

财通沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 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。本中期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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
7.6 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	66
7.7 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	66
7.8 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	66

7.9 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 .....	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
7.12 投资组合报告附注 .....	67
§8 基金份额持有人信息 .....	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
8.3 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 .....	68
§9 开放式基金份额变动 .....	69
§10 重大事件揭示 .....	69
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
10.2 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 .....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
10.4 基金投资策略的改变 .....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
10.8 其他重大事件 .....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
11.1 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 .....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
§12 备查文件目录 .....	74
12.1 备查文件目录 .....	74
12.2 存放地点 .....	74
12.3 查阅方式 .....	74

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通沪深300指数增强型证券投资基金
基金简称	财通沪深300指数增强
场内简称	-
基金主代码	005850
交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022年12月21日
基金管理人	财通基金管理有限公司
基金托管人	中国光大银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	461,367,005.25份
基金合同存续期	不定期

注：自2022年12月21日起，“财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金”的基金名称变更为“财通沪深300指数增强型证券投资基金”，并正式实施基金转型。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年化跟踪误差不超过8%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的

	<p>基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支持证券。本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合?投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p>
业绩比较基准	<p>沪深300指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%</p>
风险收益特征	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪沪深300指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>

### 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		财通基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	石立平
	联系电话	021-20537888	010-63639180
	电子邮箱	service@ctfund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		400-820-9888	95595
传真		021-68888169	010-63639132
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心

办公地址	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	200120	100033
法定代表人	吴林惠	吴利军

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)
	本期已实现收益
本期利润	1,452,074.30
加权平均基金份额本期利润	0.0035
本期加权平均净值利润率	0.26%
本期基金份额净值增长率	1.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	142,279,685.77

期末可供分配基金份额利润	0.3084
期末基金资产净值	609,700,082.66
期末基金份额净值	1.3215
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	-7.97%

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

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-3.60%	0.47%	-3.14%	0.46%	-0.46%	0.01%
过去三个月	-2.22%	0.70%	-2.03%	0.72%	-0.19%	-0.02%
过去六个月	1.41%	0.91%	0.88%	0.85%	0.53%	0.06%
过去一年	-8.75%	0.85%	-9.38%	0.83%	0.63%	0.02%
自基金合同生效起至今	-7.97%	0.81%	-9.05%	0.81%	1.08%	0.00%

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

(2)本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。

#### 3.2.2 自基金转型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



财通沪深300指数增强型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年12月21日-2024年06月30日)



注：(1)财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效日为2019年1月30日，自2022年12月21日起转型为财通沪深300指数增强型证券投资基金；

(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至报告期末和建仓期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

## §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

财通基金管理有限公司（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立近13年来，公司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获110余项业内权威大奖。

截至2024年6月末，财通基金合计管理规模约1,267.14亿元，其中，公募基金管理规模约921.26亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投研是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为本源，坚守初心、苦练内功，配备了一支资深投研专家团队，纵深一级半、二级市场，持续为投资者创造价值。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱海东	量化投资部副总经理（主持工作）、本基金的基金经理	2019-07-16	-	12年	复旦大学基础数学硕士。历任银河基金管理有限公司量化研究员，平安资产管理有限责任公司研究经理。2019年6月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部基金经理、总经理助理（主持工作），现任量化投资部副总经理（主持工作）、基金经理。
郭欣	本基金的基金经理	2024-03-08	-	10年	上海财经大学概率论与数理统计硕士。历任诺德基金管理有限公司研究员，上海翼丰投资管理有限公司量化研究员。2017年11月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员、投资经理助理、投资经理，现任量化投资部基金经理。

注：(1)基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

#### 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

无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本投资组合为指数增强型开放式基金。本报告期内，本投资组合的主动型投资部分与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金组合采用类行业中性配置，力争控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，力争获得相对业绩基准的长期的超额收益，此外积极参与新股申购，进一步增强组合相对于业绩基准的阿尔法。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通沪深300指数增强基金份额净值为1.3215元，本报告期内，基金份额净值增长率为1.41%，同期业绩比较基准收益率为0.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2024年上半年，国内宏观经济依旧维持弱复苏态势，但动能有所衰弱。3月份开始，信贷脉冲持续走弱，背后一方面是私人部门需求疲软，个人和企业信贷乏力。另一方面，今年财政节奏偏缓，实物工作开展进度偏慢。除此之外，M1和M2剪刀差持续收敛，其中有取消“手工补息”监管的影响，但也有实体微观活力不足的隐忧。从PMI来看，信贷下滑的结果是5、6月份连续两个月略弱于预期的经济扩张幅度。“供强需弱”格局下，今年二季度，国内CPI、PPI整体小幅回升，但“回升”斜率并不陡峭，企业盈利改善较难“一蹴而就”。

海外方面，今年以来市场反复博弈美联储是否会提前降息，但目前美国经济数据依旧不弱，6月份议息会议基本确认美联储将继续维持“Higher for Longer”的货币政策导向。与此同时，近期美国大选风险逐渐进入视野，我们认为这使得短期内美债利率或将继续维持高位。对于国内而言，货币政策在需求走弱的环境下，虽有加码必要，但考虑到内外息差下汇率承压，加之“资金防空转”导向下，我们认为货币政策上进行价格型调控的空间相对有限，结构性货币政策在未来一段时间内或将仍是调控主线。

经济目前仍在持续复苏的脉络上，展望下半年宏观基本面，市场风险与机遇并存。机遇方面，国内政策层面大概率不会“大水漫灌”，而是继续以“固本培元”稳增长为主。我们认为可能的主线有两条：一是专项债发行节奏能否提速，进而形成有效实物工作量，

二是“两会”提出的“新质生产力”相关扶持政策辐射范围能否进一步扩增。除此之外，如果海外增长超预期，或美联储超预期提前降息，海外金融条件将有望进一步放松，从而为国内货币政策提供更多空间。风险方面，下半年海外经济增速的放缓和地缘政治摩擦或将通过出口链给国内增长带来一定压力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》《关于固定收益品种的估值处理标准》《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》《资产管理产品相关会计处理规定》等法律法规、自律规则，公司设立估值委员会并制定估值委员会议事规则。

估值委员会成员由常设委员和非常设委员组成。常设委员为委员会会议必然参会人员，非常设委员根据审议议题邀请参会。常设委员包括总经理、督察长、基金清算部门分管领导、风险管理部负责人、法律合规部负责人、基金清算部负责人；非常设委员为会议议题涉及的投资组合经理和研究人员及其所在部门负责人、分管领导，在每次会议召集时确定。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。如果基金经理认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管人同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序、确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在财通沪深300指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

### 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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《财通沪深300指数增强型证券投资基金2024年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	78,576,655.69	73,880,853.05
结算备付金		5,471,091.88	5,789,936.00

存出保证金		7,214,572.80	3,685,622.40
交易性金融资产	6.4.7.2	514,307,186.82	505,155,681.52
其中：股票投资		511,570,398.96	505,155,681.52
基金投资		-	-
债券投资		2,736,787.86	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,449,997.20	3,302,499.96
应收股利		-	-
应收申购款		4,823,798.56	3,234,123.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		611,843,302.95	595,048,716.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,360,995.02	2,359,608.94
应付管理人报酬		596,866.79	576,231.22
应付托管费		99,477.80	96,038.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	85,880.68	165,000.00
负债合计		2,143,220.29	3,196,878.70
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	461,367,005.25	454,173,798.54
未分配利润	6.4.7.8	148,333,077.41	137,678,039.13
净资产合计		609,700,082.66	591,851,837.67
负债和净资产总计		611,843,302.95	595,048,716.37

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额净值1.3215元，基金份额总额461,367,005.25份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		5,419,379.55	-28,724,932.87
1.利息收入		192,262.20	124,071.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	192,262.20	124,071.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		1,151,097.34	-2,156,638.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,050,030.21	-9,576,414.93
基金投资收益		-	-



债券投资收益	6.4.7.11	5,970.44	-3,091.80
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-6,339,034.75	-2,098,582.06
股利收益	6.4.7.13	6,434,131.44	9,521,449.91
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	6.4.7.14	4,025,478.19	-26,908,607.39
4.汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.15	50,541.82	216,241.46
<b>减：二、营业总支出</b>		3,967,305.25	4,800,542.81
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	3,330,219.42	4,042,255.21
2.托管费	6.4.10.2.2	555,036.59	673,709.21
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7.税金及附加		-	275.83
8.其他费用	6.4.7.17	82,049.24	84,302.56
<b>三、利润总额(亏损总额 以“-”号填列)</b>		1,452,074.30	-33,525,475.68
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-” 号填列)</b>		1,452,074.30	-33,525,475.68
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,452,074.30	-33,525,475.68

### 6.3 净资产变动表

会计主体：财通沪深300指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	454,173,798.54	137,678,039.13	591,851,837.67
二、本期期初净资产	454,173,798.54	137,678,039.13	591,851,837.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	7,193,206.71	10,655,038.28	17,848,244.99
（一）、综合收益总额	-	1,452,074.30	1,452,074.30
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	7,193,206.71	9,202,963.98	16,396,170.69
其中：1.基金申购款	345,765,639.78	122,121,848.67	467,887,488.45
2.基金赎回款	-338,572,433.07	-112,918,884.69	-451,491,317.76
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	461,367,005.25	148,333,077.41	609,700,082.66
项目	上年度可比期间		

	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	120,071,391.10	52,847,959.53	172,919,350.63
二、本期期初净资产	120,071,391.10	52,847,959.53	172,919,350.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	455,307,605.48	205,054,646.32	660,362,251.80
（一）、综合收益总额	-	-33,525,475.68	-33,525,475.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	455,307,605.48	238,580,122.00	693,887,727.48
其中：1.基金申购款	988,372,846.66	503,944,048.42	1,492,316,895.08
2.基金赎回款	-533,065,241.18	-265,363,926.42	-798,429,167.60
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	575,378,996.58	257,902,605.85	833,281,602.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

徐春庭

刘为臻

刘为臻

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

财通沪深300指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），由财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金转型而成，财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金系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[2018]540号文《关于准予财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2019年1月30日生效，首次设立募集规模为458,980,142.88份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》及《财通量化价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自2022年12月21日起转型并更名为财通沪深300指数增强型证券投资基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。其他包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*95%+银行活期存款利率(税后)\*5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦

按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于2012年11月16日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况、自2024年1月1日起至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	46,172,572.07
等于：本金	46,163,902.39
加：应计利息	8,669.68
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	32,404,083.62
等于：本金	32,401,369.18
加：应计利息	2,714.44
减：坏账准备	-
合计	78,576,655.69

注：其他存款为海通证券、广发证券、中信证券保证金账户余额及应计利息合计数。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	531,331,953.19	-	511,570,398.96	-19,761,554.23	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,702,976.27	33,937.86	2,736,787.86	-126.27
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,702,976.27	33,937.86	2,736,787.86	-126.27
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	534,034,929.46	33,937.86	514,307,186.82	-19,761,680.50	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		
	合同/名义金额	公允价值	备注

		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	74,488,206.67	-	-	-
--股指期货	74,488,206.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	74,488,206.67	-	-	-

### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2412	沪深300股指期货2412合约	19.00	19,505,400.00	-164,760.00
IH2412	上证50股指期货2412合约	5.00	3,548,700.00	21,120.00
IM2409	中证1000股指期货2409合约	-5.00	-4,780,200.00	65,600.00
IM2412	中证1000股指期货2412合约	-10.00	-9,378,000.00	-57,013.33
IF2409	沪深300股指期货2409合约	13.00	13,352,040.00	-79,260.00
IF2407	沪深300股指期货2407合约	23.00	23,715,300.00	22,920.00
合计				-191,393.33
减：可抵销期货暂收款				-191,393.33
净额				-

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

### 6.4.7.4 买入返售金融资产



#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	82,049.24
其他应付	3,831.44
合计	85,880.68

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	454,173,798.54	454,173,798.54
本期申购	345,765,639.78	345,765,639.78
本期赎回（以“-”号填列）	-338,572,433.07	-338,572,433.07
本期末	461,367,005.25	461,367,005.25

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	139,184,346.68	-1,506,307.55	137,678,039.13
本期期初	139,184,346.68	-1,506,307.55	137,678,039.13
本期利润	-2,573,403.89	4,025,478.19	1,452,074.30
本期基金份额交易产生的变动数	5,668,742.98	3,534,221.00	9,202,963.98
其中：基金申购款	104,165,793.61	17,956,055.06	122,121,848.67
基金赎回款	-98,497,050.63	-14,421,834.06	-112,918,884.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	142,279,685.77	6,053,391.64	148,333,077.41

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	70,257.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	38,844.45
结算备付金利息收入	82,413.32
其他	746.57
合计	192,262.20

### 6.4.7.10 股票投资收益

#### 6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	1,691,117,022.78

减：卖出股票成本总额	1,687,472,534.11
减：交易费用	2,594,458.46
买卖股票差价收入	1,050,030.21

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	9,826.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,856.34
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	5,970.44

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,037,082.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,903,372.73
减：应计利息总额	135,488.36
减：交易费用	2,077.61
买卖债券差价收入	-3,856.34

##### 6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期末未有债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

##### 6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
期货投资	-6,339,034.75

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,434,131.44
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	6,434,131.44

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	4,558,750.48
——股票投资	4,558,876.75
——债券投资	-126.27
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-533,272.29

——权证投资	-
——期货投资	-533,272.29
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	4,025,478.19

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	49,578.86
其他	888.05
转换费收入	74.91
合计	50,541.82

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	82,049.24

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
财通基金管理有限公司（“财通基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
财通证券股份有限公司（“财通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
中国光大银行股份有限公司（“光大银行”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,330,219.42	4,042,255.21
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,972,295.73	759,334.50
应支付基金管理人的净管理费	1,357,923.69	3,282,920.71

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	555,036.59	673,709.21

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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  
无。

6.4.10.4.2 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  
无。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

**6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大银行	46,172,572.07	70,257.86	31,823,595.78	69,129.81

**6.4.10.7 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在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项的说明。

**6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 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

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



600773	西藏城投	2024-04-08	6个月	非公开发行流通受限	7.58	9.85	175,462	1,330,001.96	1,728,300.70	-
688512	慧智微	2024-06-19	6个月	询价转让流通受限	7.68	7.54	200,000	1,536,000.00	1,508,000.00	-
603520	司太立	2024-06-14	6个月	非公开发行流通受限	9.75	8.80	150,769	1,469,997.75	1,326,767.20	-
300659	中孚信息	2024-03-28	6个月	非公开发行流通受限	14.49	12.12	106,970	1,549,995.30	1,296,476.40	-
000926	福星股份	2024-01-18	6个月	非公开发行流通受限	3.64	3.11	412,088	1,500,000.32	1,281,593.68	-
300612	宣亚国际	2024-03-22	6个月	非公开发行流通受限	14.00	12.19	101,429	1,420,006.00	1,236,419.51	-
688175	高凌信息	2024-06-24	6个月	询价转让流通受限	13.06	13.23	89,048	1,162,966.88	1,178,105.04	-
300565	科信技术	2024-01-25	6个月	非公开发行流通受限	12.56	9.76	109,872	1,379,992.32	1,072,350.72	-
600792	云煤能源	2024-04-26	6个月	非公开发行流通受限	3.65	3.12	328,917	1,200,547.05	1,026,221.04	-
603185	弘元绿能	2024-02-01	6个月	非公开发行流通受限	25.22	16.71	59,080	1,489,997.60	987,226.80	-
300619	金银河	2023-12-28	6个月	非公开发行流通受限	46.16	24.24	29,246	1,349,995.36	708,923.04	-

300619	金银河	2024-06-14	1-6个月(含)	非公开发行流通受限-送股	-	24.24	8,774	-	212,681.76	-
300305	裕兴股份	2024-01-25	6个月	非公开发行流通受限	8.01	5.47	161,049	1,290,002.49	880,938.03	-
688707	振华新材	2024-01-17	6个月	非公开发行流通受限	16.60	9.56	63,253	1,049,999.80	604,698.68	-
003038	鑫铂股份	2024-01-16	6个月	非公开发行流通受限	27.92	14.43	26,952	752,499.84	388,917.36	-
003038	鑫铂股份	2024-05-29	1-6个月(含)	非公开发行流通受限-送股	-	14.43	10,781	-	155,569.83	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月	新股限售	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	认购新发证券	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	新股限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	认购新发证券	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-

301536	星辰科技	2024-03-20	6个月	新股限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	新股限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	新股限售	22.66	15.89	815	18,467.90	12,950.35	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股限售	16.20	15.96	750	12,150.00	11,970.00	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	新股限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股限售	26.00	37.49	267	6,942.00	10,009.83	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
3015	中瑞	2024	6个月	新股限售	21.7	25.2	306	6,64	7,72	-

87	股份	-03-27		售	3	6		9.38	9.56	
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股限售	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	新股限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股限售	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股限售	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股限售	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股限售	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股限售	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001387	雪祺电气	2024-01-0	6个月	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-

		4								
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	15.25	40	-	610.00	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	新股限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。公

司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的法律合规部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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建立了信用风险管理流程，通过对各类投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行股份有限公司，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构海通证券、广发证券和中信证券的证券账户内，按银行同业利率计息，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流

动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注6.4.12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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年06	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
--------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

月30日							
资产							
货币资金	78,576,655.69	-	-	-	-	-	78,576,655.69
结算备付金	2,133.09	-	-	-	-	5,468,958.79	5,471,091.88
存出保证金	7,214,572.80	-	-	-	-	-	7,214,572.80
交易性金融资产	1,624,984.11	-	1,111,803.75	-	-	511,570,398.96	514,307,186.82
应收清算款	-	-	-	-	-	1,449,997.20	1,449,997.20
应收申购款	-	-	-	-	-	4,823,798.56	4,823,798.56
资产总计	87,418,345.69	-	1,111,803.75	-	-	523,313,153.51	611,843,302.95
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,360,995.02	1,360,995.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	596,866.79	596,866.79
应付托管	-	-	-	-	-	99,477.80	99,477.80



费							
其他 负债	-	-	-	-	-	85,880.68	85,880.68
负债 总计	-	-	-	-	-	2,143,220.29	2,143,220.29
利率 敏感 度缺 口	87,418,345.6 9	-	1,111,803.7 5	-	-	521,169,933.2 2	609,700,082.6 6
上年 度末 2023 年12 月31 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	73,880,853.0 5	-	-	-	-	-	73,880,853.05
结算 备付 金	5,789,936.00	-	-	-	-	-	5,789,936.00
存出 保证 金	-	-	-	-	-	3,685,622.40	3,685,622.40
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	505,155,681.5 2	505,155,681.5 2
应收 清算 款	-	-	-	-	-	3,302,499.96	3,302,499.96
应收 申购	-	-	-	-	-	3,234,123.44	3,234,123.44

款							
资产总计	79,670,789.05	-	-	-	-	515,377,927.32	595,048,716.37
负债							
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,359,608.94	2,359,608.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	576,231.22	576,231.22
应付托管费	-	-	-	-	-	96,038.54	96,038.54
其他负债	-	-	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,196,878.70	3,196,878.70
利率敏感度缺口	79,670,789.05	-	-	-	-	512,181,048.62	591,851,837.67

注：表中所示为本基金资产负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。
假设	2.基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。

假设	3.市场即期利率曲线平行变动。		
假设	4.基金组合构成和其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,908.72	-
	市场利率上升25个基点	-1,908.72	-

注:本基金上年度末未持有交易性固定收益类投资(不含可转换债券及可交换债券),因此市场利率的变动对于本基金上年度末资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金可持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债,本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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证券市场的整体波动,以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,以价值投资为核心,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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中,

股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例不低于80%,其中投资于标的指数成份股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	511,570,398.96	83.90	505,155,681.52	85.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	2,736,787.86	0.45	-	-
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	514,307,186.82	84.35	505,155,681.52	85.35

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准增加1%	6,059,992.69	5,558,587.45
	业绩比较基准减少1%	-6,059,992.69	-5,558,587.45

## 6.4.14 公允价值

### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	495,455,557.31	490,572,508.73
第二层次	2,777,813.76	-
第三层次	16,073,815.75	14,583,172.79
合计	514,307,186.82	505,155,681.52

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：无)。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于2024年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§7 投资组合报告**

**7.1 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	511,570,398.96	83.61
	其中：股票	511,570,398.96	83.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,736,787.86	0.45
	其中：债券	2,736,787.86	0.45
	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	84,047,747.57	13.74
8	其他各项资产	13,488,368.56	2.20
9	合计	611,843,302.95	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

**7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,715,730.00	1.43
B	采矿业	28,345,200.67	4.65
C	制造业	212,525,429.96	34.86
D	电力、热力、燃气及水生	20,955,362.84	3.44

	产和供应业		
E	建筑业	14,047,961.40	2.30
F	批发和零售业	344,940.00	0.06
G	交通运输、仓储和邮政业	11,032,029.00	1.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,925,727.32	3.43
J	金融业	116,024,397.20	19.03
K	房地产业	1,956,586.00	0.32
L	租赁和商务服务业	3,435,801.96	0.56
M	科学研究和技术服务业	1,503,700.73	0.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,990,428.72	0.33
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	441,803,295.80	72.46

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,077,803.00	0.18
B	采矿业	3,686,786.00	0.60
C	制造业	44,174,338.56	7.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,717,707.80	0.28
E	建筑业	235,878.00	0.04
F	批发和零售业	2,568,449.84	0.42
G	交通运输、仓储和邮政业	2,850,181.00	0.47

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,691,522.97	0.93
J	金融业	649,652.30	0.11
K	房地产业	4,633,523.38	0.76
L	租赁和商务服务业	1,237,172.71	0.20
M	科学研究和技术服务业	111,850.60	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	1,075,285.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,200.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	55,752.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	69,767,103.16	11.44

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

## 7.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	662,000	27,380,320.00	4.49
2	600519	贵州茅台	14,715	21,592,643.85	3.54
3	000333	美的集团	235,400	15,183,300.00	2.49
4	300750	宁德时代	64,900	11,683,947.00	1.92
5	601601	中国太保	363,900	10,138,254.00	1.66
6	600036	招商银行	283,600	9,696,284.00	1.59



7	000568	泸州老窖	53,916	7,736,406.84	1.27
8	002714	牧原股份	177,400	7,734,640.00	1.27
9	601628	中国人寿	242,100	7,517,205.00	1.23
10	300760	迈瑞医疗	25,717	7,481,332.47	1.23
11	000651	格力电器	182,621	7,162,395.62	1.17
12	601336	新华保险	231,900	6,963,957.00	1.14
13	600919	江苏银行	913,100	6,784,333.00	1.11
14	600900	长江电力	228,200	6,599,544.00	1.08
15	601857	中国石油	612,800	6,324,096.00	1.04
16	600887	伊利股份	235,400	6,082,736.00	1.00
17	601288	农业银行	1,353,900	5,903,004.00	0.97
18	600690	海尔智家	203,400	5,772,492.00	0.95
19	000725	京东方A	1,404,900	5,746,041.00	0.94
20	601166	兴业银行	323,900	5,707,118.00	0.94
21	688111	金山办公	23,736	5,399,940.00	0.89
22	601985	中国核电	472,974	5,041,902.84	0.83
23	600000	浦发银行	606,000	4,987,380.00	0.82
24	600309	万华化学	61,333	4,959,386.38	0.81
25	601169	北京银行	824,500	4,815,080.00	0.79
26	600660	福耀玻璃	98,000	4,694,200.00	0.77
27	600050	中国联通	967,300	4,546,310.00	0.75
28	000338	潍柴动力	278,200	4,517,968.00	0.74
29	601668	中国建筑	843,900	4,481,109.00	0.73
30	600011	华能国际	463,400	4,457,908.00	0.73
31	601899	紫金矿业	247,499	4,348,557.43	0.71
32	600028	中国石化	687,800	4,346,896.00	0.71
33	601088	中国神华	95,200	4,224,024.00	0.69
34	601728	中国电信	683,900	4,205,985.00	0.69
35	600019	宝钢股份	631,200	4,197,480.00	0.69
36	000858	五粮液	31,210	3,996,128.40	0.66
37	603993	洛阳钼业	465,100	3,953,350.00	0.65

38	000100	TCL科技	887,100	3,832,272.00	0.63
39	601800	中国交建	413,500	3,696,690.00	0.61
40	600031	三一重工	221,681	3,657,736.50	0.60
41	601919	中远海控	233,500	3,616,915.00	0.59
42	000786	北新建材	120,300	3,568,098.00	0.59
43	002601	龙佰集团	190,600	3,539,442.00	0.58
44	000157	中联重科	455,800	3,500,544.00	0.57
45	603501	韦尔股份	31,545	3,134,626.65	0.51
46	300274	阳光电源	48,080	2,982,402.40	0.49
47	600941	中国移动	27,400	2,945,500.00	0.48
48	601319	中国人保	563,481	2,901,927.15	0.48
49	300014	亿纬锂能	70,600	2,818,352.00	0.46
50	600015	华夏银行	432,462	2,767,756.80	0.45
51	600183	生益科技	126,000	2,653,560.00	0.44
52	688036	传音控股	34,649	2,652,034.46	0.43
53	002415	海康威视	84,900	2,624,259.00	0.43
54	600875	东方电气	142,100	2,621,745.00	0.43
55	601916	浙商银行	943,800	2,604,888.00	0.43
56	000999	华润三九	60,180	2,562,464.40	0.42
57	600886	国投电力	138,700	2,529,888.00	0.41
58	601877	正泰电器	131,000	2,496,860.00	0.41
59	601888	中国中免	39,646	2,477,478.54	0.41
60	601989	中国重工	497,500	2,452,675.00	0.40
61	002594	比亚迪	9,800	2,452,450.00	0.40
62	601658	邮储银行	466,800	2,366,676.00	0.39
63	603806	福斯特	159,160	2,339,652.00	0.38
64	601328	交通银行	308,500	2,304,495.00	0.38
65	002271	东方雨虹	184,540	2,277,223.60	0.37
66	001965	招商公路	191,000	2,265,260.00	0.37
67	000596	古井贡酒	10,700	2,258,449.00	0.37
68	600332	白云山	73,100	2,144,023.00	0.35

69	601633	长城汽车	82,300	2,082,190.00	0.34
70	601390	中国中铁	316,000	2,060,320.00	0.34
71	002555	三七互娱	156,200	2,038,410.00	0.33
72	601225	陕西煤业	78,100	2,012,637.00	0.33
73	601766	中国中车	265,867	1,996,661.17	0.33
74	300015	爱尔眼科	192,871	1,990,428.72	0.33
75	002001	新和成	95,860	1,840,512.00	0.30
76	600016	民生银行	479,900	1,818,821.00	0.30
77	601229	上海银行	247,600	1,797,576.00	0.29
78	601012	隆基绿能	127,943	1,793,760.86	0.29
79	600362	江西铜业	73,600	1,742,848.00	0.29
80	002475	立讯精密	44,115	1,734,160.65	0.28
81	601009	南京银行	161,500	1,677,985.00	0.28
82	601398	工商银行	287,100	1,636,470.00	0.27
83	000001	平安银行	158,000	1,603,700.00	0.26
84	601988	中国银行	337,200	1,557,864.00	0.26
85	002352	顺丰控股	43,400	1,548,946.00	0.25
86	601138	工业富联	56,000	1,534,400.00	0.25
87	300122	智飞生物	50,300	1,409,909.00	0.23
88	300308	中际旭创	10,220	1,409,133.60	0.23
89	600089	特变电工	101,060	1,401,702.20	0.23
90	002371	北方华创	4,355	1,393,120.95	0.23
91	600938	中国海油	33,700	1,112,100.00	0.18
92	601006	大秦铁路	149,600	1,071,136.00	0.18
93	600989	宝丰能源	58,700	1,017,271.00	0.17
94	300498	温氏股份	49,500	981,090.00	0.16
95	600176	中国巨石	88,171	974,289.55	0.16
96	000538	云南白药	18,900	966,735.00	0.16
97	002142	宁波银行	42,800	944,168.00	0.15
98	600018	上港集团	161,200	931,736.00	0.15
99	300124	汇川技术	17,636	904,726.80	0.15

100	600188	兖矿能源	38,559	876,446.07	0.14
101	601669	中国电建	155,500	869,245.00	0.14
102	600104	上汽集团	62,600	867,636.00	0.14
103	002311	海大集团	18,400	865,720.00	0.14
104	600585	海螺水泥	36,100	851,599.00	0.14
105	002916	深南电路	8,000	846,160.00	0.14
106	600219	南山铝业	216,700	825,627.00	0.14
107	600795	国电电力	136,800	819,432.00	0.13
108	000895	双汇发展	34,201	812,957.77	0.13
109	601186	中国铁建	93,600	802,152.00	0.13
110	002027	分众传媒	130,957	793,599.42	0.13
111	000063	中兴通讯	27,800	777,566.00	0.13
112	600048	保利发展	86,400	756,864.00	0.12
113	600346	恒力石化	54,000	753,300.00	0.12
114	603259	药明康德	19,167	751,154.73	0.12
115	600893	航发动力	19,900	727,345.00	0.12
116	688008	澜起科技	12,537	716,614.92	0.12
117	601117	中国化学	85,400	703,696.00	0.12
118	600600	青岛啤酒	9,544	694,516.88	0.11
119	600926	杭州银行	52,900	690,345.00	0.11
120	600438	通威股份	35,500	678,405.00	0.11
121	300433	蓝思科技	36,500	666,125.00	0.11
122	300628	亿联网络	18,000	661,860.00	0.11
123	601618	中国中冶	203,100	629,610.00	0.10
124	001979	招商蛇口	69,900	614,421.00	0.10
125	603369	今世缘	12,636	583,783.20	0.10
126	000977	浪潮信息	15,400	560,098.00	0.09
127	000938	紫光股份	24,900	556,515.00	0.09
128	000002	万科A	77,300	535,689.00	0.09
129	601868	中国能建	249,300	528,516.00	0.09
130	600406	国电南瑞	19,900	496,704.00	0.08

131	601111	中国国航	67,300	496,674.00	0.08
132	600009	上海机场	14,900	480,525.00	0.08
133	601838	成都银行	31,300	475,447.00	0.08
134	601865	福莱特	23,300	468,330.00	0.08
135	002230	科大讯飞	10,500	450,975.00	0.07
136	002493	荣盛石化	46,000	444,360.00	0.07
137	300347	泰格医药	9,100	442,260.00	0.07
138	603019	中科曙光	10,600	439,900.00	0.07
139	600111	北方稀土	24,900	428,280.00	0.07
140	002074	国轩高科	21,636	414,329.40	0.07
141	600196	复星医药	18,400	407,376.00	0.07
142	000625	长安汽车	29,500	396,185.00	0.06
143	002304	洋河股份	4,600	371,404.00	0.06
144	600489	中金黄金	24,500	362,600.00	0.06
145	600741	华域汽车	21,900	358,722.00	0.06
146	002050	三花智控	18,800	358,704.00	0.06
147	300957	贝泰妮	7,400	357,568.00	0.06
148	000425	徐工机械	49,200	351,780.00	0.06
149	601939	建设银行	46,510	344,174.00	0.06
150	002841	视源股份	10,800	318,924.00	0.05
151	601699	潞安环能	17,300	313,649.00	0.05
152	300759	康龙化成	16,700	310,286.00	0.05
153	600803	新奥股份	14,700	305,760.00	0.05
154	002179	中航光电	7,821	297,589.05	0.05
155	600674	川投能源	15,700	294,375.00	0.05
156	600025	华能水电	26,900	289,982.00	0.05
157	000408	藏格矿业	11,900	286,433.00	0.05
158	600039	四川路桥	35,060	276,623.40	0.05
159	300782	卓胜微	3,540	275,199.60	0.05
160	600010	包钢股份	192,700	269,780.00	0.04
161	002812	恩捷股份	8,500	269,025.00	0.04

162	600588	用友网络	26,900	269,000.00	0.04
163	000807	云铝股份	18,800	253,988.00	0.04
164	003816	中国广核	54,800	253,724.00	0.04
165	300316	晶盛机电	8,700	249,951.00	0.04
166	600760	中航沈飞	6,200	248,620.00	0.04
167	002920	德赛西威	2,700	235,143.00	0.04
168	300896	爱美客	1,360	234,056.00	0.04
169	600233	圆通速递	14,800	231,620.00	0.04
170	605499	东鹏饮料	1,000	215,750.00	0.04
171	002466	天齐锂业	7,000	209,370.00	0.03
172	300832	新产业	3,000	202,320.00	0.03
173	300418	昆仑万维	6,200	199,888.00	0.03
174	600023	浙能电力	27,900	198,369.00	0.03
175	600026	中远海能	12,700	198,247.00	0.03
176	002236	大华股份	12,600	194,796.00	0.03
177	600845	宝信软件	6,052	193,240.36	0.03
178	601872	招商轮船	22,600	190,970.00	0.03
179	601689	拓普集团	3,500	187,635.00	0.03
180	000983	山西焦煤	18,107	186,683.17	0.03
181	000963	华东医药	6,700	186,327.00	0.03
182	000876	新希望	19,900	181,886.00	0.03
183	002938	鹏鼎控股	4,500	178,920.00	0.03
184	600415	小商品城	22,200	164,724.00	0.03
185	600027	华电国际	23,700	164,478.00	0.03
186	601607	上海医药	8,300	158,613.00	0.03
187	601898	中煤能源	11,800	147,264.00	0.02
188	300751	迈为股份	1,200	143,376.00	0.02
189	300999	金龙鱼	5,100	139,485.00	0.02
190	605117	德业股份	1,820	135,298.80	0.02
191	601808	中海油服	7,800	134,160.00	0.02
192	688187	时代电气	2,590	127,894.20	0.02

193	000733	振华科技	2,900	120,437.00	0.02
194	688599	天合光能	7,110	120,301.20	0.02
195	688009	中国通号	19,742	118,452.00	0.02
196	002736	国信证券	12,900	112,101.00	0.02
197	000708	中信特钢	8,007	108,654.99	0.02
198	600061	国投资本	17,900	101,135.00	0.02
199	603899	晨光股份	3,200	100,096.00	0.02
200	000617	中油资本	17,800	98,256.00	0.02
201	300413	芒果超媒	4,700	98,230.00	0.02
202	300979	华利集团	1,400	85,190.00	0.01
203	300442	润泽科技	3,400	81,430.00	0.01
204	603833	欧派家居	1,500	80,340.00	0.01
205	688082	盛美上海	801	67,692.51	0.01
206	601688	华泰证券	5,400	66,906.00	0.01
207	601211	国泰君安	4,900	66,395.00	0.01
208	000776	广发证券	4,400	53,548.00	0.01
209	601236	红塔证券	7,900	50,718.00	0.01
210	600515	海南机场	15,800	49,612.00	0.01
211	000166	申万宏源	10,400	44,824.00	0.01
212	600958	东方证券	5,400	41,040.00	0.01
213	600276	恒瑞医药	400	15,384.00	0.00
214	688012	中微公司	63	8,899.38	0.00
215	688981	中芯国际	179	8,251.90	0.00
216	688396	华润微	169	6,327.36	0.00
217	688363	华熙生物	63	3,563.91	0.00
218	600030	中信证券	175	3,190.25	0.00
219	600547	山东黄金	100	2,738.00	0.00
220	600426	华鲁恒升	90	2,397.60	0.00
221	688126	沪硅产业	162	2,237.22	0.00
222	688303	大全能源	78	1,590.42	0.00
223	300059	东方财富	100	1,056.00	0.00

224	688223	晶科能源	93	660.30	0.00
225	002410	广联达	12	114.96	0.00

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

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	002340	格林美	386,200	2,460,094.00	0.40
2	601717	郑煤机	162,700	2,407,960.00	0.39
3	300679	电连技术	58,200	2,341,386.00	0.38
4	600285	羚锐制药	91,200	2,207,952.00	0.36
5	002128	电投能源	103,700	2,188,070.00	0.36
6	688188	柏楚电子	11,667	2,153,144.85	0.35
7	688516	奥特维	48,579	2,031,087.99	0.33
8	002517	恺英网络	187,900	1,794,445.00	0.29
9	600773	西藏城投	175,562	1,729,332.70	0.28
10	002215	诺普信	231,400	1,723,930.00	0.28
11	603883	老百姓	88,160	1,618,617.60	0.27
12	688512	慧智微	200,000	1,508,000.00	0.25
13	600035	楚天高速	325,700	1,397,253.00	0.23
14	603983	丸美股份	50,600	1,393,018.00	0.23
15	603520	司太立	150,769	1,326,767.20	0.22
16	300659	中孚信息	106,970	1,296,476.40	0.21
17	000926	福星股份	412,088	1,281,593.68	0.21
18	002984	森麒麟	51,900	1,250,271.00	0.21
19	300612	宣亚国际	101,429	1,236,419.51	0.20
20	688175	高凌信息	89,048	1,178,105.04	0.19
21	000930	中粮科技	220,800	1,110,624.00	0.18
22	601001	晋控煤业	66,900	1,105,188.00	0.18
23	300565	科信技术	109,872	1,072,350.72	0.18



24	600792	云煤能源	328,917	1,026,221.04	0.17
25	603185	弘元绿能	59,080	987,226.80	0.16
26	601369	陕鼓动力	117,000	938,340.00	0.15
27	300619	金银河	38,020	921,604.80	0.15
28	000560	我爱我家	414,800	920,856.00	0.15
29	300305	裕兴股份	161,049	880,938.03	0.14
30	603088	宁波精达	110,500	832,065.00	0.14
31	603579	荣泰健康	53,150	821,699.00	0.13
32	000544	中原环保	101,000	794,870.00	0.13
33	688578	艾力斯	12,249	780,751.26	0.13
34	688050	爱博医疗	10,566	774,699.12	0.13
35	688408	中信博	8,377	771,354.16	0.13
36	003006	百亚股份	32,400	767,880.00	0.13
37	002139	拓邦股份	68,900	731,718.00	0.12
38	600998	九州通	148,623	725,280.24	0.12
39	002847	盐津铺子	16,660	712,548.20	0.12
40	603786	科博达	11,100	712,065.00	0.12
41	600315	上海家化	39,800	707,644.00	0.12
42	300761	立华股份	30,900	699,576.00	0.11
43	600642	申能股份	78,400	692,272.00	0.11
44	603348	文灿股份	24,500	678,405.00	0.11
45	002928	华夏航空	105,000	665,700.00	0.11
46	003021	兆威机电	14,200	655,330.00	0.11
47	601000	唐山港	137,200	644,840.00	0.11
48	002020	京新药业	60,900	637,623.00	0.10
49	688707	振华新材	63,453	606,646.68	0.10
50	600475	华光环能	64,900	565,279.00	0.09
51	600582	天地科技	79,500	547,755.00	0.09
52	003038	鑫铂股份	37,733	544,487.19	0.09
53	002422	科伦药业	16,808	509,786.64	0.08
54	603568	伟明环保	24,200	498,036.00	0.08

55	688150	莱特光电	25,412	492,992.80	0.08
56	688029	南微医学	7,939	488,724.84	0.08
57	600007	中国国贸	18,000	395,280.00	0.06
58	002202	金风科技	57,500	386,400.00	0.06
59	300972	万辰集团	17,900	378,227.00	0.06
60	300383	光环新网	42,000	354,900.00	0.06
61	000517	荣安地产	109,400	293,192.00	0.05
62	300394	天孚通信	2,965	262,165.30	0.04
63	601128	常熟银行	32,390	245,192.30	0.04
64	600398	海澜之家	26,500	244,860.00	0.04
65	603025	大豪科技	17,400	240,468.00	0.04
66	300866	安克创新	3,300	234,993.00	0.04
67	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.04
68	600820	隧道股份	35,400	231,162.00	0.04
69	000598	兴蓉环境	30,000	225,600.00	0.04
70	002831	裕同科技	8,800	225,192.00	0.04
71	603606	东方电缆	4,600	224,526.00	0.04
72	600737	中粮糖业	23,300	223,447.00	0.04
73	603596	伯特利	5,700	221,730.00	0.04
74	600655	豫园股份	42,300	217,845.00	0.04
75	000563	陕国投A	78,500	215,875.00	0.04
76	600566	济川药业	6,700	212,457.00	0.03
77	000738	航发控制	10,000	200,700.00	0.03
78	603338	浙江鼎力	3,300	199,386.00	0.03
79	000937	冀中能源	29,400	196,980.00	0.03
80	600583	海油工程	32,800	193,848.00	0.03
81	600901	江苏金租	36,400	183,820.00	0.03
82	600201	生物股份	25,200	181,692.00	0.03
83	688510	航亚科技	9,655	177,748.55	0.03
84	000921	海信家电	4,400	141,856.00	0.02
85	002053	云南能投	11,700	141,453.00	0.02

86	301308	江波龙	1,400	132,636.00	0.02
87	601598	中国外运	20,100	113,163.00	0.02
88	300012	华测检测	10,700	107,642.00	0.02
89	002372	伟星新材	6,800	104,856.00	0.02
90	603816	顾家家居	2,700	87,183.00	0.01
91	601019	山东出版	4,500	53,190.00	0.01
92	600765	中航重机	2,600	53,040.00	0.01
93	600612	老凤祥	900	52,371.00	0.01
94	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.01
95	600603	广汇物流	5,200	26,208.00	0.00
96	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
97	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
98	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
99	688018	乐鑫科技	189	18,650.52	0.00
100	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
101	002572	索菲亚	900	13,797.00	0.00
102	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
103	688639	华恒生物	178	13,597.42	0.00
104	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
105	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
106	688584	上海合晶	815	12,950.35	0.00
107	601033	永兴股份	750	11,970.00	0.00
108	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
109	688278	特宝生物	192	10,281.60	0.00
110	603341	龙旗科技	267	10,009.83	0.00
111	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
112	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
113	002244	滨江集团	1,200	8,712.00	0.00
114	688486	龙迅股份	147	8,423.10	0.00
115	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
116	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00

117	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
118	688058	宝兰德	356	7,415.48	0.00
119	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
120	301526	国际复材	1,955	6,510.15	0.00
121	688100	威胜信息	167	6,371.05	0.00
122	688626	翔宇医疗	195	6,189.30	0.00
123	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
124	688390	固德威	101	5,668.12	0.00
125	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
126	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
127	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
128	688551	科威尔	151	4,756.50	0.00
129	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
130	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
131	603855	华荣股份	200	4,422.00	0.00
132	688131	皓元医药	220	4,208.60	0.00
133	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
134	688819	天能股份	167	3,984.62	0.00
135	688612	威迈斯	148	3,932.36	0.00
136	603939	益丰药房	160	3,928.00	0.00
137	688080	映翰通	125	3,791.25	0.00
138	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
139	002833	弘亚数控	200	3,648.00	0.00
140	688687	凯因科技	142	3,622.42	0.00
141	600116	三峡水利	500	3,450.00	0.00
142	603290	斯达半导	40	3,444.40	0.00
143	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
144	002690	美亚光电	200	3,300.00	0.00
145	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
146	300681	英搏尔	250	3,260.00	0.00
147	300638	广和通	190	3,249.00	0.00

148	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
149	000932	华菱钢铁	700	3,101.00	0.00
150	688636	智明达	136	3,100.80	0.00
151	001308	康冠科技	130	2,925.00	0.00
152	300926	博俊科技	145	2,902.90	0.00
153	002790	瑞尔特	312	2,817.36	0.00
154	601155	新城控股	300	2,661.00	0.00
155	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
156	002536	飞龙股份	270	2,570.40	0.00
157	603466	风语筑	300	2,562.00	0.00
158	001358	兴欣新材	122	2,503.44	0.00
159	688389	普门科技	153	2,487.78	0.00
160	688439	振华风光	37	2,458.65	0.00
161	600774	汉商集团	300	2,424.00	0.00
162	688556	高测股份	203	2,413.67	0.00
163	688208	道通科技	98	2,365.72	0.00
164	002955	鸿合科技	100	2,338.00	0.00
165	600835	上海机电	200	2,302.00	0.00
166	688777	中控技术	61	2,299.70	0.00
167	688475	萤石网络	67	2,285.37	0.00
168	301101	明月镜片	100	2,234.00	0.00
169	002430	杭氧股份	100	2,225.00	0.00
170	688112	鼎阳科技	81	2,186.19	0.00
171	688589	力合微	84	2,117.64	0.00
172	301578	辰奕智能	53	2,097.21	0.00
173	688147	微导纳米	82	2,041.80	0.00
174	300494	盛天网络	200	2,010.00	0.00
175	600782	新钢股份	600	1,992.00	0.00
176	688289	圣湘生物	113	1,986.54	0.00
177	603610	麒盛科技	200	1,976.00	0.00
178	301017	漱玉平民	200	1,968.00	0.00

179	002011	盾安环境	200	1,966.00	0.00
180	000627	天茂集团	1,100	1,925.00	0.00
181	603757	大元泵业	100	1,910.00	0.00
182	688678	福立旺	176	1,906.08	0.00
183	600208	新湖中宝	1,200	1,896.00	0.00
184	688719	爱科赛博	72	1,877.04	0.00
185	002895	川恒股份	100	1,831.00	0.00
186	000762	西藏矿业	100	1,808.00	0.00
187	300457	赢合科技	100	1,783.00	0.00
188	600197	伊力特	100	1,781.00	0.00
189	600705	中航产融	800	1,776.00	0.00
190	300685	艾德生物	100	1,764.00	0.00
191	603518	锦泓集团	200	1,760.00	0.00
192	301235	华康医疗	100	1,735.00	0.00
193	688002	睿创微纳	61	1,706.17	0.00
194	002959	小熊电器	35	1,683.85	0.00
195	601333	广深铁路	500	1,620.00	0.00
196	601231	环旭电子	100	1,605.00	0.00
197	605167	利柏特	200	1,562.00	0.00
198	688276	百克生物	55	1,560.35	0.00
199	688569	铁科轨道	75	1,550.25	0.00
200	300729	乐歌股份	100	1,549.00	0.00
201	002495	佳隆股份	1,100	1,518.00	0.00
202	600483	福能股份	130	1,515.80	0.00
203	002820	桂发祥	200	1,478.00	0.00
204	600012	皖通高速	100	1,397.00	0.00
205	300036	超图软件	100	1,396.00	0.00
206	003011	海象新材	100	1,341.00	0.00
207	688580	伟思医疗	50	1,338.00	0.00
208	603027	千禾味业	100	1,330.00	0.00
209	002085	万丰奥威	100	1,324.00	0.00

210	002396	星网锐捷	100	1,321.00	0.00
211	002030	达安基因	260	1,300.00	0.00
212	603215	比依股份	100	1,279.00	0.00
213	300532	今天国际	100	1,229.00	0.00
214	002507	涪陵榨菜	100	1,225.00	0.00
215	300244	迪安诊断	100	1,200.00	0.00
216	603031	安孚科技	53	1,196.74	0.00
217	688088	虹软科技	41	1,183.26	0.00
218	603737	三棵树	32	1,160.64	0.00
219	688106	金宏气体	66	1,156.32	0.00
220	600073	光明肉业	200	1,102.00	0.00
221	600908	无锡银行	200	1,064.00	0.00
222	000957	中通客车	100	1,052.00	0.00
223	001318	阳光乳业	100	1,029.00	0.00
224	002658	雪迪龙	200	1,026.00	0.00
225	002478	常宝股份	200	996.00	0.00
226	002116	中国海诚	100	931.00	0.00
227	002497	雅化集团	100	892.00	0.00
228	002258	利尔化学	109	874.18	0.00
229	300682	朗新集团	100	851.00	0.00
230	603708	家家悦	100	811.00	0.00
231	601179	中国西电	100	804.00	0.00
232	600826	兰生股份	140	753.20	0.00
233	601886	江河集团	100	488.00	0.00
234	688586	江航装备	52	483.60	0.00
235	603421	鼎信通讯	100	446.00	0.00
236	002026	山东威达	50	415.00	0.00
237	603002	宏昌电子	79	370.51	0.00
238	688076	诺泰生物	4	313.12	0.00
239	688200	华峰测控	3	275.25	0.00
240	002442	龙星化工	61	262.30	0.00

241	600022	山东钢铁	100	122.00	0.00
242	601096	宏盛华源	18	73.62	0.00
243	688698	伟创电气	1	26.97	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	601318	中国平安	43,875,895.00	7.41
2	600519	贵州茅台	31,371,060.00	5.30
3	601899	紫金矿业	27,386,512.00	4.63
4	000651	格力电器	22,770,341.02	3.85
5	000333	美的集团	22,348,381.37	3.78
6	601336	新华保险	19,502,450.76	3.30
7	002714	牧原股份	18,816,454.00	3.18
8	601601	中国太保	18,428,466.00	3.11
9	300750	宁德时代	18,184,692.00	3.07
10	600036	招商银行	16,279,158.00	2.75
11	601985	中国核电	14,998,869.50	2.53
12	600919	江苏银行	13,073,806.00	2.21
13	300760	迈瑞医疗	12,417,548.10	2.10
14	600028	中国石化	12,416,520.00	2.10
15	600887	伊利股份	12,219,705.00	2.06
16	601857	中国石油	12,189,911.64	2.06
17	601088	中国神华	12,089,179.00	2.04
18	600690	海尔智家	11,786,244.00	1.99
19	000568	泸州老窖	10,999,025.33	1.86
20	601319	中国人保	10,733,469.00	1.81

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



### 7.4.2 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	000651	格力电器	29,896,885.00	5.05
2	601318	中国平安	28,150,252.44	4.76
3	601899	紫金矿业	26,517,042.00	4.48
4	600036	招商银行	24,145,296.00	4.08
5	000333	美的集团	21,274,984.00	3.59
6	300750	宁德时代	16,217,447.00	2.74
7	300760	迈瑞医疗	15,556,113.00	2.63
8	600690	海尔智家	15,359,390.00	2.60
9	600519	贵州茅台	15,343,025.00	2.59
10	601985	中国核电	14,018,694.00	2.37
11	600887	伊利股份	13,874,048.00	2.34
12	600028	中国石化	13,146,342.40	2.22
13	002714	牧原股份	12,937,838.10	2.19
14	601336	新华保险	12,829,202.00	2.17
15	601857	中国石油	12,506,475.00	2.11
16	601688	华泰证券	11,904,131.00	2.01
17	601390	中国中铁	11,659,195.72	1.97
18	601088	中国神华	11,567,668.37	1.95
19	600025	华能水电	11,077,581.00	1.87
20	601601	中国太保	10,870,628.99	1.84

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 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	1,689,328,374.80
卖出股票收入（成交）总额	1,691,117,022.78

注：本表“买入股票成本（成交）总额”，“卖出股票收入（成交）总额”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。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,736,787.86	0.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,736,787.86	0.45

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23国债16	16,000	1,624,984.11	0.27
2	019733	24国债02	11,000	1,111,803.75	0.18

### 7.7 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。

### 7.8 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。

### 7.9 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。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金暂不投资国债期货。

### 7.11.2 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合约。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 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	7,214,572.80
2	应收清算款	1,449,997.20
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,823,798.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,488,368.56

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资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。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
12,382	37,261.11	76,506,793.17	16.58%	384,860,212.08	83.42%

### 8.2 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	227,798.64	0.0494%

### 8.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年12月21日)基金份额总额	119,111,800.66
本报告期期初基金份额总额	454,173,798.54
本报告期基金总申购份额	345,765,639.78
减：本报告期基金总赎回份额	338,572,433.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	461,367,005.25

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。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

- 1、本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
海通证券	2	834,385,376.16	24.82%	690,165.01	44.96%	-
广发证券	3	1,251,904,367.73	37.24%	414,518.45	27.01%	-
中信证券	3	1,275,189,202.79	37.94%	430,273.15	28.03%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

3、此处的佣金指基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 10.7.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
-----	------	--------	------	------

称	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
海通证 券	10,203,932. 00	38.49%	-	-	-	-	-	-
广发证 券	11,702,192. 00	44.15%	-	-	-	-	-	-
中信证 券	4,601,819.0 0	17.36%	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-18
2	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-19
3	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-20
4	财通沪深300指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-20
5	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-27
6	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-03
7	关于华融融达期货股份有限	中国证监会规定媒介	2024-02-03

	公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告		
8	关于和合期货有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-29
9	财通沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2024年03月09日公告）	中国证监会规定媒介	2024-03-09
10	财通沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024年03月09日公告）	中国证监会规定媒介	2024-03-09
11	财通沪深300指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2024-03-09
12	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-26
13	关于北京增财基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
14	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
15	财通沪深300指数增强型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
16	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-10
17	关于深圳新华信通基金销售有限公司终止代理销售财通	中国证监会规定媒介	2024-04-13



	基金管理有限公司旗下基金的公告		
18	财通沪深300指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-20
19	关于天相投资顾问有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-26
20	关于民商基金销售（上海）有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-27
21	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-30
22	关于深圳富济基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-05-17
23	财通基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-07
24	关于江苏天鼎证券投资咨询有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-14
25	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-18
26	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-21

27	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-26
28	财通沪深300指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024年06月29日公告）	中国证监会规定媒介	2024-06-29
29	财通沪深300指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2024年06月29日公告）	中国证监会规定媒介	2024-06-29

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、财通沪深300指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通沪深300指数增强型证券投资基金托管协议；
- 4、财通沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：[www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)

财通基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十一日