	255,300	4,102,671.00	0.16
221	688092	爱科科技	108,199	4,094,250.16	0.16
222	000567	海德股份	229,300	4,093,005.00	0.16
223	002988	豪美新材	197,100	4,062,231.00	0.16
224	688186	广大特材	89,601	3,997,100.61	0.16
225	600491	龙元建设	579,300	3,991,377.00	0.16
226	002765	蓝黛科技	473,400	3,976,560.00	0.16
227	603938	三孚股份	108,000	3,973,320.00	0.16
228	003026	中晶科技	53,300	3,946,865.00	0.15
229	300596	利安隆	88,000	3,938,880.00	0.15
230	600529	山东药玻	89,600	3,933,440.00	0.15
231	603386	广东骏亚	187,100	3,921,616.00	0.15
232	002167	东方锆业	489,600	3,867,840.00	0.15
233	601128	常熟银行	583,800	3,858,918.00	0.15

234	600908	无锡银行	678,800	3,848,796.00	0.15
235	003043	华亚智能	47,600	3,818,472.00	0.15
236	002555	三七互娱	140,500	3,796,310.00	0.15
237	603486	科沃斯	24,900	3,758,655.00	0.15
238	300582	英飞特	173,500	3,752,805.00	0.15
239	601966	玲珑轮胎	102,200	3,735,410.00	0.15
240	002149	西部材料	199,400	3,692,888.00	0.14
241	002968	新大正	104,000	3,684,720.00	0.14
242	002466	天齐锂业	34,300	3,670,100.00	0.14
243	002318	久立特材	205,100	3,667,188.00	0.14
244	603507	振江股份	88,700	3,627,830.00	0.14
245	601636	旗滨集团	209,800	3,587,580.00	0.14
246	603028	赛福天	267,600	3,580,488.00	0.14
247	002876	三利谱	55,100	3,442,648.00	0.13
248	000902	新洋丰	203,400	3,435,426.00	0.13
249	601872	招商轮船	829,362	3,400,384.20	0.13
250	601689	拓普集团	63,600	3,370,800.00	0.13
251	688558	国盛智科	74,099	3,349,274.80	0.13
252	688030	山石网科	108,100	3,206,246.00	0.13
253	002286	保龄宝	228,200	3,085,264.00	0.12
254	300384	三联虹普	126,000	3,030,300.00	0.12
255	688080	映翰通	34,422	3,018,809.40	0.12
256	600180	瑞茂通	420,300	3,000,942.00	0.12
257	605399	晨光新材	74,300	2,950,453.00	0.12
258	600268	国电南自	277,100	2,779,313.00	0.11
259	300416	苏试试验	81,400	2,763,530.00	0.11
260	603739	蔚蓝生物	143,800	2,674,680.00	0.10
261	000818	航锦科技	71,400	2,649,654.00	0.10
262	000906	浙商中拓	232,300	2,580,853.00	0.10
263	000897	津滨发展	945,500	2,571,760.00	0.10
264	002154	报喜鸟	508,500	2,557,755.00	0.10

265	002932	明德生物	34,500	2,553,000.00	0.10
266	000026	飞亚达	213,400	2,528,790.00	0.10
267	605338	巴比食品	72,200	2,515,448.00	0.10
268	600502	安徽建工	604,600	2,509,090.00	0.10
269	600710	苏美达	383,600	2,508,744.00	0.10
270	603326	我乐家居	258,800	2,502,596.00	0.10
271	603612	索通发展	121,000	2,482,920.00	0.10
272	003016	欣贺股份	237,800	2,477,876.00	0.10
273	300441	鲍斯股份	219,200	2,474,768.00	0.10
274	603613	国联股份	22,800	2,451,000.00	0.10
275	603901	永创智能	152,200	2,450,420.00	0.10
276	600493	凤竹纺织	401,100	2,446,710.00	0.10
277	300702	天宇股份	50,225	2,428,378.75	0.10
278	603002	宏昌电子	326,400	2,412,096.00	0.09
279	002722	金轮股份	148,800	2,409,072.00	0.09
280	002818	富森美	187,900	2,350,629.00	0.09
281	300512	中亚股份	147,200	2,349,312.00	0.09
282	600732	爱旭股份	98,200	2,293,952.00	0.09
283	300652	雷迪克	98,300	2,160,634.00	0.08
284	600829	人民同泰	319,400	2,146,368.00	0.08
285	603217	元利科技	40,600	2,057,608.00	0.08
286	000731	四川美丰	183,700	1,906,806.00	0.07
287	002015	协鑫能科	114,000	1,876,440.00	0.07
288	603527	众源新材	145,100	1,748,455.00	0.07
289	600965	福成股份	269,400	1,748,406.00	0.07
290	300305	裕兴股份	92,500	1,735,300.00	0.07
291	603198	迎驾贡酒	24,900	1,729,305.00	0.07
292	002645	华宏科技	69,800	1,703,120.00	0.07
293	603095	越剑智能	67,600	1,699,464.00	0.07
294	603128	华贸物流	121,200	1,658,016.00	0.06
295	688135	利扬芯片	39,400	1,646,526.00	0.06

296	688200	华峰测控	3,195	1,635,520.50	0.06
297	688301	奕瑞科技	3,100	1,540,390.00	0.06
298	002472	双环传动	55,000	1,516,900.00	0.06
299	688536	思瑞浦	1,900	1,459,200.00	0.06
300	603897	长城科技	28,200	1,405,488.00	0.06
301	000423	东阿阿胶	25,600	1,248,000.00	0.05
302	601058	赛轮轮胎	81,900	1,211,301.00	0.05
303	300573	兴齐眼药	8,600	1,176,480.00	0.05
304	600380	健康元	87,500	1,123,500.00	0.04
305	603589	口子窖	15,800	1,119,746.00	0.04
306	600132	重庆啤酒	7,200	1,089,504.00	0.04
307	300672	国科微	5,800	1,075,900.00	0.04
308	002402	和而泰	38,900	1,067,027.00	0.04
309	002709	天赐材料	9,200	1,054,780.00	0.04
310	688621	阳光诺和	8,558	1,040,652.80	0.04
311	300296	利亚德	101,500	1,040,375.00	0.04
312	300122	智飞生物	8,100	1,009,260.00	0.04
313	603599	广信股份	25,800	1,006,200.00	0.04
314	300613	富瀚微	6,100	994,605.00	0.04
315	688385	复旦微电	19,201	966,578.34	0.04
316	605180	华生科技	26,900	949,570.00	0.04
317	688050	爱博医疗	4,499	945,824.77	0.04
318	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.03
319	688131	皓元医药	3,499	870,131.32	0.03
320	600366	宁波韵升	64,600	853,366.00	0.03
321	002274	华昌化工	67,000	848,890.00	0.03
322	300755	华致酒行	16,800	841,344.00	0.03
323	600183	生益科技	35,030	824,956.50	0.03
324	000657	中钨高新	49,860	801,748.80	0.03
325	688357	建龙微纳	3,900	748,566.00	0.03
326	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01

327	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
328	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
329	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
330	688255	凯尔达	1,648	62,409.76	0.00
331	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
332	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.00
333	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
334	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
335	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
336	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
337	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
338	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
339	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
340	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
341	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
342	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
343	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
344	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
345	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
346	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
347	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
348	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
349	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
350	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
351	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
352	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
353	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
354	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
355	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
356	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
357	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00

358	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
359	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
360	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
361	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
362	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
363	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
364	301066	万事利	344	7,856.96	0.00
365	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
366	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
367	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
368	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
369	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
370	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
371	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
372	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
373	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
374	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
375	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
376	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
377	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
378	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
379	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
380	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
381	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
382	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
383	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
384	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
385	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603737	三棵树	144,994,760.40	58.86
2	000683	远兴能源	141,370,356.19	57.39
3	600522	中天科技	129,814,048.73	52.70
4	603659	璞泰来	114,638,068.83	46.54
5	600309	万华化学	106,950,860.98	43.42
6	603259	药明康德	99,177,619.54	40.26
7	300196	长海股份	94,447,806.50	38.34
8	002371	北方华创	89,338,806.30	36.27
9	003022	联泓新科	88,678,389.76	36.00
10	600900	长江电力	88,327,166.17	35.86
11	002241	歌尔股份	85,470,907.89	34.70
12	000831	五矿稀土	84,084,875.10	34.13
13	002929	润建股份	79,805,320.48	32.40
14	000063	中兴通讯	79,342,180.03	32.21
15	002812	恩捷股份	78,818,558.97	32.00
16	300725	药石科技	77,408,766.24	31.42
17	300073	当升科技	75,351,354.10	30.59
18	600801	华新水泥	74,563,268.04	30.27
19	601636	旗滨集团	71,169,950.89	28.89
20	002709	天赐材料	68,771,774.92	27.92
21	600875	东方电气	68,298,524.90	27.73
22	300124	汇川技术	67,258,701.40	27.30
23	688019	安集科技	66,590,409.30	27.03
24	603260	合盛硅业	65,385,896.20	26.54
25	300750	宁德时代	65,035,938.97	26.40
26	300274	阳光电源	64,560,495.96	26.21
27	002436	兴森科技	64,157,390.56	26.05
28	600036	招商银行	64,054,122.34	26.00

29	600188	兖矿能源	64,015,735.73	25.99
30	600438	通威股份	63,502,377.21	25.78
31	000568	泸州老窖	62,331,672.35	25.30
32	000661	长春高新	62,313,364.03	25.30
33	300363	博腾股份	62,200,362.01	25.25
34	601166	兴业银行	61,781,038.16	25.08
35	688516	奥特维	61,632,588.15	25.02
36	300769	德方纳米	60,908,185.56	24.73
37	002013	中航机电	60,450,751.57	24.54
38	601012	隆基股份	60,398,237.47	24.52
39	600570	恒生电子	59,041,778.83	23.97
40	000001	平安银行	58,748,239.40	23.85
41	603396	金辰股份	58,588,572.60	23.78
42	002850	科达利	58,029,890.92	23.56
43	300347	泰格医药	58,021,107.46	23.55
44	603657	春光科技	57,520,467.99	23.35
45	603897	长城科技	57,161,305.22	23.21
46	300014	亿纬锂能	56,525,847.95	22.95
47	600690	海尔智家	56,390,130.57	22.89
48	688596	正帆科技	56,349,296.30	22.88
49	600011	华能国际	56,224,123.10	22.82
50	300122	智飞生物	55,792,795.28	22.65
51	000002	万科A	55,643,105.88	22.59
52	600546	山煤国际	54,820,049.70	22.25
53	603392	万泰生物	54,260,368.05	22.03
54	600519	贵州茅台	54,150,087.00	21.98
55	002335	科华数据	53,784,268.13	21.83
56	600276	恒瑞医药	53,662,680.24	21.78
57	600763	通策医疗	53,188,545.10	21.59
58	600863	内蒙华电	52,735,891.54	21.41
59	000672	上峰水泥	52,338,234.52	21.25

60	600048	保利发展	52,193,475.00	21.19
61	300702	天宇股份	52,168,008.62	21.18
62	300568	星源材质	51,934,930.64	21.08
63	300896	爱美客	51,887,616.80	21.06
64	600745	闻泰科技	50,412,020.00	20.47
65	603799	华友钴业	50,259,617.08	20.40
66	000498	山东路桥	49,513,582.90	20.10
67	600596	新安股份	48,734,397.92	19.78
68	601966	玲珑轮胎	48,692,836.55	19.77
69	300450	先导智能	48,653,926.58	19.75
70	000977	浪潮信息	48,405,644.96	19.65
71	600702	舍得酒业	48,137,836.00	19.54
72	688186	广大特材	48,081,539.46	19.52
73	688536	思瑞浦	47,725,435.68	19.37
74	002304	洋河股份	46,522,888.66	18.89
75	603707	健友股份	46,464,025.59	18.86
76	300037	新宙邦	46,287,345.85	18.79
77	300696	爱乐达	46,144,277.60	18.73
78	002706	良信股份	45,734,182.42	18.57
79	300454	深信服	45,308,848.03	18.39
80	600588	用友网络	45,152,528.90	18.33
81	300751	迈为股份	44,724,122.50	18.16
82	002318	久立特材	44,388,449.93	18.02
83	600529	山东药玻	44,160,067.35	17.93
84	002142	宁波银行	43,857,963.74	17.80
85	300207	欣旺达	43,730,165.82	17.75
86	603055	台华新材	43,643,257.05	17.72
87	000902	新洋丰	43,595,142.33	17.70
88	300015	爱尔眼科	43,105,848.86	17.50
89	000818	航锦科技	43,085,682.68	17.49
90	002555	三七互娱	43,012,690.43	17.46

91	300496	中科创达	42,859,331.28	17.40
92	002025	航天电器	42,461,918.85	17.24
93	002312	川发龙蟒	42,326,047.94	17.18
94	600926	杭州银行	42,268,458.28	17.16
95	600110	诺德股份	42,193,739.00	17.13
96	002311	海大集团	42,158,191.66	17.11
97	600383	金地集团	41,872,114.60	17.00
98	002326	永太科技	41,869,421.08	17.00
99	600919	江苏银行	41,235,991.00	16.74
100	002979	雷赛智能	40,977,683.49	16.64
101	000963	华东医药	40,669,883.04	16.51
102	603501	韦尔股份	40,276,872.41	16.35
103	600060	海信视像	40,203,681.82	16.32
104	000786	北新建材	39,786,786.40	16.15
105	601658	邮储银行	39,577,935.00	16.07
106	300502	新易盛	39,161,852.74	15.90
107	688518	联赢激光	39,011,379.98	15.84
108	002881	美格智能	39,009,250.30	15.84
109	002271	东方雨虹	38,841,449.68	15.77
110	300413	芒果超媒	38,828,176.75	15.76
111	603129	春风动力	38,691,002.96	15.71
112	002493	荣盛石化	38,589,719.02	15.67
113	002080	中材科技	38,313,728.67	15.55
114	603876	鼎胜新材	37,635,476.00	15.28
115	300638	广和通	37,616,809.78	15.27
116	002756	永兴材料	37,589,767.37	15.26
117	002139	拓邦股份	37,562,496.00	15.25
118	688499	利元亨	37,315,088.13	15.15
119	601699	潞安环能	37,282,695.58	15.14
120	002410	广联达	37,168,509.89	15.09
121	688039	当虹科技	36,293,180.35	14.73

122	601633	长城汽车	36,218,276.00	14.70
123	601668	中国建筑	36,043,178.00	14.63
124	603916	苏博特	35,690,117.85	14.49
125	600760	中航沈飞	35,524,269.89	14.42
126	605066	天正电气	34,791,702.00	14.12
127	601155	新城控股	34,723,994.39	14.10
128	000629	攀钢钒钛	34,638,540.00	14.06
129	688005	容百科技	34,571,461.19	14.03
130	300763	锦浪科技	34,569,941.00	14.03
131	600132	重庆啤酒	34,561,705.80	14.03
132	002459	晶澳科技	33,951,902.00	13.78
133	603517	绝味食品	33,725,099.62	13.69
134	601117	中国化学	33,648,375.56	13.66
135	600908	无锡银行	33,287,508.45	13.51
136	002043	兔宝宝	33,070,176.75	13.43
137	600039	四川路桥	33,060,173.14	13.42
138	688169	石头科技	33,042,936.16	13.41
139	002851	麦格米特	32,986,568.53	13.39
140	002833	弘亚数控	32,807,351.14	13.32
141	688107	安路科技	32,789,503.03	13.31
142	000807	云铝股份	32,556,234.81	13.22
143	300408	三环集团	32,465,212.00	13.18
144	600019	宝钢股份	31,989,211.78	12.99
145	300088	长信科技	31,925,907.00	12.96
146	002352	顺丰控股	31,881,754.00	12.94
147	300384	三联虹普	31,786,642.30	12.90
148	002128	电投能源	31,754,462.00	12.89
149	000537	广宇发展	31,727,143.97	12.88
150	601800	中国交建	31,554,612.00	12.81
151	300065	海兰信	31,462,526.75	12.77
152	000858	五粮液	31,353,321.40	12.73

153	603612	索通发展	31,012,222.21	12.59
154	002643	万润股份	30,810,358.77	12.51
155	688608	恒玄科技	30,763,341.53	12.49
156	300035	中科电气	30,596,505.79	12.42
157	688023	安恒信息	30,414,836.97	12.35
158	603816	顾家家居	30,260,308.92	12.28
159	601225	陕西煤业	30,232,730.00	12.27
160	600176	中国巨石	30,227,898.23	12.27
161	300129	泰胜风能	30,193,720.00	12.26
162	000723	美锦能源	30,160,300.44	12.24
163	002815	崇达技术	30,085,189.10	12.21
164	600487	亨通光电	29,566,024.33	12.00
165	601186	中国铁建	29,550,872.08	12.00
166	601677	明泰铝业	29,547,928.86	12.00
167	603938	三孚股份	29,422,299.60	11.94
168	300286	安科瑞	29,373,744.50	11.92
169	603185	上机数控	29,114,512.00	11.82
170	600183	生益科技	29,074,907.51	11.80
171	600809	山西汾酒	28,842,629.76	11.71
172	688561	奇安信	28,812,449.17	11.70
173	600426	华鲁恒升	28,696,049.70	11.65
174	300832	新产业	28,548,498.80	11.59
175	002167	东方锆业	28,520,997.92	11.58
176	601222	林洋能源	27,666,520.03	11.23
177	000829	天音控股	27,653,267.86	11.23
178	300059	东方财富	27,499,624.00	11.16
179	002821	凯莱英	27,270,603.12	11.07
180	603486	科沃斯	26,935,545.30	10.93
181	000860	顺鑫农业	26,831,336.00	10.89
182	000733	振华科技	26,674,252.00	10.83
183	603197	保隆科技	26,372,047.28	10.71

184	600456	宝钛股份	26,242,031.85	10.65
185	300776	帝尔激光	25,935,615.60	10.53
186	300316	晶盛机电	25,796,451.54	10.47
187	601818	光大银行	25,708,049.70	10.44
188	601128	常熟银行	25,512,733.37	10.36
189	300853	申昊科技	25,493,577.40	10.35
190	600703	三安光电	25,374,753.00	10.30
191	688559	海目星	25,367,172.21	10.30
192	002129	中环股份	25,219,604.80	10.24
193	002791	坚朗五金	24,936,383.20	10.12
194	002968	新大正	24,897,099.35	10.11
195	002832	比音勒芬	24,893,095.49	10.11
196	000932	华菱钢铁	24,853,138.03	10.09
197	600116	三峡水利	24,663,181.23	10.01
198	300033	同花顺	24,464,092.86	9.93
199	688366	昊海生科	24,321,007.53	9.87
200	002594	比亚迪	24,308,742.00	9.87
201	300327	中颖电子	24,099,340.26	9.78
202	600765	中航重机	24,013,327.59	9.75
203	688006	杭可科技	23,874,376.14	9.69
204	688233	神工股份	23,827,874.48	9.67
205	601126	四方股份	23,599,892.83	9.58
206	002353	杰瑞股份	23,572,326.68	9.57
207	603355	莱克电气	23,487,982.88	9.54
208	300760	迈瑞医疗	23,350,073.00	9.48
209	688357	建龙微纳	23,340,302.28	9.48
210	002841	视源股份	23,335,102.00	9.47
211	002845	同兴达	23,271,958.00	9.45
212	300866	安克创新	23,167,837.59	9.41
213	300911	亿田智能	22,702,612.33	9.22
214	002039	黔源电力	22,401,076.52	9.09

215	002386	天原股份	22,392,692.80	9.09
216	601101	昊华能源	22,311,193.00	9.06
217	600141	兴发集团	21,998,444.20	8.93
218	603568	伟明环保	21,930,095.04	8.90
219	600660	福耀玻璃	21,851,358.10	8.87
220	601838	成都银行	21,810,622.58	8.85
221	603589	口子窖	21,709,913.00	8.81
222	300887	谱尼测试	21,659,250.32	8.79
223	300682	朗新科技	21,549,625.72	8.75
224	603236	移远通信	21,406,305.60	8.69
225	000333	美的集团	21,346,036.51	8.67
226	688558	国盛智科	21,337,443.95	8.66
227	601689	拓普集团	21,211,374.66	8.61
228	688188	柏楚电子	21,187,200.17	8.60
229	600233	圆通速递	21,068,070.38	8.55
230	603613	国联股份	21,029,871.29	8.54
231	000968	蓝焰控股	20,842,351.70	8.46
232	600171	上海贝岭	20,826,737.70	8.45
233	600089	特变电工	20,633,323.84	8.38
234	688301	奕瑞科技	20,589,054.27	8.36
235	002466	天齐锂业	20,524,152.64	8.33
236	300671	富满微	20,228,048.11	8.21
237	688356	键凯科技	19,999,451.27	8.12
238	603877	太平鸟	19,899,445.51	8.08
239	002876	三利谱	19,830,801.49	8.05
240	300782	卓胜微	19,624,180.08	7.97
241	300648	星云股份	19,604,689.00	7.96
242	601877	正泰电器	19,470,158.00	7.90
243	002216	三全食品	19,396,314.62	7.87
244	300601	康泰生物	19,221,530.40	7.80
245	002920	德赛西威	19,205,595.97	7.80

246	600111	北方稀土	19,190,270.00	7.79
247	002732	燕塘乳业	19,150,717.51	7.77
248	002645	华宏科技	19,133,683.70	7.77
249	000887	中鼎股份	18,883,421.00	7.67
250	300740	水羊股份	18,869,089.50	7.66
251	002918	蒙娜丽莎	18,596,449.97	7.55
252	300790	宇瞳光学	18,593,847.40	7.55
253	002212	天融信	18,576,840.73	7.54
254	600114	东睦股份	18,345,875.28	7.45
255	002637	赞宇科技	18,329,047.10	7.44
256	000519	中兵红箭	18,247,173.97	7.41
257	600873	梅花生物	18,219,537.00	7.40
258	688017	绿的谐波	18,077,338.76	7.34
259	601238	广汽集团	18,039,012.80	7.32
260	603818	曲美家居	17,976,721.00	7.30
261	002508	老板电器	17,916,116.00	7.27
262	603326	我乐家居	17,839,376.52	7.24
263	002739	万达电影	17,745,143.00	7.20
264	688388	嘉元科技	17,743,840.37	7.20
265	603456	九洲药业	17,697,047.00	7.18
266	300451	创业慧康	17,371,932.05	7.05
267	601600	中国铝业	17,368,677.96	7.05
268	600030	中信证券	17,287,865.49	7.02
269	601058	赛轮轮胎	17,240,751.27	7.00
270	002158	汉钟精机	17,174,516.30	6.97
271	300982	苏文电能	17,156,556.72	6.96
272	002230	科大讯飞	17,025,620.52	6.91
273	600493	凤竹纺织	17,020,385.00	6.91
274	601872	招商轮船	16,968,812.44	6.89
275	002154	报喜鸟	16,841,192.12	6.84
276	603986	兆易创新	16,800,876.00	6.82

277	603108	润达医疗	16,758,145.71	6.80
278	003016	欣贺股份	16,579,318.68	6.73
279	688066	航天宏图	16,564,977.88	6.72
280	601388	怡球资源	16,483,497.00	6.69
281	688598	金博股份	16,468,358.26	6.69
282	000983	山西焦煤	16,309,324.94	6.62
283	300894	火星人	16,278,672.45	6.61
284	688360	德马科技	16,278,476.84	6.61
285	600323	瀚蓝环境	16,243,100.28	6.59
286	300280	紫天科技	16,114,745.00	6.54
287	002209	达意隆	15,959,192.99	6.48
288	601009	南京银行	15,902,965.85	6.46
289	603959	百利科技	15,882,150.44	6.45
290	300590	移为通信	15,811,099.20	6.42
291	600096	云天化	15,784,669.21	6.41
292	603826	坤彩科技	15,729,037.00	6.39
293	603757	大元泵业	15,548,027.23	6.31
294	002150	通润装备	15,545,326.27	6.31
295	002081	金螳螂	15,474,671.00	6.28
296	300260	新莱应材	15,472,790.06	6.28
297	002568	百润股份	15,206,050.33	6.17
298	000768	中航西飞	15,117,598.00	6.14
299	301029	怡合达	15,076,344.52	6.12
300	605399	晨光新材	14,939,887.00	6.06
301	601865	福莱特	14,903,904.76	6.05
302	300210	森远股份	14,805,555.20	6.01
303	002831	裕同科技	14,697,389.40	5.97
304	605166	聚合顺	14,667,566.00	5.95
305	605006	山东玻纤	14,485,617.07	5.88
306	300659	中孚信息	14,254,863.91	5.79
307	300409	道氏技术	14,214,285.00	5.77

308	000988	华工科技	14,161,281.98	5.75
309	688016	心脉医疗	14,126,714.35	5.73
310	300294	博雅生物	13,992,644.00	5.68
311	600585	海螺水泥	13,956,905.07	5.67
312	603155	新亚强	13,918,386.50	5.65
313	300009	安科生物	13,912,357.75	5.65
314	000906	浙商中拓	13,855,285.42	5.62
315	600887	伊利股份	13,783,480.27	5.60
316	600884	杉杉股份	13,637,344.42	5.54
317	600729	重庆百货	13,451,277.00	5.46
318	300390	天华超净	13,449,385.00	5.46
319	603688	石英股份	13,404,016.65	5.44
320	603538	美诺华	13,370,816.00	5.43
321	603229	奥翔药业	13,366,779.32	5.43
322	688050	爱博医疗	13,313,309.17	5.40
323	300772	运达股份	13,236,213.00	5.37
324	002541	鸿路钢构	13,201,345.88	5.36
325	603901	永创智能	13,176,868.97	5.35
326	603610	麒盛科技	13,141,342.55	5.33
327	688300	联瑞新材	13,140,878.01	5.33
328	603810	丰山集团	13,112,604.70	5.32
329	600699	均胜电子	12,965,252.00	5.26
330	603516	淳中科技	12,772,074.77	5.18
331	600008	首创环保	12,770,369.57	5.18
332	002557	洽洽食品	12,743,323.00	5.17
333	601899	紫金矿业	12,671,190.00	5.14
334	002759	天际股份	12,660,463.00	5.14
335	603507	振江股份	12,659,316.00	5.14
336	600847	万里股份	12,647,210.00	5.13
337	300441	鲍斯股份	12,546,493.75	5.09
338	002624	完美世界	12,517,500.00	5.08

339	002597	金禾实业	12,502,590.00	5.08
340	003816	中国广核	12,461,983.00	5.06
341	688037	芯源微	12,378,256.75	5.03
342	002231	奥维通信	12,353,605.28	5.02
343	600829	人民同泰	12,328,182.44	5.00
344	002240	盛新锂能	12,280,635.14	4.99
345	300761	立华股份	12,273,772.00	4.98
346	002444	巨星科技	12,185,056.17	4.95
347	002140	东华科技	12,070,425.00	4.90
348	600461	洪城环境	12,015,625.20	4.88
349	000026	飞亚达	11,998,451.00	4.87
350	002614	奥佳华	11,970,038.67	4.86
351	300145	中金环境	11,954,862.38	4.85
352	603885	吉祥航空	11,941,078.00	4.85
353	688200	华峰测控	11,932,477.19	4.84
354	000915	华特达因	11,887,689.30	4.83
355	688668	鼎通科技	11,734,714.29	4.76
356	002372	伟星新材	11,715,516.00	4.76
357	603006	联明股份	11,711,087.00	4.75
358	002245	蔚蓝锂芯	11,709,765.00	4.75
359	603739	蔚蓝生物	11,679,342.80	4.74
360	002648	卫星化学	11,652,556.00	4.73
361	600803	新奥股份	11,647,433.42	4.73
362	603021	山东华鹏	11,628,086.60	4.72
363	603369	今世缘	11,618,661.12	4.72
364	300115	长盈精密	11,595,729.60	4.71
365	601678	滨化股份	11,543,637.11	4.69
366	600516	方大炭素	11,533,002.00	4.68
367	301061	匠心家居	11,473,789.00	4.66
368	300198	纳川股份	11,463,860.00	4.65
369	603639	海利尔	11,436,306.10	4.64

370	603801	志邦家居	11,374,308.40	4.62
371	002417	深南股份	11,326,995.00	4.60
372	002345	潮宏基	11,250,135.60	4.57
373	002153	石基信息	11,189,179.60	4.54
374	603256	宏和科技	11,169,493.00	4.53
375	600885	宏发股份	11,063,590.00	4.49
376	300737	科顺股份	11,048,806.00	4.49
377	603681	永冠新材	11,017,254.00	4.47
378	600232	金鹰股份	10,915,968.84	4.43
379	002126	银轮股份	10,883,332.60	4.42
380	600584	长电科技	10,867,675.00	4.41
381	300121	阳谷华泰	10,859,563.02	4.41
382	000510	新金路	10,854,947.00	4.41
383	300432	富临精工	10,620,998.70	4.31
384	300877	金春股份	10,522,233.23	4.27
385	600905	三峡能源	10,457,157.00	4.25
386	688299	长阳科技	10,424,606.27	4.23
387	002479	富春环保	10,395,541.50	4.22
388	600626	申达股份	10,367,688.03	4.21
389	002315	焦点科技	10,327,353.87	4.19
390	002028	思源电气	10,323,432.00	4.19
391	603987	康德莱	10,312,639.56	4.19
392	300305	裕兴股份	10,306,648.00	4.18
393	000960	锡业股份	10,294,887.36	4.18
394	603931	格林达	10,233,977.94	4.15
395	000715	中兴商业	10,231,373.32	4.15
396	688113	联测科技	10,209,190.33	4.14
397	300512	中亚股份	10,198,921.32	4.14
398	300440	运达科技	10,186,492.96	4.14
399	603300	华铁应急	10,169,589.77	4.13
400	600460	士兰微	10,122,189.98	4.11

401	603995	甬金股份	10,019,285.00	4.07
402	688670	金迪克	10,011,593.92	4.06
403	601918	新集能源	10,011,481.00	4.06
404	603558	健盛集团	10,001,025.00	4.06
405	603551	奥普家居	9,975,788.68	4.05
406	000605	渤海股份	9,911,785.89	4.02
407	688198	佰仁医疗	9,896,509.13	4.02
408	300604	长川科技	9,879,412.00	4.01
409	002402	和而泰	9,809,961.00	3.98
410	002928	华夏航空	9,804,969.25	3.98
411	601208	东材科技	9,801,950.20	3.98
412	601669	中国电建	9,603,353.78	3.90
413	600463	空港股份	9,545,013.08	3.87
414	300811	铂科新材	9,525,576.00	3.87
415	600779	水井坊	9,488,223.00	3.85
416	601888	中国中免	9,454,777.00	3.84
417	000985	大庆华科	9,450,433.80	3.84
418	002761	浙江建投	9,417,052.48	3.82
419	600586	金晶科技	9,385,748.00	3.81
420	002205	国统股份	9,368,353.30	3.80
421	600732	爱旭股份	9,357,190.00	3.80
422	603985	恒润股份	9,336,627.30	3.79
423	688699	明微电子	9,318,420.45	3.78
424	688059	华锐精密	9,275,151.35	3.77
425	002599	盛通股份	9,252,991.34	3.76
426	603086	先达股份	9,244,335.36	3.75
427	603520	司太立	9,191,897.58	3.73
428	002708	光洋股份	9,183,080.89	3.73
429	688568	中科星图	9,163,453.70	3.72
430	603378	亚士创能	9,150,088.70	3.71
431	002539	云图控股	9,147,383.00	3.71

432	002165	红 宝 丽	9,088,101.00	3.69
433	600886	国投电力	9,054,196.19	3.68
434	300343	联创股份	9,038,399.76	3.67
435	603117	万林物流	9,027,897.07	3.66
436	603738	泰晶科技	9,004,470.40	3.66
437	000657	中钨高新	8,992,546.40	3.65
438	600010	包钢股份	8,960,799.00	3.64
439	600818	中路股份	8,924,330.00	3.62
440	600396	金山股份	8,922,353.00	3.62
441	601882	海天精工	8,831,812.00	3.59
442	600256	广汇能源	8,814,846.90	3.58
443	603023	威帝股份	8,814,060.46	3.58
444	601168	西部矿业	8,781,619.27	3.56
445	601958	金钼股份	8,778,210.40	3.56
446	002009	天奇股份	8,675,335.00	3.52
447	601233	桐昆股份	8,664,940.54	3.52
448	688099	晶晨股份	8,629,675.20	3.50
449	605358	立昂微	8,617,419.44	3.50
450	600496	精工钢构	8,597,166.94	3.49
451	603939	益丰药房	8,588,239.05	3.49
452	002650	加加食品	8,576,809.00	3.48
453	002138	顺络电子	8,575,399.00	3.48
454	300218	安利股份	8,530,635.00	3.46
455	600651	飞乐音响	8,504,224.44	3.45
456	603889	新澳股份	8,420,822.72	3.42
457	000797	中国武夷	8,409,797.68	3.41
458	300176	派生科技	8,264,061.00	3.35
459	603819	神力股份	8,259,531.60	3.35
460	603386	广东骏亚	8,234,920.90	3.34
461	002149	西部材料	8,210,606.00	3.33
462	600057	厦门象屿	8,142,636.77	3.31

463	002274	华昌化工	8,123,280.00	3.30
464	600808	马钢股份	8,108,856.12	3.29
465	600988	赤峰黄金	8,104,783.00	3.29
466	002781	奇信股份	8,047,228.00	3.27
467	002990	盛视科技	8,024,520.00	3.26
468	688155	先惠技术	8,021,731.92	3.26
469	300626	华瑞股份	7,960,705.16	3.23
470	000917	电广传媒	7,906,395.10	3.21
471	002494	华斯股份	7,885,290.70	3.20
472	600965	福成股份	7,868,750.00	3.19
473	002961	瑞达期货	7,821,941.00	3.18
474	605186	健麾信息	7,812,012.70	3.17
475	688630	芯碁微装	7,793,450.79	3.16
476	300531	优博讯	7,787,327.84	3.16
477	002818	富森美	7,784,357.98	3.16
478	002472	双环传动	7,774,468.00	3.16
479	002932	明德生物	7,759,565.40	3.15
480	002824	和胜股份	7,750,032.00	3.15
481	300223	北京君正	7,737,586.00	3.14
482	688313	仕佳光子	7,716,229.38	3.13
483	002430	杭氧股份	7,680,353.00	3.12
484	002048	宁波华翔	7,677,589.00	3.12
485	605108	同庆楼	7,672,978.44	3.11
486	688368	晶丰明源	7,625,945.26	3.10
487	000898	鞍钢股份	7,617,151.00	3.09
488	300833	浩洋股份	7,605,132.00	3.09
489	000897	津滨发展	7,602,860.00	3.09
490	300652	雷迪克	7,602,293.15	3.09
491	603198	迎驾贡酒	7,586,549.02	3.08
492	002828	贝肯能源	7,576,394.80	3.08
493	688257	新锐股份	7,571,868.98	3.07

494	688187	时代电气	7,565,111.16	3.07
495	300799	左江科技	7,545,377.00	3.06
496	603041	美思德	7,533,995.55	3.06
497	600785	新华百货	7,504,151.94	3.05
498	002110	三钢闽光	7,484,100.50	3.04
499	002837	英维克	7,389,254.00	3.00
500	600826	兰生股份	7,336,150.97	2.98
501	002722	金轮股份	7,294,024.00	2.96
502	300470	中密控股	7,290,459.00	2.96
503	603002	宏昌电子	7,284,039.00	2.96
504	002258	利尔化学	7,268,970.04	2.95
505	603906	龙蟠科技	7,246,455.08	2.94
506	600025	华能水电	7,219,849.00	2.93
507	605338	巴比食品	7,192,026.00	2.92
508	603095	越剑智能	7,146,437.00	2.90
509	300755	华致酒行	7,128,378.60	2.89
510	688308	欧科亿	7,058,095.57	2.87
511	605111	新洁能	7,037,542.40	2.86
512	300639	凯普生物	7,007,517.72	2.84
513	003021	兆威机电	6,980,176.36	2.83
514	002299	圣农发展	6,965,704.57	2.83
515	300653	正海生物	6,959,729.40	2.83
516	000796	凯撒旅业	6,956,293.00	2.82
517	300054	鼎龙股份	6,953,928.00	2.82
518	002460	赣锋锂业	6,953,859.40	2.82
519	300582	英飞特	6,951,338.00	2.82
520	600581	八一钢铁	6,925,116.05	2.81
521	000042	中洲控股	6,889,032.00	2.80
522	688092	爱科科技	6,866,709.64	2.79
523	002465	海格通信	6,861,262.00	2.79
524	300487	蓝晓科技	6,853,035.00	2.78

525	688696	极米科技	6,835,156.59	2.77
526	300126	锐奇股份	6,828,642.00	2.77
527	300951	博硕科技	6,781,162.88	2.75
528	003026	中晶科技	6,778,715.00	2.75
529	603028	赛福天	6,778,650.00	2.75
530	002765	蓝黛科技	6,759,136.00	2.74
531	002633	申科股份	6,749,337.00	2.74
532	002593	日上集团	6,745,354.12	2.74
533	300505	川金诺	6,726,012.60	2.73
534	002870	香山股份	6,723,201.00	2.73
535	603186	华正新材	6,718,493.00	2.73
536	601088	中国神华	6,700,503.15	2.72
537	000409	云鼎科技	6,693,267.27	2.72
538	600202	哈空调	6,655,385.98	2.70
539	300373	扬杰科技	6,618,629.00	2.69
540	000961	中南建设	6,608,187.00	2.68
541	002988	豪美新材	6,599,126.00	2.68
542	300550	和仁科技	6,593,697.70	2.68
543	002451	摩恩电气	6,591,140.00	2.68
544	002108	沧州明珠	6,578,067.88	2.67
545	600483	福能股份	6,550,797.26	2.66
546	603128	华贸物流	6,544,533.90	2.66
547	605288	凯迪股份	6,543,326.38	2.66
548	688335	复洁环保	6,512,596.51	2.64
549	002745	木林森	6,504,116.00	2.64
550	002120	韵达股份	6,474,434.00	2.63
551	300557	理工光科	6,453,688.00	2.62
552	300535	达威股份	6,401,598.55	2.60
553	688390	固德威	6,376,244.23	2.59
554	600262	北方股份	6,298,159.99	2.56
555	688135	利扬芯片	6,294,351.37	2.56

556	300519	新光药业	6,261,145.00	2.54
557	000969	安泰科技	6,250,484.00	2.54
558	688686	奥普特	6,211,680.30	2.52
559	300181	佐力药业	6,208,671.34	2.52
560	000819	岳阳兴长	6,202,512.86	2.52
561	002718	友邦吊顶	6,172,060.50	2.51
562	603278	大业股份	6,153,301.20	2.50
563	600173	卧龙地产	6,126,324.90	2.49
564	600665	天地源	6,118,829.99	2.48
565	603726	朗迪集团	6,116,870.32	2.48
566	002771	真视通	6,114,161.36	2.48
567	000731	四川美丰	6,103,718.00	2.48
568	300573	兴齐眼药	6,093,482.00	2.47
569	600510	黑牡丹	6,078,189.28	2.47
570	600843	上工申贝	6,047,036.00	2.45
571	300254	仟源医药	6,012,900.58	2.44
572	600650	锦江在线	5,997,835.11	2.43
573	000776	广发证券	5,947,160.00	2.41
574	688036	传音控股	5,885,232.41	2.39
575	600491	龙元建设	5,883,893.00	2.39
576	603527	众源新材	5,827,310.73	2.37
577	603444	吉比特	5,796,543.00	2.35
578	600104	上汽集团	5,763,603.00	2.34
579	300910	瑞丰新材	5,761,471.73	2.34
580	001215	千味央厨	5,752,733.00	2.34
581	603217	元利科技	5,751,401.20	2.33
582	600824	益民集团	5,746,554.97	2.33
583	300825	阿尔特	5,738,431.00	2.33
584	688069	德林海	5,731,880.38	2.33
585	603679	华体科技	5,727,548.80	2.33
586	600097	开创国际	5,704,764.00	2.32

587	603825	华扬联众	5,693,092.00	2.31
588	300399	天利科技	5,677,172.00	2.30
589	600243	青海华鼎	5,659,866.97	2.30
590	300748	金力永磁	5,615,070.00	2.28
591	000957	中通客车	5,601,318.00	2.27
592	600486	扬农化工	5,596,917.00	2.27
593	002112	三变科技	5,585,650.00	2.27
594	000703	恒逸石化	5,584,453.00	2.27
595	300575	中旗股份	5,575,430.00	2.26
596	600976	健民集团	5,544,083.00	2.25
597	002098	浔兴股份	5,526,500.31	2.24
598	002015	协鑫能科	5,516,123.26	2.24
599	002939	长城证券	5,506,416.00	2.24
600	003043	华亚智能	5,502,339.00	2.23
601	300533	冰川网络	5,493,577.50	2.23
602	002405	四维图新	5,487,905.00	2.23
603	603982	泉峰汽车	5,477,432.00	2.22
604	600897	厦门空港	5,463,209.73	2.22
605	002286	保龄宝	5,419,116.00	2.20
606	600272	开开实业	5,415,267.00	2.20
607	688030	山石网科	5,382,331.77	2.18
608	002425	凯撒文化	5,379,854.00	2.18
609	603798	康普顿	5,370,194.00	2.18
610	002919	名臣健康	5,352,812.00	2.17
611	605080	浙江自然	5,341,676.84	2.17
612	000799	酒鬼酒	5,318,761.00	2.16
613	002947	恒铭达	5,315,905.80	2.16
614	002886	沃特股份	5,314,714.00	2.16
615	300612	宣亚国际	5,309,976.00	2.16
616	300669	沪宁股份	5,269,300.50	2.14
617	600149	廊坊发展	5,223,954.00	2.12

618	002830	名雕股份	5,215,898.50	2.12
619	002042	华孚时尚	5,186,597.00	2.11
620	601798	蓝科高新	5,168,650.00	2.10
621	300805	电声股份	5,164,312.00	2.10
622	603268	松发股份	5,139,349.20	2.09
623	002242	九阳股份	5,113,727.00	2.08
624	601898	中煤能源	5,073,206.00	2.06
625	000880	潍柴重机	5,057,129.60	2.05
626	000536	华映科技	5,042,617.40	2.05
627	688056	莱伯泰科	5,018,316.81	2.04
628	600545	卓郎智能	4,994,612.00	2.03
629	600212	江泉实业	4,957,623.84	2.01
630	601601	中国太保	4,943,835.00	2.01

注：买入金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000683	远兴能源	149,110,654.44	60.53
2	603737	三棵树	125,062,960.14	50.77
3	600522	中天科技	117,761,333.89	47.81
4	600309	万华化学	105,749,188.48	42.93
5	603659	璞泰来	104,841,015.45	42.56
6	603259	药明康德	93,845,298.41	38.10
7	300196	长海股份	93,355,073.26	37.90
8	000831	五矿稀土	87,151,752.80	35.38
9	000063	中兴通讯	78,540,259.17	31.88
10	600900	长江电力	78,055,276.46	31.69
11	300725	药石科技	77,851,110.61	31.60
12	600801	华新水泥	77,604,496.25	31.50

13	002241	歌尔股份	76,945,800.81	31.24
14	002812	恩捷股份	76,549,766.56	31.08
15	002371	北方华创	76,281,047.23	30.97
16	002709	天赐材料	71,151,862.29	28.88
17	300363	博腾股份	68,707,757.00	27.89
18	003022	联泓新科	68,349,287.15	27.75
19	601636	旗滨集团	67,255,024.62	27.30
20	002335	科华数据	66,677,377.07	27.07
21	300124	汇川技术	65,881,447.13	26.75
22	000001	平安银行	65,450,621.46	26.57
23	600011	华能国际	64,887,273.82	26.34
24	002929	润建股份	63,470,872.82	25.77
25	002436	兴森科技	63,348,979.14	25.72
26	688516	奥特维	62,397,168.00	25.33
27	300750	宁德时代	62,012,461.92	25.17
28	600188	兖矿能源	61,884,246.12	25.12
29	600036	招商银行	60,858,544.72	24.71
30	600875	东方电气	59,378,905.63	24.11
31	601012	隆基股份	59,119,190.26	24.00
32	600863	内蒙华电	58,913,610.38	23.92
33	002013	中航机电	58,669,791.24	23.82
34	603897	长城科技	57,731,388.81	23.44
35	600546	山煤国际	57,456,304.44	23.32
36	002850	科达利	56,646,918.40	23.00
37	300274	阳光电源	56,496,242.65	22.94
38	603799	华友钴业	55,591,671.00	22.57
39	603392	万泰生物	55,555,583.27	22.55
40	603260	合盛硅业	55,370,361.14	22.48
41	600438	通威股份	54,785,666.18	22.24
42	600570	恒生电子	53,863,361.41	21.87
43	603657	春光科技	53,668,420.72	21.79

44	300122	智飞生物	52,986,250.79	21.51
45	300568	星源材质	52,642,039.81	21.37
46	688019	安集科技	52,554,045.69	21.33
47	601166	兴业银行	52,036,773.48	21.12
48	300014	亿纬锂能	51,778,933.10	21.02
49	000568	泸州老窖	51,258,619.14	20.81
50	600276	恒瑞医药	50,647,123.16	20.56
51	300073	当升科技	50,347,878.32	20.44
52	600596	新安股份	50,229,771.21	20.39
53	300769	德方纳米	49,823,975.71	20.23
54	603055	台华新材	49,125,092.12	19.94
55	300347	泰格医药	49,081,759.43	19.93
56	000498	山东路桥	48,978,504.65	19.88
57	600690	海尔智家	48,787,192.61	19.81
58	000672	上峰水泥	48,655,599.00	19.75
59	601966	玲珑轮胎	48,467,599.17	19.68
60	688536	思瑞浦	48,423,557.35	19.66
61	603396	金辰股份	48,361,733.88	19.63
62	600763	通策医疗	47,860,330.20	19.43
63	300696	爱乐达	47,682,355.50	19.36
64	300502	新易盛	46,789,113.32	18.99
65	000002	万 科 A	46,249,561.97	18.78
66	600529	山东药玻	46,202,686.53	18.76
67	688596	正帆科技	46,116,447.62	18.72
68	000661	长春高新	45,964,881.26	18.66
69	600926	杭州银行	45,827,071.92	18.60
70	300207	欣旺达	45,494,344.10	18.47
71	002555	三七互娱	45,193,967.24	18.35
72	600048	保利发展	45,031,542.08	18.28
73	002312	川发龙蟒	44,479,648.50	18.06
74	000818	航锦科技	43,891,274.41	17.82

75	002326	永太科技	43,779,151.19	17.77
76	300454	深信服	43,685,668.56	17.73
77	603501	韦尔股份	43,010,396.06	17.46
78	600588	用友网络	42,663,345.11	17.32
79	300015	爱尔眼科	42,138,298.06	17.11
80	300702	天宇股份	41,691,036.44	16.92
81	688186	广大特材	41,506,875.68	16.85
82	600519	贵州茅台	41,288,441.00	16.76
83	300896	爱美客	41,105,207.00	16.69
84	600060	海信视像	40,912,518.38	16.61
85	300496	中科创达	39,951,827.69	16.22
86	000977	浪潮信息	39,347,570.98	15.97
87	002142	宁波银行	39,267,003.83	15.94
88	002304	洋河股份	39,197,339.99	15.91
89	300638	广和通	39,090,290.20	15.87
90	600132	重庆啤酒	38,711,613.00	15.72
91	002318	久立特材	38,665,254.12	15.70
92	002311	海大集团	38,620,492.01	15.68
93	600760	中航沈飞	38,562,727.25	15.65
94	300413	芒果超媒	38,516,761.61	15.64
95	688039	当虹科技	37,921,623.99	15.39
96	000902	新洋丰	37,865,309.93	15.37
97	000963	华东医药	37,204,904.38	15.10
98	002706	良信股份	36,978,043.32	15.01
99	601117	中国化学	36,573,662.00	14.85
100	002493	荣盛石化	36,492,731.69	14.81
101	603707	健友股份	36,380,808.70	14.77
102	600919	江苏银行	36,026,981.30	14.63
103	601668	中国建筑	35,947,130.00	14.59
104	300450	先导智能	35,947,050.73	14.59
105	603129	春风动力	35,375,069.77	14.36

106	601658	邮储银行	35,153,721.00	14.27
107	601633	长城汽车	35,047,966.61	14.23
108	603876	鼎胜新材	34,886,158.72	14.16
109	002080	中材科技	34,825,655.22	14.14
110	002025	航天电器	33,965,868.87	13.79
111	000629	攀钢钒钛	33,964,764.23	13.79
112	002459	晶澳科技	33,743,105.36	13.70
113	605066	天正电气	33,495,559.76	13.60
114	688107	安路科技	33,478,622.32	13.59
115	600383	金地集团	33,349,712.93	13.54
116	600110	诺德股份	33,265,224.00	13.50
117	688499	利元亨	33,062,256.50	13.42
118	600702	舍得酒业	33,007,317.81	13.40
119	600745	闻泰科技	32,694,418.31	13.27
120	002039	黔源电力	32,196,820.56	13.07
121	000829	天音控股	31,804,212.00	12.91
122	002833	弘亚数控	31,748,535.76	12.89
123	300037	新宙邦	31,490,746.04	12.78
124	688005	容百科技	31,435,790.24	12.76
125	000786	北新建材	31,378,574.34	12.74
126	600039	四川路桥	31,145,498.90	12.64
127	600176	中国巨石	30,699,168.38	12.46
128	601800	中国交建	30,630,422.00	12.43
129	601225	陕西煤业	30,622,328.60	12.43
130	688518	联赢激光	30,528,137.09	12.39
131	000807	云铝股份	30,460,805.62	12.37
132	300129	泰胜风能	30,422,621.36	12.35
133	002271	东方雨虹	30,398,344.15	12.34
134	603612	索通发展	30,389,584.15	12.34
135	300316	晶盛机电	30,195,162.44	12.26
136	002851	麦格米特	29,967,398.51	12.17

137	000723	美锦能源	29,933,968.12	12.15
138	300065	海兰信	29,794,976.91	12.10
139	603185	上机数控	29,713,677.00	12.06
140	601186	中国铁建	29,444,346.42	11.95
141	002410	广联达	29,241,210.41	11.87
142	300286	安科瑞	29,200,632.50	11.85
143	002353	杰瑞股份	29,072,833.90	11.80
144	600908	无锡银行	28,823,866.00	11.70
145	002979	雷赛智能	28,787,516.53	11.69
146	000537	广宇发展	28,782,761.90	11.68
147	601699	潞安环能	28,762,083.32	11.68
148	300384	三联虹普	28,712,964.03	11.66
149	688357	建龙微纳	28,647,401.16	11.63
150	601222	林洋能源	28,335,654.69	11.50
151	600456	宝钛股份	27,499,901.63	11.16
152	601155	新城控股	27,464,336.48	11.15
153	002352	顺丰控股	27,162,611.34	11.03
154	603938	三孚股份	26,633,984.00	10.81
155	300751	迈为股份	26,606,826.00	10.80
156	000519	中兵红箭	26,328,169.25	10.69
157	300760	迈瑞医疗	26,228,529.64	10.65
158	601818	光大银行	26,018,083.00	10.56
159	600183	生益科技	25,956,822.94	10.54
160	603197	保隆科技	25,712,538.80	10.44
161	600019	宝钢股份	25,593,434.92	10.39
162	002167	东方锆业	25,451,091.25	10.33
163	300035	中科电气	25,096,999.00	10.19
164	603816	顾家家居	25,079,961.74	10.18
165	000932	华菱钢铁	25,027,870.76	10.16
166	002594	比亚迪	24,718,622.00	10.03
167	300853	申昊科技	24,603,376.00	9.99

168	002128	电投能源	24,406,767.08	9.91
169	002821	凯莱英	24,354,511.00	9.89
170	600426	华鲁恒升	24,195,636.25	9.82
171	603517	绝味食品	24,116,884.00	9.79
172	600660	福耀玻璃	23,383,019.62	9.49
173	300671	富满微	23,318,369.50	9.47
174	688301	奕瑞科技	23,009,211.23	9.34
175	300763	锦浪科技	22,852,622.75	9.28
176	600233	圆通速递	22,602,670.96	9.18
177	300832	新产业	22,383,452.65	9.09
178	688023	安恒信息	22,320,153.20	9.06
179	603355	莱克电气	22,165,699.00	9.00
180	002881	美格智能	22,134,503.30	8.99
181	000333	美的集团	21,932,469.35	8.90
182	601126	四方股份	21,739,107.00	8.83
183	688006	杭可科技	21,397,761.56	8.69
184	603589	口子窖	21,368,245.82	8.67
185	603236	移远通信	21,363,410.87	8.67
186	601128	常熟银行	20,861,995.00	8.47
187	002968	新大正	20,805,494.50	8.45
188	601877	正泰电器	20,660,199.84	8.39
189	601238	广汽集团	20,628,439.72	8.37
190	600703	三安光电	20,375,857.35	8.27
191	600141	兴发集团	20,221,143.29	8.21
192	600089	特变电工	20,200,826.18	8.20
193	002466	天齐锂业	20,004,596.00	8.12
194	688366	昊海生科	19,863,005.45	8.06
195	601058	赛轮轮胎	19,860,309.15	8.06
196	688169	石头科技	19,832,701.07	8.05
197	002043	兔宝宝	19,771,572.99	8.03
198	603916	苏博特	19,748,441.12	8.02

199	600171	上海贝岭	19,682,690.13	7.99
200	002845	同兴达	19,663,174.17	7.98
201	688558	国盛智科	19,632,346.42	7.97
202	603613	国联股份	19,573,517.92	7.95
203	300033	同花顺	19,552,927.00	7.94
204	002240	盛新锂能	19,417,878.00	7.88
205	603456	九洲药业	19,101,107.50	7.75
206	002645	华宏科技	18,969,063.59	7.70
207	603486	科沃斯	18,892,350.00	7.67
208	002139	拓邦股份	18,866,211.93	7.66
209	300866	安克创新	18,821,093.30	7.64
210	000887	中鼎股份	18,811,747.78	7.64
211	603877	太平鸟	18,608,440.60	7.55
212	688559	海目星	18,596,651.91	7.55
213	002732	燕塘乳业	18,541,921.36	7.53
214	300740	水羊股份	18,455,837.50	7.49
215	300088	长信科技	18,422,756.21	7.48
216	300059	东方财富	18,306,938.52	7.43
217	300911	亿田智能	18,030,165.63	7.32
218	300432	富临精工	17,989,423.50	7.30
219	002508	老板电器	17,944,199.40	7.28
220	002841	视源股份	17,767,687.24	7.21
221	601689	拓普集团	17,680,923.10	7.18
222	000983	山西焦煤	17,629,587.20	7.16
223	688356	键凯科技	17,552,018.21	7.13
224	002739	万达电影	17,485,800.50	7.10
225	603818	曲美家居	17,389,911.96	7.06
226	601838	成都银行	17,214,681.00	6.99
227	603688	石英股份	17,130,317.00	6.95
228	600111	北方稀土	16,976,108.00	6.89
229	002791	坚朗五金	16,897,157.72	6.86

230	600765	中航重机	16,869,886.00	6.85
231	002876	三利谱	16,659,245.24	6.76
232	002832	比音勒芬	16,542,925.25	6.72
233	300590	移为通信	16,516,140.72	6.70
234	300887	谱尼测试	16,163,948.80	6.56
235	688561	奇安信	16,075,000.02	6.53
236	300280	紫天科技	16,053,509.16	6.52
237	002756	永兴材料	16,002,630.55	6.50
238	600323	瀚蓝环境	15,784,152.00	6.41
239	002209	达意隆	15,647,623.00	6.35
240	002230	科大讯飞	15,647,254.90	6.35
241	601899	紫金矿业	15,602,324.50	6.33
242	002637	赞宇科技	15,595,688.00	6.33
243	601009	南京银行	15,496,221.56	6.29
244	002643	万润股份	15,451,457.00	6.27
245	002920	德赛西威	15,430,023.00	6.26
246	603155	新亚强	15,409,284.00	6.26
247	002568	百润股份	15,394,861.42	6.25
248	603108	润达医疗	15,343,671.60	6.23
249	002150	通润装备	15,322,124.64	6.22
250	000860	顺鑫农业	15,259,542.00	6.19
251	603826	坤彩科技	15,024,022.94	6.10
252	600493	凤竹纺织	14,995,330.91	6.09
253	603959	百利科技	14,980,960.08	6.08
254	600096	云天化	14,807,340.00	6.01
255	605006	山东玻纤	14,665,919.13	5.95
256	002212	天融信	14,618,937.00	5.93
257	000858	五粮液	14,540,223.56	5.90
258	300894	火星人	14,409,263.02	5.85
259	301029	怡合达	14,379,109.51	5.84
260	601600	中国铝业	14,347,164.65	5.82

261	600887	伊利股份	14,326,004.16	5.82
262	300409	道氏技术	14,294,129.22	5.80
263	300210	森远股份	14,217,237.96	5.77
264	603326	我乐家居	14,181,650.88	5.76
265	000988	华工科技	14,084,852.00	5.72
266	002759	天际股份	14,007,423.50	5.69
267	002831	裕同科技	13,948,091.34	5.66
268	688608	恒玄科技	13,807,895.08	5.61
269	600884	杉杉股份	13,750,780.00	5.58
270	688300	联瑞新材	13,553,708.23	5.50
271	300601	康泰生物	13,474,580.12	5.47
272	002216	三全食品	13,125,342.06	5.33
273	000968	蓝焰控股	13,088,855.00	5.31
274	600487	亨通光电	13,048,921.80	5.30
275	603810	丰山集团	13,044,664.20	5.30
276	603757	大元泵业	13,043,269.08	5.30
277	300790	宇瞳光学	12,969,078.40	5.26
278	603369	今世缘	12,939,122.12	5.25
279	002154	报喜鸟	12,900,247.00	5.24
280	601678	滨化股份	12,880,998.80	5.23
281	688188	柏楚电子	12,825,027.60	5.21
282	600809	山西汾酒	12,749,047.00	5.18
283	688233	神工股份	12,668,481.31	5.14
284	600008	首创环保	12,665,212.00	5.14
285	002624	完美世界	12,619,193.55	5.12
286	600461	洪城环境	12,567,422.00	5.10
287	688050	爱博医疗	12,567,154.72	5.10
288	300682	朗新科技	12,550,419.00	5.09
289	600114	东睦股份	12,523,326.04	5.08
290	003816	中国广核	12,520,184.00	5.08
291	600729	重庆百货	12,493,097.73	5.07

292	601872	招商轮船	12,461,231.62	5.06
293	300776	帝尔激光	12,436,264.00	5.05
294	002245	蔚蓝锂芯	12,412,646.00	5.04
295	002231	奥维通信	12,393,402.00	5.03
296	002557	洽洽食品	12,185,478.00	4.95
297	002918	蒙娜丽莎	12,183,295.38	4.95
298	300648	星云股份	12,013,401.00	4.88
299	603006	联明股份	11,893,858.31	4.83
300	600803	新奥股份	11,853,980.62	4.81
301	603639	海利尔	11,820,423.29	4.80
302	002444	巨星科技	11,807,574.74	4.79
303	002158	汉钟精机	11,801,030.93	4.79
304	601101	昊华能源	11,780,681.00	4.78
305	688200	华峰测控	11,776,016.92	4.78
306	688037	芯源微	11,749,553.72	4.77
307	600847	万里股份	11,743,153.46	4.77
308	002140	东华科技	11,700,752.40	4.75
309	000906	浙商中拓	11,692,890.74	4.75
310	603229	奥翔药业	11,664,370.36	4.74
311	600585	海螺水泥	11,663,943.00	4.74
312	601233	桐昆股份	11,479,425.00	4.66
313	300145	中金环境	11,436,829.60	4.64
314	300408	三环集团	11,427,895.00	4.64
315	002541	鸿路钢构	11,338,451.50	4.60
316	600116	三峡水利	11,315,774.00	4.59
317	605399	晨光新材	11,302,692.00	4.59
318	600699	均胜电子	11,263,217.00	4.57
319	002417	深南股份	11,205,453.50	4.55
320	300343	联创股份	11,129,799.26	4.52
321	003016	欣贺股份	11,046,294.56	4.48
322	002415	海康威视	11,020,663.70	4.47

323	600885	宏发股份	10,983,372.00	4.46
324	603021	山东华鹏	10,939,635.53	4.44
325	688388	嘉元科技	10,872,741.12	4.41
326	603300	华铁应急	10,861,612.20	4.41
327	002081	金螳螂	10,779,304.00	4.38
328	300451	创业慧康	10,696,375.90	4.34
329	600886	国投电力	10,677,726.50	4.33
330	600905	三峡能源	10,651,178.00	4.32
331	300811	铂科新材	10,593,135.60	4.30
332	603901	永创智能	10,576,446.00	4.29
333	600232	金鹰股份	10,556,745.00	4.29
334	603987	康德莱	10,541,916.00	4.28
335	002345	潮宏基	10,518,931.30	4.27
336	603931	格林达	10,432,762.40	4.24
337	603538	美诺华	10,364,194.34	4.21
338	002315	焦点科技	10,308,338.00	4.18
339	603507	振江股份	10,268,948.00	4.17
340	000915	华特达因	10,259,734.90	4.17
341	603256	宏和科技	10,242,205.00	4.16
342	601168	西部矿业	10,207,394.00	4.14
343	688299	长阳科技	10,104,531.08	4.10
344	000960	锡业股份	10,094,873.00	4.10
345	000715	中兴商业	10,058,488.06	4.08
346	002028	思源电气	10,040,114.37	4.08
347	601918	新集能源	9,927,855.00	4.03
348	002129	中环股份	9,893,827.00	4.02
349	603086	先达股份	9,883,374.21	4.01
350	000605	渤海股份	9,872,592.75	4.01
351	600396	金山股份	9,848,410.00	4.00
352	603801	志邦家居	9,842,942.05	4.00
353	603551	奥普家居	9,807,357.46	3.98

354	002815	崇达技术	9,776,564.09	3.97
355	300440	运达科技	9,738,250.00	3.95
356	002539	云图控股	9,716,247.00	3.94
357	002614	奥佳华	9,712,888.57	3.94
358	300115	长盈精密	9,707,680.61	3.94
359	688198	佰仁医疗	9,698,676.75	3.94
360	600829	人民同泰	9,692,118.00	3.93
361	600626	申达股份	9,690,429.13	3.93
362	300782	卓胜微	9,663,303.00	3.92
363	600818	中路股份	9,612,706.38	3.90
364	002479	富春环保	9,558,270.00	3.88
365	603738	泰晶科技	9,551,290.20	3.88
366	002402	和而泰	9,510,327.82	3.86
367	002138	顺络电子	9,496,709.60	3.86
368	603985	恒润股份	9,458,336.90	3.84
369	688017	绿的谐波	9,443,976.68	3.83
370	000985	大庆华科	9,421,182.00	3.82
371	688113	联测科技	9,382,513.24	3.81
372	002165	红宝丽	9,250,921.00	3.76
373	000725	京东方A	9,244,817.02	3.75
374	300121	阳谷华泰	9,241,175.42	3.75
375	601669	中国电建	9,206,186.00	3.74
376	002761	浙江建投	9,198,895.04	3.73
377	603117	万林物流	9,190,443.00	3.73
378	300982	苏文电能	9,175,532.17	3.72
379	002708	光洋股份	9,140,984.95	3.71
380	601888	中国中免	9,000,865.00	3.65
381	601865	福莱特	8,959,804.11	3.64
382	688066	航天宏图	8,947,486.74	3.63
383	603986	兆易创新	8,919,559.20	3.62
384	002824	和胜股份	8,878,347.00	3.60

385	300373	扬杰科技	8,865,433.00	3.60
386	000657	中钨高新	8,851,718.40	3.59
387	002205	国统股份	8,832,365.55	3.59
388	605358	立昂微	8,827,584.00	3.58
389	603378	亚士创能	8,766,449.00	3.56
390	688099	晶晨股份	8,709,834.77	3.54
391	600586	金晶科技	8,654,422.00	3.51
392	000026	飞亚达	8,650,330.21	3.51
393	300877	金春股份	8,610,933.93	3.50
394	600256	广汇能源	8,525,393.00	3.46
395	600463	空港股份	8,508,276.36	3.45
396	603819	神力股份	8,488,268.00	3.45
397	002048	宁波华翔	8,415,869.00	3.42
398	603023	威帝股份	8,361,591.51	3.39
399	002650	加加食品	8,326,492.00	3.38
400	002828	贝肯能源	8,303,728.45	3.37
401	600496	精工钢构	8,279,477.00	3.36
402	300626	华瑞股份	8,212,602.00	3.33
403	300305	裕兴股份	8,211,057.90	3.33
404	603739	蔚蓝生物	8,188,558.20	3.32
405	002494	华斯股份	8,164,953.00	3.31
406	300176	派生科技	8,144,230.00	3.31
407	002599	盛通股份	8,126,856.40	3.30
408	601677	明泰铝业	8,094,310.49	3.29
409	688598	金博股份	8,091,640.24	3.28
410	600651	飞乐音响	8,088,866.72	3.28
411	688016	心脉医疗	8,056,924.56	3.27
412	300441	鲍斯股份	8,034,008.92	3.26
413	600988	赤峰黄金	8,006,397.00	3.25
414	002781	奇信股份	7,890,821.67	3.20
415	002928	华夏航空	7,862,607.00	3.19

416	300009	安科生物	7,856,735.88	3.19
417	300761	立华股份	7,816,622.00	3.17
418	601388	怡球资源	7,812,600.00	3.17
419	600785	新华百货	7,796,817.70	3.17
420	002990	盛视科技	7,775,934.48	3.16
421	300653	正海生物	7,750,266.10	3.15
422	002460	赣锋锂业	7,733,763.00	3.14
423	688313	仕佳光子	7,718,150.41	3.13
424	000409	云鼎科技	7,708,276.28	3.13
425	000797	中国武夷	7,702,775.00	3.13
426	000917	电广传媒	7,688,060.52	3.12
427	603520	司太立	7,666,152.60	3.11
428	603041	美思德	7,614,956.80	3.09
429	002597	金禾实业	7,591,926.00	3.08
430	300470	中密控股	7,499,450.26	3.04
431	300512	中亚股份	7,478,917.00	3.04
432	688187	时代电气	7,435,628.31	3.02
433	688699	明微电子	7,395,909.26	3.00
434	605108	同庆楼	7,345,838.46	2.98
435	603889	新澳股份	7,326,436.80	2.97
436	600057	厦门象屿	7,324,268.52	2.97
437	600483	福能股份	7,323,308.38	2.97
438	600826	兰生股份	7,322,939.00	2.97
439	000733	振华科技	7,265,223.00	2.95
440	300260	新莱应材	7,207,608.00	2.93
441	600030	中信证券	7,201,706.99	2.92
442	300223	北京君正	7,197,272.73	2.92
443	605111	新洁能	7,142,089.00	2.90
444	601958	金钼股份	7,074,688.68	2.87
445	600025	华能水电	7,024,817.91	2.85
446	300595	欧普康视	6,968,428.00	2.83

447	300357	我武生物	6,931,936.00	2.81
448	600202	哈空调	6,832,549.99	2.77
449	688155	先惠技术	6,824,192.17	2.77
450	603681	永冠新材	6,818,883.16	2.77
451	002451	摩恩电气	6,791,364.00	2.76
452	300639	凯普生物	6,777,801.48	2.75
453	601088	中国神华	6,777,600.00	2.75
454	600732	爱旭股份	6,744,712.00	2.74
455	605288	凯迪股份	6,694,187.34	2.72
456	002108	沧州明珠	6,692,748.00	2.72
457	300557	理工光科	6,671,812.08	2.71
458	002633	申科股份	6,668,035.00	2.71
459	603186	华正新材	6,635,249.00	2.69
460	002120	韵达股份	6,619,228.34	2.69
461	301061	匠心家居	6,616,887.00	2.69
462	000042	中洲控股	6,614,185.00	2.69
463	300218	安利股份	6,590,182.00	2.68
464	603982	泉峰汽车	6,558,588.00	2.66
465	688630	芯碁微装	6,526,668.42	2.65
466	300755	华致酒行	6,449,443.49	2.62
467	600976	健民集团	6,449,210.00	2.62
468	300505	川金诺	6,409,183.10	2.60
469	688335	复洁环保	6,405,135.64	2.60
470	300550	和仁科技	6,397,976.92	2.60
471	002593	日上集团	6,367,164.75	2.58
472	300825	阿尔特	6,359,589.04	2.58
473	600409	三友化工	6,351,025.93	2.58
474	002126	银轮股份	6,348,550.56	2.58
475	000819	岳阳兴长	6,341,467.61	2.57
476	688390	固德威	6,312,096.85	2.56
477	000796	凯撒旅业	6,307,932.00	2.56

478	601318	中国平安	6,270,865.00	2.55
479	003021	兆威机电	6,264,144.31	2.54
480	600010	包钢股份	6,259,370.01	2.54
481	600965	福成股份	6,243,138.99	2.53
482	002919	名臣健康	6,231,769.50	2.53
483	600510	黑牡丹	6,225,949.83	2.53
484	002472	双环传动	6,219,075.60	2.52
485	002600	领益智造	6,218,965.00	2.52
486	000961	中南建设	6,198,716.00	2.52
487	002299	圣农发展	6,154,521.00	2.50
488	600243	青海华鼎	6,009,697.05	2.44
489	002718	友邦吊顶	5,989,434.39	2.43
490	600581	八一钢铁	5,970,143.00	2.42
491	688368	晶丰明源	5,950,755.01	2.42
492	300327	中颖电子	5,950,143.26	2.42
493	688696	极米科技	5,937,729.76	2.41
494	300181	佐力药业	5,937,471.70	2.41
495	300737	科顺股份	5,914,656.52	2.40
496	000898	鞍钢股份	5,913,180.00	2.40
497	002112	三变科技	5,912,257.00	2.40
498	300126	锐奇股份	5,902,553.00	2.40
499	600262	北方股份	5,894,841.00	2.39
500	002771	真视通	5,862,283.69	2.38
501	603679	华体科技	5,845,873.20	2.37
502	300659	中孚信息	5,818,162.00	2.36
503	300573	兴齐眼药	5,806,715.00	2.36
504	600897	厦门空港	5,791,688.08	2.35
505	300519	新光药业	5,772,927.00	2.34
506	002042	华孚时尚	5,761,437.00	2.34
507	600824	益民集团	5,758,244.98	2.34
508	603095	越剑智能	5,738,929.00	2.33

509	001215	千味央厨	5,735,092.86	2.33
510	300910	瑞丰新材	5,732,027.00	2.33
511	600873	梅花生物	5,711,648.00	2.32
512	002274	华昌化工	5,686,947.00	2.31
513	002098	浔兴股份	5,671,956.00	2.30
514	603198	迎驾贡酒	5,656,402.00	2.30
515	300535	达威股份	5,645,502.00	2.29
516	000703	恒逸石化	5,643,245.00	2.29
517	300533	冰川网络	5,634,408.00	2.29
518	600808	马钢股份	5,633,443.60	2.29
519	300399	天利科技	5,629,036.60	2.29
520	000969	安泰科技	5,625,133.10	2.28
521	601021	春秋航空	5,608,465.30	2.28
522	603825	华扬联众	5,593,733.91	2.27
523	688059	华锐精密	5,589,383.70	2.27
524	603386	广东骏亚	5,577,247.00	2.26
525	002405	四维图新	5,577,072.00	2.26
526	601798	蓝科高新	5,577,048.00	2.26
527	600650	锦江在线	5,565,464.48	2.26
528	603726	朗迪集团	5,535,153.40	2.25
529	002386	天原股份	5,529,385.00	2.24
530	688360	德马科技	5,511,855.16	2.24
531	002932	明德生物	5,509,101.20	2.24
532	002947	恒铭达	5,501,533.00	2.23
533	603002	宏昌电子	5,497,570.00	2.23
534	600516	方大炭素	5,493,487.00	2.23
535	000799	酒鬼酒	5,472,822.00	2.22
536	300254	仟源医药	5,462,656.80	2.22
537	688686	奥普特	5,446,284.16	2.21
538	603798	康普顿	5,374,003.50	2.18
539	601601	中国太保	5,352,882.00	2.17

540	000897	津滨发展	5,344,552.00	2.17
541	300669	沪宁股份	5,325,487.56	2.16
542	600545	卓郎智能	5,308,871.00	2.16
543	002425	凯撒文化	5,307,157.49	2.15
544	600843	上工申贝	5,288,612.40	2.15
545	300612	宣亚国际	5,260,530.00	2.14
546	002722	金轮股份	5,251,424.00	2.13
547	600173	卧龙地产	5,239,326.89	2.13
548	600104	上汽集团	5,234,245.00	2.12
549	300652	雷迪克	5,223,316.00	2.12
550	002110	三钢闽光	5,200,960.00	2.11
551	000651	格力电器	5,185,745.00	2.11
552	002830	名雕股份	5,185,358.00	2.11
553	603028	赛福天	5,180,298.70	2.10
554	600212	江泉实业	5,180,227.78	2.10
555	600018	上港集团	5,165,076.00	2.10
556	000957	中通客车	5,146,194.34	2.09
557	300253	卫宁健康	5,144,536.02	2.09
558	600665	天地源	5,143,841.00	2.09
559	688069	德林海	5,129,747.00	2.08
560	605338	巴比食品	5,123,018.00	2.08
561	600149	廊坊发展	5,109,619.29	2.07
562	600272	开开实业	5,098,286.00	2.07
563	000880	潍柴重机	5,097,902.40	2.07
564	002179	中航光电	5,078,171.00	2.06
565	600661	昂立教育	5,074,890.00	2.06
566	002818	富森美	5,060,106.00	2.05
567	688202	美迪西	5,049,711.65	2.05
568	300805	电声股份	5,032,432.00	2.04
569	603885	吉祥航空	5,032,328.20	2.04
570	603278	大业股份	5,028,994.60	2.04

571	002727	一心堂	5,005,952.00	2.03
572	002601	龙佰集团	4,973,470.08	2.02
573	600452	涪陵电力	4,972,927.60	2.02
574	000536	华映科技	4,969,045.78	2.02
575	600063	皖维高新	4,955,677.88	2.01
576	300390	天华超净	4,931,288.00	2.00

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,856,365,626.52
卖出股票收入（成交）总额	12,986,751,959.45

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以萃取相应债券组合的超额收益。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	951,665.50
2	应收证券清算款	92,343,349.56
3	应收股利	—
4	应收利息	-15,958.00
5	应收申购款	77,236,801.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	170,515,858.91
---	----	----------------

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情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
57,863	23,239.70	1,043,244,588.16	77.58%	301,474,434.48	22.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	118,855.37	0.01%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
曲径	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2018年05月16日)基金份额总额	244,633,211.97
本报告期期初基金份额总额	172,937,284.80
本报告期基金总申购份额	2,479,476,279.83
减：本报告期基金总赎回份额	1,307,694,541.99
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,344,719,022.64

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为80,000.00元人民币。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	789,079,383.16	2.84%	734,875.62	2.91%	-
华创证券	1	808,905,468.12	2.91%	591,554.13	2.34%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	293,977,999.42	1.06%	214,986.33	0.85%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	212,742,359.76	0.76%	198,129.03	0.78%	-
西南证券	1	197,008,977.87	0.71%	183,476.16	0.73%	-
兴业证券	1	11,332,236,326.79	40.74%	10,553,703.20	41.81%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券(华	1	-	-	-	-	-

南)						
德邦 证券	2	1,020,030,940.09	3.67%	745,954.03	2.96%	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	1,059,487,299.39	3.81%	918,084.29	3.64%	-
东兴 证券	2	-	-	-	-	-
国都 证券	2	11,049,699,293.84	39.72%	10,290,631.18	40.77%	-
民生 证券	2	166,238,493.75	0.60%	121,569.93	0.48%	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投	2	887,587,550.41	3.19%	689,708.26	2.73%	-
华泰 证券	3	-	-	-	-	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2. 本报告期内，本基金新增租用华泰证券上海交易单元、中金公司上海交易单元、东方财富深圳交易单元、东北证券上海交易单元、华创证券深圳交易单元、民生证券上海交易单元、民生证券深圳交易单元、中信建投上海交易单元、东兴证券上海交易单元、东方证券深圳交易单元、德邦证券上海交易单元、德邦证券深圳交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金 额	占当期 基金成 交总额 的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	484,565.30	100.00%	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券 (华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	150,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1. 根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上，选择基金专用交易席位，并由公司董事会授权管理层批准。

2. 本报告期内，本基金新增租用华泰证券上海交易单元、中金公司上海交易单元、东方财富深圳交易单元、东北证券上海交易单元、华创证券深圳交易单元、民生证券上海交易单元、民生证券深圳交易单元、中信建投上海交易单元、东兴证券上海交易单元、东方证券深圳交易单元、德邦证券上海交易单元、德邦证券深圳交易单元。

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	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2020年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
2	中欧量化驱动混合型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
3	中欧量化驱动混合型证券投资基金暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-02-27
4	中欧量化驱动混合型证券投资基金恢复申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-15
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2020年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
6	中欧量化驱动混合型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
7	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
8	中欧量化驱动混合型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22

9	中欧基金管理有限公司关于基金经理休假由他人代为履行职责的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-30
10	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
11	中欧量化驱动混合型证券投资基金2021年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2021-07-21
12	中欧基金管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
13	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金产品在中欧财富电子交易平台开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
14	中欧量化驱动混合型证券投资基金2021年中期报告	中国证监会指定媒介	2021-08-31
15	中欧基金管理有限公司办公地址变更公告	中国证监会指定媒介	2021-09-17
16	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定媒介	2021-09-30
17	中欧量化驱动混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2021-09-30
18	中欧基金管理有限公司关于基金经理恢复履行职务的公告	中国证监会指定媒介	2021-09-30
19	中欧量化驱动混合型证券投资基金更新招募说明书（2021年10月）	中国证监会指定媒介	2021-10-22
20	中欧量化驱动混合型证券投资基金2021年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2021-10-27
21	中欧基金管理有限公司旗下	中国证监会指定媒介	2021-10-27

	部分基金2021年第三季度报告的提示性公告		
22	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金最低交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2021-12-09

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2021年1月1日至2021年2月22日	46,619,114.22	0.00	46,619,114.22	0.00	0.00%
	2	2021年1月1日至2021年2月23日	46,619,114.22	0.00	46,619,114.22	0.00	0.00%
	3	2021年1月1日至2021年2月24日	69,929,137.53	0.00	69,929,137.53	0.00	0.00%
	4	2021年2月25日至2021年3月2日	0.00	3,294,961.19	3,294,961.19	0.00	0.00%
	5	2021年3月17日至2021年4月12日;2021年4月15日至2021年6月6日;2021年6月16日至2021年6月27日	0.00	136,521,769.97	136,521,769.97	0.00	0.00%
	6	2021年3月17日至2021年3月29日	0.00	87,296,343.02	0.00	87,296,343.02	6.49%
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

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、中欧量化驱动混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧量化驱动混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧量化驱动混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧量化驱动混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅,或在营业时间内至基金管理人、基金托管人的住所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话:021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司
二〇二二年三月三十一日