

博时量化多策略股票型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：博时基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	52
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	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	102
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	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名的前五名权证投资明细	111
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	111
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的情况	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	114
11.4 基金投资策略的改变	114
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	115
§12 影响投资者决策的其他重要信息	118
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	118
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	119
§13 备查文件目录	119
13.1 备查文件目录	119
13.2 存放地点	119
13.3 查阅方式	119

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	博时量化多策略股票型证券投资基金	
基金简称	博时量化多策略股票	
基金主代码	005635	
交易代码	005635	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 3 日	
基金管理人	博时基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	297,089,166.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
下属分级基金的交易代码	005635	005636
报告期末下属分级基金的份额总额	257,240,020.12 份	39,849,145.88 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。
投资策略	<p>1、量化选股策略</p> <p>(1) A 股投资策略：本基金的选股策略以量化多策略体系为基础，涵盖因子打分、事件驱动、量价特征等多种投资逻辑。其中因子打分策略主要包括价值、成长、质量、市场情绪和分析师预期等因子，事件策略包括高管增持、股权激励、定向增发等，各个策略自成体系，具有各自的投资逻辑和风险特征</p> <p>(2) 港股投资策略： 本基金将充分挖掘内地与香港股票市场交易互联互通、资金双向流动机制下港股市场的投资机会。</p> <p>2、其他投资策略： 存托凭证投资策略、债券投资策略、权证投资策略、资产支持证券的投资策略、金融衍生品投资策略。</p>
业绩比较基准	中证全指指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%
风险收益特征	本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于高风险/收益的基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	博时基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	吴曼	张姗
	联系电话	0755-83169999	400-61-95555
	电子邮箱	service@bosera.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105568	400-61-95555
传真		0755-83195140	0755-83195201
注册地址		深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		广东省深圳市福田区益田路 5999 号基金大厦 21 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		518040	518040
法定代表人		江向阳	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.bosera.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
注册登记机构	博时基金管理有限公司	北京市东城区建国门内大街 8 号中粮广场 C 座 3 层 301

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
本期已实现收益	33,296,241.82	2,137,776.43	-44,429,298.54	-10,870,001.32	-22,858,296.00	-1,371,958.84
本期利润	23,159,923.83	522,013.89	-37,043,692.90	-11,671,741.92	-23,552,371.98	-1,480,616.88
加权平均基金份额本期利润	0.0496	0.0080	-0.1471	-0.2350	-0.1800	-0.1729
本期加权平均净值利润率	4.20%	0.70%	-10.24%	-16.77%	-12.15%	-12.03%

本期基金份额净值增长率	6.12%	5.28%	-5.35%	-6.10%	-10.98%	-11.71%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
期末可供分配利润	65,581,781.28	8,452,484.09	86,021,154.86	8,814,984.41	65,419,680.50	4,389,286.06
期末可供分配基金份额利润	0.2549	0.2121	0.1706	0.1396	0.4405	0.3864
期末基金资产净值	322,821,801.40	48,301,629.97	596,355,066.02	72,708,984.71	216,526,714.19	15,934,969.36
期末基金份额净值	1.2549	1.2121	1.1825	1.1513	1.4579	1.4029
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金份额累计净值增长率	46.44%	38.69%	37.99%	31.73%	45.79%	40.29%

注：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。

期末可供分配利润是指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。

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。

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

1. 博时量化多策略股票 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-1.69%	2.01%	0.72%	1.52%	-2.41%	0.49%
过去六个月	9.34%	1.82%	15.88%	1.47%	-6.54%	0.35%
过去一年	6.12%	1.46%	10.32%	1.30%	-4.20%	0.16%
过去三年	-10.58%	1.14%	-13.38%	1.12%	2.80%	0.02%
过去五年	38.61%	1.14%	4.23%	1.11%	34.38%	0.03%
自基金合同生效起至今	46.44%	1.17%	2.97%	1.11%	43.47%	0.06%

2. 博时量化多策略股票 C：

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

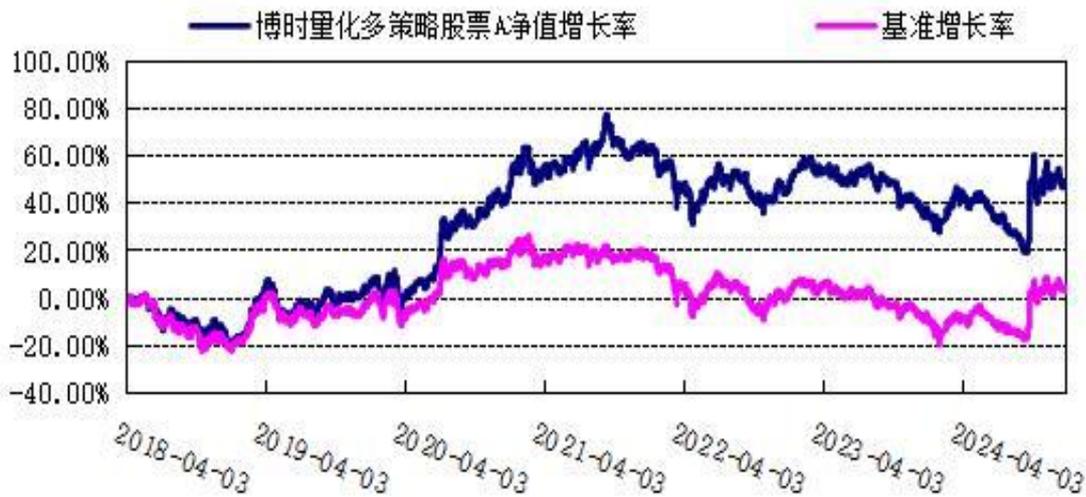
	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-1.89%	2.01%	0.72%	1.52%	-2.61%	0.49%
过去六个月	8.90%	1.82%	15.88%	1.47%	-6.98%	0.35%
过去一年	5.28%	1.46%	10.32%	1.30%	-5.04%	0.16%
过去三年	-12.72%	1.14%	-13.38%	1.12%	0.66%	0.02%
过去五年	33.13%	1.14%	4.23%	1.11%	28.90%	0.03%
自基金合同生效起至今	38.69%	1.17%	2.97%	1.11%	35.72%	0.06%

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

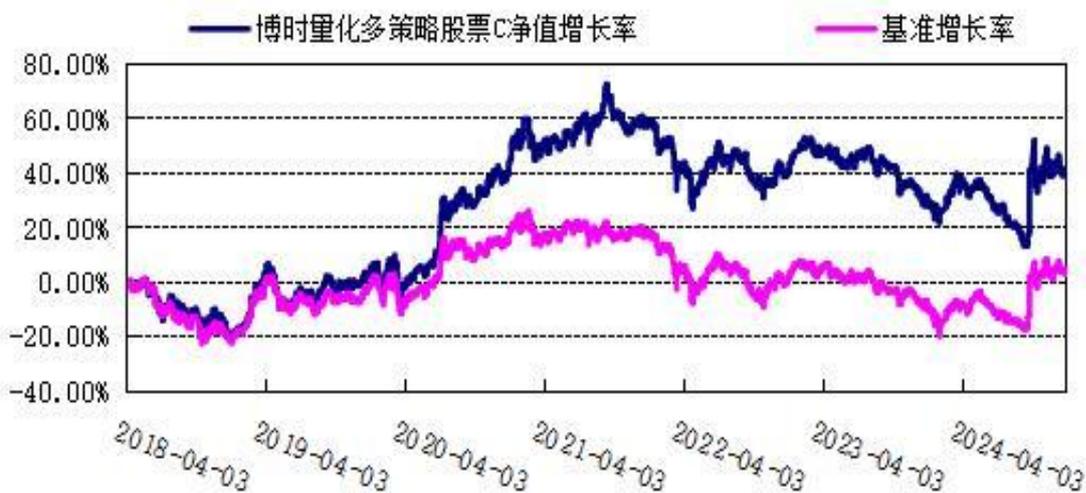
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 4 月 3 日至 2024 年 12 月 31 日)

1、博时量化多策略股票 A



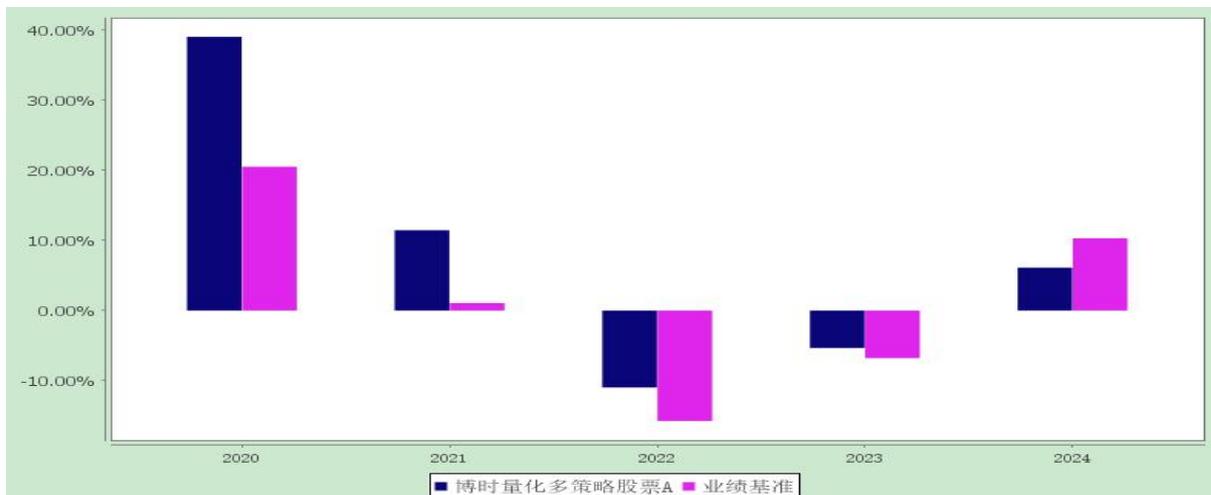
2、博时量化多策略股票 C



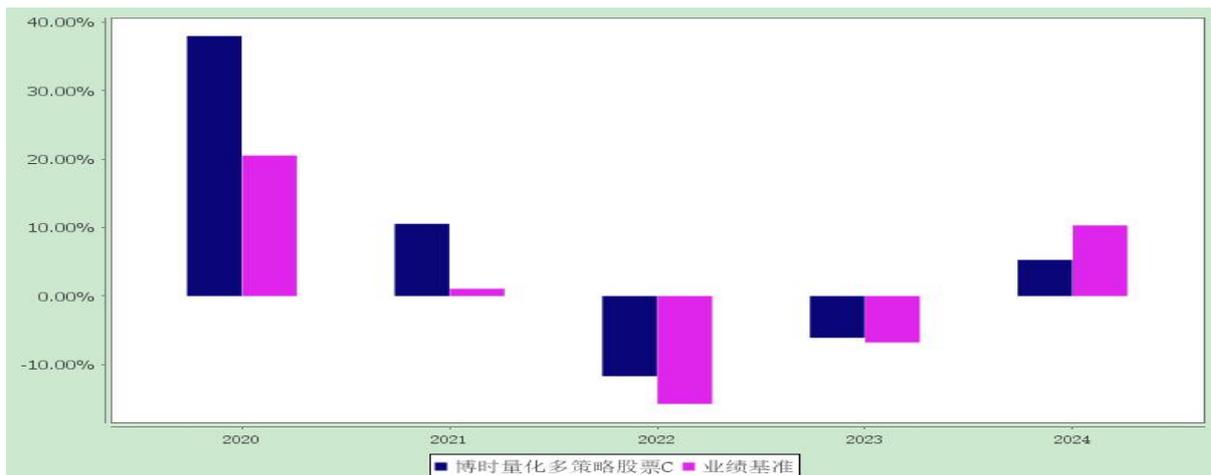
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、博时量化多策略股票 A



2、博时量化多策略股票 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、博时量化多策略股票 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	1.9910	71,702,870.65	19,077,531.38	90,780,402.03	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	1.9910	71,702,870.65	19,077,531.38	90,780,402.03	-

2、博时量化多策略股票 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	1.6760	10,072,809.36	1,329,629.81	11,402,439.17	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	1.6760	10,072,809.36	1,329,629.81	11,402,439.17	-

§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

博时基金管理有限公司是中国内地首批成立的五家基金管理公司之一。“为国民创造财富”是博时的使命。博时的投资理念是“做投资价值的发现者”。截至 2024 年 12 月 31 日，博时基金管理有限公司共管理 386 只公募基金，并受全国社会保障基金理事会委托管理部分社保基金，以及多个企业年金、职业年金及特定专户，管理资产总规模逾 16089 亿元人民币，剔除货币基金后，博时基金公募资产管理总规模逾 6647 亿元人民币，累计分红逾 2085 亿元人民币，是目前我国资产管理规模领先的基金公司之一。

其他大事件

12 月，国家开发银行授予博时基金“优秀投资机构合作奖”，表彰公司在国家开发银行 2024 年银行间市场金融债券投资工作中表现突出。

11 月，深证投资者服务中心联合全景投教基地召开《股东来了》（2024）投资者权益知识竞赛深圳片区总结交流会，授予博时基金《股东来了》（2024）深圳片区突出贡献团体奖。

10 月，中国人民银行 2023 年度金融科技发展奖获奖项目名单出炉，博时基金“新一代资管业务资金清算系统”荣获三等奖。

4 月，深圳市人工智能学会公布 2023 年度第三届“深圳人工智能奖”获奖名单，博时基金“智能量化因子投研系统”荣获人工智能行业应用奖。

1 月，中国人民银行公布 2022 年度金融科技发展奖获奖项目名单，博时基金“陪伴服务平台项目”荣获三等奖。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
黄瑞庆	指数与量化投资部投资总监/ 基金经理	2018-04-03	-	22.4	<p>黄瑞庆先生，博士。2002 年起先后在融通基金、长城基金、长盛基金、财通基金、合众资产管理股份有限公司从事研究、投资、管理等工作。2013 年加入博时基金管理有限公司。历任股票投资部 ETF 及量化组投资副总监、股票投资部 ETF 及量化组投资副总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资副总监（主持工作）兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监兼基金经理助理、股票投资部量化投资组投资总监、博时价值增长贰号证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日)、博时价值增长证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2016 年 10 月 24 日)、博时特许价值混合型证券投资基金(2015 年 2 月 9 日-2018 年 6 月 21 日)的基金经理、指数与量化投资部总经理。现任指数与量化投资部投资总监兼博时量化平衡混合型证券投资基金(2017 年 5 月 4 日—至今)、博时量化多策略股票型证券投资基金(2018 年 4 月 3 日—至今)、博时量化价值股票型证券投资基金(2018 年 6 月 26 日—至今)、博时稳健恒利债券型证券投资基金(2024 年 10 月 29 日—至今)的基金经理，兼任投资经理。</p>
李庆阳	基金经理助理	2020-05-15	2024-01-31	14.4	<p>李庆阳先生，硕士。2010 年从华南理工大学硕士研究生毕业后加入博时基金管理有限公司，历任高级程序员、高级系统运维经理。2016 年调任博时资本，任投资经理。2018 年再次加入博时基金管理有限公司。现任博时上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金(2024 年 2 月 2 日—至今)、博时创业板指</p>

					数证券投资基金(2024年2月2日—至今)、上证超级大盘交易型开放式指数证券投资基金(2024年2月2日—至今)、博时中证港股通互联网交易型开放式指数证券投资基金(2024年2月8日—至今)、博时中证传媒指数型发起式证券投资基金(2024年3月5日—至今)、博时国证消费电子主题指数型发起式证券投资基金(2024年4月23日—至今)、博时中证全指通信设备指数型发起式证券投资基金(2024年5月7日—至今)、博时中证汽车零部件主题指数型发起式证券投资基金(2024年5月21日—至今)、博时中证信息技术应用创新产业指数型发起式证券投资基金(2024年6月4日—至今)、博时上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金(2024年8月8日—至今)、博时上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金(2024年12月31日—至今)的基金经理。
王萌	基金经理助理	2023-01-20	-	8.4	王萌先生, 博士。2016年毕业后加入博时基金管理有限公司。现任基金经理助理。

注: 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。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。

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
黄瑞庆	公募基金	4	1,317,338,827.05	2015-02-09
	私募资产管理计划	4	124,835,913.49	2024-03-15
	其他组合	-	-	-
	合计	8	1,442,174,740.54	

注: 报告期内, 黄瑞庆于 2024 年 8 月 28 日离任其原管理的 1 只私募资产管理计划。

4.1.4 基金经理薪酬机制

公司基金经理薪酬由固定工资与绩效奖金组成, 绩效奖金根据年度投资业绩、投研团队贡献等综合绩效评定。

对于基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其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

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》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，并本着诚实信用、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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，由于证券市场波动等原因，本基金曾出现个别投资监控指标超标的情况，基金管理人在规定期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

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

报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关要求，公司进一步完善了公平交易管理机制，通过系统及人工相结合的方式，分别对一级市场及二级市场的权益类及固定收益类投资的公平交易原则、流程，按照境内及境外业务进行了详细规范，同时也通过强化事后分析评估监督机制来确保公司公平对待管理的不同投资组合。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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》和公司制定的公平交易相关制度。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理，公司根据相关法律法规及监管规定，进一步加强了公平交易管理的内部控制措施，强化了投资指令下达、同反向交易控制、组合收益率分析、同向交易价差监测分析。本报告期内，相关措施执行情况良好，未发现违反公平交易制度的异常交易行为。

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 132 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年我国经济增长面临压力，内生动能偏弱。具体来看，一季度 GDP 增速平稳回升，呈现良好开局；二季度和三季度国内有效需求不足的现象较为突出，居民消费偏弱，投资增长乏力，但高端技术制造业生产投资增速保持较高水平；随着 9 月 24 日央行等三部门联合释放积极信号，叠加化债政策，四季度经济开始出现边际改善趋势，新质生产力加快培育形成，推动经济高质量发展。

宏观经济的变化、政策的出台力度对股票市场的盈利预期和风险偏好造成一定影响。一季度伴随稳增长政策的预期，市场信心得到提升。由于二、三季度经济增长的压力，市场回吐了 1 季度的涨幅。9 月下旬政策组合拳推出后市场急速上移，四季度股票市场投资者情绪逐渐稳定。全年大小盘风格方面，偏大盘风格的沪深 300 指数涨幅 14.68%，偏中小盘的中证 1000 指数涨幅 1.2%；在成长价值方面，大盘价值表现好于大盘成长。在行业方面，银行、非银行金融、家电和通信等行业涨幅领先，综合、医药、农林牧渔和消费者服务等行业表现相对较差。

本基金在 2024 年全年综合考虑了股票的估值水平和基本面的变化趋势，维持了较高的股票仓位。在策略的配置方面，整体上坚持顺势而为，策略的这种动态配置在今天的波动市场中付出一定的损耗。为了应对挑战，本基金采用了从选股到择时的若干系列 AI 模型作为补充与替代。未来本基金将持续运用科学的量化方法，寻找和把握基本面和市场面的长期规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场特征构建量化策略配置模型的组合。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2549 元，份额累计净值为 1.4540 元，本基金 C 类基金份额净值为 1.2121 元，份额累计净值为 1.3797 元，报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 6.12%，本基金 C 类基金份额净值增长率为 5.28%，同期业绩基准增长率为 10.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外方面，整体来看经济依旧稳健。上半年美国通胀仍将处于下行趋势但是压力仍在，后续经济增长需关注关税、减员增效等各项政策的执行情况。流动性方面，从 CME 隐含利率预期看 25 年仍有 1-2 次降息。国内方面，预计经济刺激政策将更加积极有为，逆周期政策力度加大，企业家和投资者预期转好，有望带动企业盈利延续温和改善。此外，在游戏、AI 和电影等行业陆续出现具有全球影响力的超预期产品后，中国有望在新一轮全球竞争中更具信心。

未来人工智能技术的推广不仅能促进产业的创新发展，还可以提升企业的效率，对中国经济增

长特别是企业盈利修复有积极作用。在国际市场加息周期接近尾声、国内货币政策以“稳”为主的大背景下，A 股的驱动力势必要从估值修复向盈利和估值双轮驱动进行转变。基于当前不同行业的估值差异，我们认为 2025 年 A 股市场大概率上还会呈现风格轮动特征，全年下来增长预期强烈、盈利增幅较大和估值较低的个股和板块或将都有机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的经营运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，进一步健全内控体系，完善内控制度、机制和流程，夯实内控管理基础；强化对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察，通过实时监控、预警提示、定期检查、专项审计等方式，及时发现情况，提出改进建议并跟踪改进落实情况。公司风险管理部牵头开展内控管理工作，推动内控机制完善与执行；公司法律合规部对公司遵守各项法规和管理制度及旗下各基金履行合同义务的情况进行核查，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告；公司审计部针对基金投研交、市场销售、后台运营、信息技术等开展内部审计项目，作出审计独立、客观的监督、评价和建议。

报告期内，内控制度方面，公司根据法律、法规的规定及公司内部管理需求，进一步健全内控管理机制，新建或修订了《制度管理规范》、《合规管理制度》、《全面风险管理制度》、《内部稽核审计制度》、《投资者适当性管理制度》、《公募基金证券交易佣金分配管理办法》、《货币市场基金投资管理制度》、《对外信息发布管理制度》、《公募基金法定信息披露管理制度》等制度文件。系统建设方面，持续对“新一代决策支持系统”、“指标中心”、“博时产品管理系统”、“统一风险管理平台”等管理平台系统功能进行迭代更新，完善“博时合规管理及审计系统”中制度库应用、合规报告生成等模块的数智化功能，进一步提升公司市场体系、投研体系、后台运作、风险合规管理的系统支持能力。基金销售方面，在新基金发行和老基金持续营销的过程中，严格规范基金销售业务，按照《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及内部制度的规定，审查宣传推介材料，选择有代销资格的代销机构销售基金，并努力做好投资者教育工作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了博时基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由主管运营的公司领导、督察长、投资总监、研究部负责人、运作部负责人等成员组成，基金经理原则上不参与估值委员会的工作，其估值建议

经估值委员会成员评估后审慎采用。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力，具有绝对的独立性。估值委员会的职责主要包括有：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司签署服务协议，由其按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则为：由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；本基金收益分配方式分两种：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，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。

本报告期内本基金未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

容诚审字[2025]200Z1039 号

博时量化多策略股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了博时量化多策略股票型证券投资基金（以下简称“博时量化多策略股票”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了博时量化多策略股票 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于博时量化多策略股票，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。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

博时量化多策略股票的基金管理人博时基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估博时量化多策略股票的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算博时量化多策略股票、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督博时量化多策略股票的财务报告过程。

6.4 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）评价基金管理人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）对基金管理人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，就可能导致对博时量化多策略股票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博时量化多策略股票不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、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。

我们与基金管理人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。

容诚会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
 薛竞 吴琳杰
 北京市西城区阜成门外大街 22 号 1 幢 10 层 1001-1 至 1001-26
 2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	14,559,764.76	64,033,805.62
结算备付金		15,494,260.89	27,714,351.93
存出保证金		-	3,145,864.43
交易性金融资产	7.4.7.2	349,969,989.02	625,574,155.46
其中：股票投资		344,931,180.80	604,675,860.12
基金投资		-	-
债券投资		5,038,808.22	20,898,295.34
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-

应收申购款		101,404.07	4,073.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		380,125,418.74	720,472,250.66
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	45,924,929.40
应付赎回款		8,430,932.48	11,776.73
应付管理人报酬		408,481.59	654,804.35
应付托管费		68,080.28	109,134.07
应付销售服务费		34,131.33	43,399.62
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	60,361.69	4,664,155.76
负债合计		9,001,987.37	51,408,199.93
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	297,089,166.00	567,484,186.74
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	74,034,265.37	101,579,863.99
净资产合计		371,123,431.37	669,064,050.73
负债和净资产总计		380,125,418.74	720,472,250.66

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 297,089,166.00 份。其中 A 类基金份额净值 1.2549 元，基金份额总额 257,240,020.12 份；C 类基金份额净值 1.2121 元，基金份额总额 39,849,145.88 份。

7.2 利润表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
一、营业总收入		33,254,784.51	-41,343,014.07
1.利息收入		269,426.03	309,803.86
其中：存款利息收入	7.4.7.9	269,426.03	309,803.86

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）		44,585,222.80	-48,550,121.59
其中：股票投资收益	7.4.7.10	28,400,616.01	-54,754,849.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	74,616.52	361,282.75
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-1,228,358.26	-1,071,678.67
股利收益	7.4.7.14	17,338,348.53	6,915,123.98
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-11,752,080.53	6,583,865.04
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	152,216.21	313,438.62
减：二、营业总支出		9,572,846.79	7,372,420.75
1. 管理人报酬		7,521,616.97	5,670,825.89
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		1,253,602.85	945,137.68
3. 销售服务费		597,015.30	557,964.82
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	1,833.94
其中：卖出回购金融资产支出		-	1,833.94
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		-	3,718.40
8. 其他费用	7.4.7.18	200,611.67	192,940.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,681,937.72	-48,715,434.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,681,937.72	-48,715,434.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		23,681,937.72	-48,715,434.82

7.3 净资产变动表

会计主体：博时量化多策略股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	567,484,186.74	101,579,863.99	669,064,050.73
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	567,484,186.74	101,579,863.99	669,064,050.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-270,395,020.74	-27,545,598.62	-297,940,619.36
（一）、综合收益总额	-	23,681,937.72	23,681,937.72
（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）	-270,395,020.74	-51,227,536.34	-321,622,557.08
其中：1.基金申购款	180,142,714.77	30,776,599.00	210,919,313.77
2.基金赎回款	-450,537,735.51	-82,004,135.34	-532,541,870.85
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	297,089,166.00	74,034,265.37	371,123,431.37
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	159,874,747.07	72,586,936.48	232,461,683.55
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	159,874,747.07	72,586,936.48	232,461,683.55

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	407,609,439.67	28,992,927.51	436,602,367.18
（一）、综合收益总额	-	-48,715,434.82	-48,715,434.82
（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）	407,609,439.67	179,891,203.53	587,500,643.20
其中：1.基金申购款	620,719,096.80	274,126,580.44	894,845,677.24
2.基金赎回款	-213,109,657.13	-94,235,376.91	-307,345,034.04
（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）	-	-102,182,841.20	-102,182,841.20
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	567,484,186.74	101,579,863.99	669,064,050.73

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：

基金管理人负责人：江向阳，主管会计工作负责人：王德英，会计机构负责人：陈子成

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

博时量化多策略股票型证券投资基金（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[2017]1982号《关于准予博时量化多策略股票型证券投资基金注册的批复》准予注册，由博时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《博时量化多策略股票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人民币 910,902,796.19 元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0197 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 3 日正式生效，基金合同生效日的

基金份额总额为 911,230,422.36 份基金份额，其中认购资金利息折合 327,626.17 份基金份额。本基金的基金管理人为博时基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为 A 类基金份额和 C 类基金份额。在投资者认/申购时收取认/申购费用，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于境内依法发行或上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、权证、股指期货、债券（包含国债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债券、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、同业存单、债券回购、银行存款、国债期货和现金，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的规定）。本基金的投资组合比例：股票投资占基金资产的 80%-95%（其中投资于港股通标的股票占股票资产的比例为 0-50%）；权证投资比例为基金资产净值的 0-3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×70%+恒生综合指数收益率×20%+中债综合财富（总值）指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人博时基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、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>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注“重要会计政策和会计估计”所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期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本期末的财务状况以及本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑在资产负债表日无须付出不必要的额外成本和努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利

率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金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；或者（3）该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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）当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：（1）赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；（2）该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；（3）该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；（4）除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；（5）该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：（1）现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；（2）实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为

投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确

定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 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。对基金从上市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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

（4）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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（5）本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	14,559,764.76	64,033,805.62
等于：本金	14,558,592.80	64,029,586.93
加：应计利息	1,171.96	4,218.69
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	14,559,764.76	64,033,805.62

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		346,781,607.23	-	344,931,180.80	-1,850,426.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	5,009,070.00	29,808.22	5,038,808.22	-70.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,009,070.00	29,808.22	5,038,808.22	-70.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		351,790,677.23	29,808.22	349,969,989.02	-1,850,496.43
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		595,355,739.47	-	604,675,860.12	9,320,120.65
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	20,502,027.00	396,245.34	20,898,295.34	23.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	20,502,027.00	396,245.34	20,898,295.34	23.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		615,857,766.47	396,245.34	625,574,155.46	9,320,143.65

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		合同/名义 金额	公允价值		备注
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-
权益衍生工具		-	-	-	-
其他衍生工具		-	-	-	-
合计		-	-	-	-
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		合同/名义 金额	公允价值		备注
			资产	负债	
利率衍生工具		-	-	-	-
货币衍生工具		-	-	-	-

权益衍生工具	23,854,159.55	-	-	-
---股指期货	23,854,159.55	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,854,159.55	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的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。

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

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	861.69	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	4,490,655.76
其中：交易所市场	-	4,490,655.76
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	59,500.00	173,500.00
合计	60,361.69	4,664,155.76

7.4.7.7 实收基金

博时量化多策略股票 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	504,330,069.27	504,330,069.27
本期申购	145,646,623.65	145,646,623.65
本期赎回（以“-”号填列）	-392,736,672.80	-392,736,672.80
本期末	257,240,020.12	257,240,020.12

博时量化多策略股票 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	63,154,117.47	63,154,117.47
本期申购	34,496,091.12	34,496,091.12
本期赎回（以“-”号填列）	-57,801,062.71	-57,801,062.71
本期末	39,849,145.88	39,849,145.88

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额(如适用)。

7.4.7.8 未分配利润

博时量化多策略股票 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	86,021,154.86	6,003,841.89	92,024,996.75
本期期初	86,021,154.86	6,003,841.89	92,024,996.75
本期利润	33,296,241.82	-10,136,317.99	23,159,923.83
本期基金份额交易产生的变动数	-44,998,101.34	-4,605,037.96	-49,603,139.30
其中：基金申购款	25,707,724.08	1,334,615.36	27,042,339.44
基金赎回款	-70,705,825.42	-5,939,653.32	-76,645,478.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,319,295.34	-8,737,514.06	65,581,781.28

博时量化多策略股票 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,814,984.41	739,882.83	9,554,867.24
本期期初	8,814,984.41	739,882.83	9,554,867.24
本期利润	2,137,776.43	-1,615,762.54	522,013.89
本期基金份额交易产生的变动数	-1,200,870.80	-423,526.24	-1,624,397.04
其中：基金申购款	4,077,477.78	-343,218.22	3,734,259.56
基金赎回款	-5,278,348.58	-80,308.02	-5,358,656.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,751,890.04	-1,299,405.95	8,452,484.09

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
	活期存款利息收入	82,277.34
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	186,155.69	183,204.28
其他	993.00	2,595.06
合计	269,426.03	309,803.86

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	10,616,861,899.57	6,990,376,854.31
减：卖出股票成本总额	10,568,597,218.87	7,027,927,340.77
减：交易费用	19,864,064.69	17,204,363.19
买卖股票差价收入	28,400,616.01	-54,754,849.65

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	104,376.76	139,053.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-29,760.24	222,229.31
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	74,616.52	361,282.75

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,402,950.00	4,247,748.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,827,067.00	4,010,243.53
减：应计利息总额	602,950.00	14,972.89
减：交易费用	2,693.24	302.68
买卖债券差价收入	-29,760.24	222,229.31

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

无发生额。

7.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无发生额。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无发生额。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益	-1,228,358.26	-1,071,678.67

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	17,338,348.53	6,915,123.98
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	17,338,348.53	6,915,123.98

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-11,170,640.08	5,829,798.27
——股票投资	-11,170,547.08	5,829,997.97
——债券投资	-93.00	-199.70
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-581,440.45	754,066.77

——权证投资	-	-
——股指期货	-581,440.45	754,066.77
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	-11,752,080.53	6,583,865.04

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
基金赎回费收入	149,069.24	260,275.26
基金转换费收入	3,146.97	53,163.36
合计	152,216.21	313,438.62

7.4.7.17 信用减值损失

无发生额。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
审计费用	55,000.00	49,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
其他	345.69	401.41
银行汇划费	7,265.98	5,538.61
中债登账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	200,611.67	192,940.02

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，本基金无须披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须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
博时基金管理有限公司（“博时基金”）	基金管理人、注册登记机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人

招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金管理人的股东
中国长城资产管理股份有限公司	基金管理人的股东
浙江省国际贸易集团有限公司	基金管理人的股东
浙江省国贸集团资产经营有限公司	基金管理人的原股东
广厦建设集团有限责任公司	基金管理人的原股东
天津港（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海汇华实业有限公司	基金管理人的股东
上海盛业股权投资基金有限公司	基金管理人的股东
博时资本管理有限公司（“博时资本”）	基金管理人的子公司
博时财富基金销售有限公司（“博时财富”）	基金管理人的子公司
博时基金（国际）有限公司（“博时国际”）	基金管理人的子公司
海南博时创新管理有限公司（“博时创新”）	基金管理人的子公司

注：1.经基金管理人 2024 年第五次临时股东会议决议通过，基金管理人原全资控股的孙公司海南博时创新管理有限公司于 2024 年 3 月 27 日完成工商变更登记，变更为基金管理人的全资子公司。

2.经基金管理人 2023 年第三次临时股东会议决议，股东广厦建设集团有限责任公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国贸集团资产经营有限公司。经基金管理人 2024 年第二次临时股东会议决议，股东浙江省国贸集团资产经营有限公司将其持有的基金管理人 2% 的股权转让给浙江省国际贸易集团有限公司。于 2024 年 12 月 24 日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，上述股东变更完成后，基金管理人股权结构为：招商证券股份有限公司 49%，中国长城资产管理股份有限公司 25%，上海汇华实业有限公司 12%，天津港(集团)有限公司 6%，上海盛业股权投资基金有限公司 6%和浙江省国际贸易集团有限公司 2%。

3.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券	16,777,777,650.36	80.14%	6,770,985,424.75	47.04%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债

		券成交总 额的比例		券成交总 额的比例
招商证券	13,334,110.00	100.00%	18,083,839.07	64.49%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
招商证券	-	-	1,000,000.00	24.94%

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	10,114,480.86	76.53%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
招商证券	5,013,669.09	47.09%	2,013,875.58	44.85%

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。根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	7,521,616.97
其中：应支付销售机构的客户维护 费	477,904.35	296,107.72

应支付基金管理人的净管理费	7,043,712.62	5,374,718.17
---------------	--------------	--------------

注：于本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金管理人博时基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,253,602.85	945,137.68

注：于本期及上年度可比期间，截至 2023 年 7 月 9 日止，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

自 2023 年 7 月 10 日起，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
招商证券	-	7,375.73	7,375.73
招商银行	-	2,153.49	2,153.49
博时基金	-	42,456.43	42,456.43
合计	-	51,985.65	51,985.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C	合计
博时基金	-	223,232.06	223,232.06
招商证券	-	172,788.54	172,788.54
招商银行	-	2,170.43	2,170.43
合计	-	398,191.03	398,191.03

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给博时基金，再由博时基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类基金份额的基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行-活期存款	14,559,764.76	82,277.34	64,033,805.62	124,004.52

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
招商证券股份有限公司	301428	世纪恒通	网下发行	2,289.00	60,315.15
招商证券股份有限公司	301305	朗坤环境	网下发行	4,806.00	121,351.50
招商证券股份有限公司	001378	德冠新材	网下发行	2,044.00	64,753.92

招商证券股份有限公司	688653	康希通信	网下发行	6,478.00	68,019.00
------------	--------	------	------	----------	-----------

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

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603072	天和磁材	2024-12-24	7 个交易日	新股未上市	12.30	12.30	2,029.00	24,956.70	24,956.70	-
001391	国货航	2024-12-23	6 个月	首次公开发行限售	2.30	6.80	2,811.00	6,465.30	19,114.80	-
603194	中力股份	2024-12-17	6 个月	首次公开发行限售	20.32	28.13	291.00	5,913.12	8,185.83	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	首次公开发行限售	12.30	12.30	226.00	2,779.80	2,779.80	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000016	深康佳 A	2024-12-30	重大事项停牌	5.52	2025-01-14	6.07	10,700.00	55,246.00	59,064.00	-
000421	南京公用	2024-12-27	重大事项停牌	6.48	2025-01-13	7.13	400.00	2,540.00	2,592.00	-
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项停牌	7.22	2025-01-07	6.93	7,800.00	59,690.57	56,316.00	-
002379	宏创控股	2024-12-23	重大事项停牌	8.97	2025-01-07	9.87	4,200.00	32,502.86	37,674.00	-
688139	海尔生物	2024-12-23	重大事项停牌	35.20	2025-01-07	30.60	400.00	14,890.00	14,080.00	-

注：本基金截至 2024 年 12 月 31 日持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的证券，该类证券将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金与混合型基金，属于风险水平较高的基金。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，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金运用科学的量化方法，把握市场规律，跟踪和捕捉市场多种风格的变化趋势，并针对当前市场风格特点，选择因子和构建策略组合，力求获取长期相对市场的超额收益。

本基金的基金管理人建立了董事会领导，以风险管理委员会为核心的，由总经理、督察长、法律合规部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责制定公司的风险管理政策，对风险管理负完全的和最终的责任；在董事会下设立风险管理委员会，负责批准公司风险管理系统文件和批准每一个部门的风险级别，以及负责解决重大的突发的风险；督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险管理委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；法律合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理系统的发展提供协助，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；风险管理部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理与绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

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行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人，定期存款存放在具有证券投资基金托管资格、基金销售业务资格或合格境外机构投资者托管人资格的银行，因而与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主要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，本基金的基金管理人管理的基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,038,808.22	20,898,295.34
合计	5,038,808.22	20,898,295.34

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2.未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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于开放期内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于开放期内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。此外，本基金还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。

于本期末，除卖出回购金融资产款余额(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约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(净资产)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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

除附注“期末本基金持有的流通受限证券”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，其余均能以合理价格适时变现。在本基金开放日，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%。于本期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

于开放期内，本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于本期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	14,559,764.76	-	-	-	14,559,764.76
结算备付金	15,494,260.89	-	-	-	15,494,260.89
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	5,038,808.22	-	-	344,931,180.80	349,969,989.02
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	101,404.07	101,404.07
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	35,092,833.87	-	-	345,032,584.87	380,125,418.74
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	8,430,932.48	8,430,932.48
应付清算款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	408,481.59	408,481.59
应付托管费	-	-	-	68,080.28	68,080.28
应付销售服务费	-	-	-	34,131.33	34,131.33
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	60,361.69	60,361.69
负债总计	-	-	-	9,001,987.37	9,001,987.37
利率敏感度缺口	35,092,833.87	-	-	336,030,597.50	371,123,431.37
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	64,033,805.62	-	-	-	64,033,805.62
结算备付金	27,714,351.93	-	-	-	27,714,351.93
存出保证金	213,592.43	-	-	2,932,272.00	3,145,864.43
交易性金融资产	20,898,295.34	-	-	604,675,860.12	625,574,155.46
应收清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,073.22	4,073.22
应收股利	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	112,860,045.32	-	-	607,612,205.34	720,472,250.66

负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,776.73	11,776.73
应付清算款	-	-	-	45,924,929.40	45,924,929.40
应付管理人报酬	-	-	-	654,804.35	654,804.35
应付托管费	-	-	-	109,134.07	109,134.07
应付销售服务费	-	-	-	43,399.62	43,399.62
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	4,664,155.76	4,664,155.76
负债总计	-	-	-	51,408,199.93	51,408,199.93
利率敏感度缺口	112,860,045.32	-	-	556,204,005.41	669,064,050.73

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

假设	除市场利率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：人民币万元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	减少约 1	减少约 0
市场利率下降 25 个基点	增加约 1	增加约 0	

注：以上金额为四舍五入的结果。

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。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	344,931,180.80	92.94	604,675,860.12	90.38
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	344,931,180.80	92.94	604,675,860.12	90.38

注：1、债券投资为可转换债券、可交换债券投资。

2、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注“衍生金融资产/负债”)。在当日无负债结算制度下，期货投资于相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵扣后的净额为 0。

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：人民币万元)	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,614	增加约 2,353
业绩比较基准下降 5%	减少约 1,614	减少约 2,353	

7.4.14 公允价值
7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具
7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2024 年 12 月 31 日	2023 年 12 月 31 日
第一层次	344,706,417.67	603,814,287.48
第二层次	5,236,270.72	20,898,295.34
第三层次	27,300.63	861,572.64
合计	349,969,989.02	625,574,155.46

7.4.14.2.2 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。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	861,572.64	861,572.64
当期购买	-	172,827.96	172,827.96
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	996,611.48	996,611.48
当期利得或损失总额	-	-10,488.49	-10,488.49
其中：计入损益的利得或损失	-	-10,488.49	-10,488.49
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	27,300.63	27,300.63
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	14,922.21	14,922.21
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	955,486.14	955,486.14
当期购买	-	1,486,343.31	1,486,343.31

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,918,141.45	1,918,141.45
当期利得或损失总额	-	337,884.64	337,884.64
其中：计入损益的利得或损失	-	337,884.64	337,884.64
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	861,572.64	861,572.64
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	142,605.90	142,605.90

注：计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	27,300.63	平均价格亚式期权模型	预期波动率	150.88%-200.14%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	861,572.64	平均价格亚式期权模型	预期波动率	18.55%-217.52%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（上年度末：同）。

7.4.14.4 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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	344,931,180.80	90.74
	其中：股票	344,931,180.80	90.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,038,808.22	1.33
	其中：债券	5,038,808.22	1.33
	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	30,054,025.65	7.91
8	其他各项资产	101,404.07	0.03
9	合计	380,125,418.74	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,231,466.00	0.33
B	采矿业	20,412,245.03	5.50
C	制造业	177,599,295.75	47.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,459,108.35	1.47
E	建筑业	5,811,153.00	1.57
F	批发和零售业	8,960,401.55	2.41
G	交通运输、仓储和邮政业	9,189,306.99	2.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,947,693.60	6.18
J	金融业	83,460,334.93	22.49
K	房地产业	1,966,464.00	0.53
L	租赁和商务服务业	4,503,901.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,561,272.10	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	353,401.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	17,545.00	0.00
Q	卫生和社会工作	386,241.50	0.10
R	文化、体育和娱乐业	164,032.00	0.04
S	综合	907,319.00	0.24
	合计	344,931,180.80	92.94

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投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	166665	12,536,541.30	3.38
2	601318	中国平安	220200	11,593,530.00	3.12
3	601998	中信银行	1579200	11,022,816.00	2.97
4	000651	格力电器	146600	6,662,970.00	1.80
5	601166	兴业银行	315900	6,052,644.00	1.63
6	601398	工商银行	804000	5,563,680.00	1.50
7	300750	宁德时代	19264	5,124,224.00	1.38
8	601728	中国电信	640600	4,625,132.00	1.25
9	600519	贵州茅台	2800	4,267,200.00	1.15
10	601328	交通银行	548523	4,262,023.71	1.15
11	600887	伊利股份	132200	3,989,796.00	1.08
12	601288	农业银行	720000	3,844,800.00	1.04
13	600941	中国移动	32500	3,840,200.00	1.03
14	601857	中国石油	429267	3,837,646.98	1.03
15	600019	宝钢股份	547300	3,831,100.00	1.03
16	300308	中际旭创	29200	3,606,492.00	0.97
17	600028	中国石化	533300	3,562,444.00	0.96
18	600050	中国联通	640700	3,402,117.00	0.92
19	601919	中远海控	217900	3,377,450.00	0.91
20	601088	中国神华	77400	3,365,352.00	0.91
21	600919	江苏银行	320134	3,143,715.88	0.85
22	000009	中国宝安	331500	3,033,225.00	0.82
23	000063	中兴通讯	70400	2,844,160.00	0.77
24	601601	中国太保	77700	2,648,016.00	0.71
25	002594	比亚迪	9239	2,611,495.74	0.70
26	601668	中国建筑	432600	2,595,600.00	0.70
27	002475	立讯精密	60700	2,474,132.00	0.67
28	000001	平安银行	202700	2,371,590.00	0.64
29	601319	中国人保	306900	2,338,578.00	0.63
30	688981	中芯国际	24379	2,306,740.98	0.62
31	600900	长江电力	76057	2,247,484.35	0.61
32	600938	中国海油	75200	2,219,152.00	0.60
33	601988	中国银行	386000	2,126,860.00	0.57
34	600016	民生银行	504700	2,084,411.00	0.56
35	000725	京东方 A	463400	2,034,326.00	0.55
36	002027	分众传媒	288300	2,026,749.00	0.55

37	300502	新易盛	17500	2,022,650.00	0.55
38	601229	上海银行	213400	1,952,610.00	0.53
39	688256	寒武纪	2935	1,931,230.00	0.52
40	688041	海光信息	12478	1,869,079.62	0.50
41	600219	南山铝业	475700	1,859,987.00	0.50
42	601225	陕西煤业	79800	1,856,148.00	0.50
43	600000	浦发银行	179186	1,843,823.94	0.50
44	000338	潍柴动力	133300	1,826,210.00	0.49
45	600010	宝钢股份	965400	1,795,644.00	0.48
46	002001	新和成	80600	1,770,782.00	0.48
47	601169	北京银行	278600	1,713,390.00	0.46
48	002415	海康威视	54600	1,676,220.00	0.45
49	601899	紫金矿业	110100	1,664,712.00	0.45
50	601688	华泰证券	94400	1,660,496.00	0.45
51	601766	中国中车	191500	1,604,770.00	0.43
52	300059	东方财富	61880	1,597,741.60	0.43
53	601336	新华保险	32084	1,594,574.80	0.43
54	002371	北方华创	3900	1,524,900.00	0.41
55	002142	宁波银行	61500	1,495,065.00	0.40
56	601211	国泰君安	79800	1,488,270.00	0.40
57	000858	五粮液	9000	1,260,360.00	0.34
58	300433	蓝思科技	57500	1,259,250.00	0.34
59	600048	保利发展	141700	1,255,462.00	0.34
60	600030	中信证券	42400	1,236,808.00	0.33
61	600690	海尔智家	43400	1,235,598.00	0.33
62	600015	华夏银行	152900	1,224,729.00	0.33
63	601390	中国中铁	189700	1,212,183.00	0.33
64	601600	中国铝业	163700	1,203,195.00	0.32
65	601818	光大银行	310400	1,201,248.00	0.32
66	600861	北京人力	61100	1,182,285.00	0.32
67	600438	通威股份	50700	1,120,977.00	0.30
68	601006	大秦铁路	164000	1,111,920.00	0.30
69	601658	邮储银行	193500	1,099,080.00	0.30
70	600346	恒力石化	70800	1,086,780.00	0.29
71	300274	阳光电源	14540	1,073,488.20	0.29
72	601939	建设银行	122100	1,073,259.00	0.29
73	601009	南京银行	99700	1,061,805.00	0.29
74	002534	西子洁能	95500	1,061,005.00	0.29
75	688036	传音控股	10856	1,031,320.00	0.28
76	601816	京沪高铁	167200	1,029,952.00	0.28
77	600585	海螺水泥	43200	1,027,296.00	0.28
78	002537	海联金汇	177700	1,021,775.00	0.28
79	301050	雷电微力	19200	990,336.00	0.27

80	000596	古井贡酒	5600	970,480.00	0.26
81	600827	百联股份	88400	966,212.00	0.26
82	600276	恒瑞医药	21000	963,900.00	0.26
83	600926	杭州银行	65200	952,572.00	0.26
84	605333	沪光股份	28400	926,692.00	0.25
85	600309	万华化学	12756	910,140.60	0.25
86	603733	仙鹤股份	43100	889,153.00	0.24
87	000652	泰达股份	211700	876,438.00	0.24
88	601825	沪农商行	102400	871,424.00	0.23
89	600096	云天化	37900	845,170.00	0.23
90	000100	TCL 科技	168000	845,040.00	0.23
91	688252	天德钰	35140	841,603.00	0.23
92	601186	中国铁建	91700	840,889.00	0.23
93	600216	浙江医药	52600	834,236.00	0.22
94	600522	中天科技	57900	829,128.00	0.22
95	300628	亿联网络	21200	818,320.00	0.22
96	300760	迈瑞医疗	3200	816,000.00	0.22
97	300002	神州泰岳	70400	815,936.00	0.22
98	600886	国投电力	48100	799,422.00	0.22
99	601138	工业富联	36800	791,200.00	0.21
100	002057	中钢天源	108000	779,760.00	0.21
101	300761	立华股份	39800	774,508.00	0.21
102	688012	中微公司	4092	774,042.72	0.21
103	600795	国电电力	168100	769,898.00	0.21
104	603501	韦尔股份	7300	762,193.00	0.21
105	002468	申通快递	72800	737,464.00	0.20
106	000708	中信特钢	63500	724,535.00	0.20
107	301327	华宝新能	9338	716,317.98	0.19
108	689009	九号公司	15072	715,920.00	0.19
109	300724	捷佳伟创	11200	707,952.00	0.19
110	002466	天齐锂业	21100	696,300.00	0.19
111	600660	福耀玻璃	10900	680,160.00	0.18
112	605117	德业股份	7800	661,440.00	0.18
113	600624	复旦复华	99900	656,343.00	0.18
114	001979	招商蛇口	62900	644,096.00	0.17
115	600770	综艺股份	152400	638,556.00	0.17
116	603259	药明康德	11600	638,464.00	0.17
117	603986	兆易创新	5900	630,120.00	0.17
118	600487	亨通光电	36500	628,530.00	0.17
119	600741	华域汽车	35300	621,633.00	0.17
120	603055	台华新材	55700	617,156.00	0.17
121	300124	汇川技术	10500	615,090.00	0.17
122	601127	赛力斯	4600	613,594.00	0.17

123	603408	建霖家居	47000	588,910.00	0.16
124	688008	澜起科技	8459	574,366.10	0.15
125	002241	歌尔股份	21600	557,496.00	0.15
126	000025	特力 A	33500	553,420.00	0.15
127	000932	华菱钢铁	130300	544,654.00	0.15
128	600784	鲁银投资	92100	542,469.00	0.15
129	002281	光迅科技	10300	537,351.00	0.14
130	002050	三花智控	22600	531,326.00	0.14
131	300394	天孚通信	5800	529,888.00	0.14
132	000753	漳州发展	122400	526,320.00	0.14
133	600805	悦达投资	118500	524,955.00	0.14
134	688131	皓元医药	14683	524,183.10	0.14
135	002318	久立特材	21800	510,338.00	0.14
136	601618	中国中冶	154500	509,850.00	0.14
137	600188	兖矿能源	35965	509,624.05	0.14
138	600584	长电科技	12200	498,492.00	0.13
139	300881	盛德鑫泰	16200	497,988.00	0.13
140	000895	双汇发展	19000	493,240.00	0.13
141	000625	长安汽车	35356	472,356.16	0.13
142	002493	荣盛石化	51600	466,980.00	0.13
143	300866	安克创新	4700	458,908.00	0.12
144	603355	莱克电气	20100	455,265.00	0.12
145	300408	三环集团	11800	454,418.00	0.12
146	601898	中煤能源	36900	449,442.00	0.12
147	600710	苏美达	48100	447,330.00	0.12
148	600626	申达股份	122300	446,395.00	0.12
149	600428	中远海特	61000	445,300.00	0.12
150	600051	宁波联合	67500	441,450.00	0.12
151	600018	上港集团	71200	435,744.00	0.12
152	600516	方大炭素	88600	427,938.00	0.12
153	600256	广汇能源	63200	425,336.00	0.11
154	000629	钒钛股份	146600	422,208.00	0.11
155	300136	信维通信	16300	414,672.00	0.11
156	688533	上声电子	11800	410,876.00	0.11
157	002970	锐明技术	8600	409,618.00	0.11
158	600418	江淮汽车	10900	408,750.00	0.11
159	002463	沪电股份	10300	408,395.00	0.11
160	300475	香农芯创	14300	407,407.00	0.11
161	688027	国盾量子	1300	387,868.00	0.10
162	688082	盛美上海	3866	386,600.00	0.10
163	002049	紫光国微	6000	386,220.00	0.10
164	000301	东方盛虹	46600	382,586.00	0.10
165	600415	小商品城	28200	378,162.00	0.10

166	600282	南钢股份	80500	377,545.00	0.10
167	688208	道通科技	9600	375,936.00	0.10
168	601838	成都银行	21700	371,287.00	0.10
169	300207	欣旺达	16200	361,422.00	0.10
170	002682	龙洲股份	84900	359,127.00	0.10
171	002075	沙钢股份	57000	356,820.00	0.10
172	300418	昆仑万维	9100	350,168.00	0.09
173	601872	招商轮船	54400	348,704.00	0.09
174	002273	水晶光电	15500	344,410.00	0.09
175	000803	山高环能	66800	342,684.00	0.09
176	002807	江阴银行	77000	334,950.00	0.09
177	600703	三安光电	27500	334,675.00	0.09
178	002236	大华股份	20800	332,800.00	0.09
179	300627	华测导航	7900	330,220.00	0.09
180	600839	四川长虹	34200	330,030.00	0.09
181	600745	闻泰科技	8500	329,630.00	0.09
182	000778	新兴铸管	85800	329,472.00	0.09
183	600620	天宸股份	57300	327,756.00	0.09
184	600382	广东明珠	73300	322,520.00	0.09
185	601997	贵阳银行	53300	319,800.00	0.09
186	000564	供销大集	92619	319,535.55	0.09
187	600128	苏豪弘业	39300	319,116.00	0.09
188	301033	迈普医学	7500	315,375.00	0.08
189	603162	海通发展	33937	312,220.40	0.08
190	688099	晶晨股份	4400	302,192.00	0.08
191	600498	烽火通信	15300	297,738.00	0.08
192	000709	河钢股份	132800	293,488.00	0.08
193	688232	新点软件	10100	292,799.00	0.08
194	002384	东山精密	10000	292,000.00	0.08
195	300529	健帆生物	9800	287,532.00	0.08
196	600399	抚顺特钢	49500	287,100.00	0.08
197	688336	三生国健	13398	286,985.16	0.08
198	601933	永辉超市	45200	286,568.00	0.08
199	688126	沪硅产业	14919	280,775.58	0.08
200	601005	重庆钢铁	193700	278,928.00	0.08
201	600066	宇通客车	10500	276,990.00	0.07
202	300442	润泽科技	5300	275,388.00	0.07
203	603919	金徽酒	13900	272,440.00	0.07
204	000550	江铃汽车	11600	272,020.00	0.07
205	002456	欧菲光	22500	269,550.00	0.07
206	000825	太钢不锈	77400	269,352.00	0.07
207	605305	中际联合	9500	269,135.00	0.07
208	600460	士兰微	10200	265,404.00	0.07

209	300782	卓胜微	2900	260,130.00	0.07
210	002156	通富微电	8500	251,175.00	0.07
211	300950	德固特	15500	250,325.00	0.07
212	002916	深南电路	2000	250,000.00	0.07
213	601233	桐昆股份	20900	246,620.00	0.07
214	300661	圣邦股份	3000	245,340.00	0.07
215	600183	生益科技	10100	242,905.00	0.07
216	002180	纳思达	8600	242,262.00	0.07
217	600808	马钢股份	78200	241,638.00	0.07
218	601689	拓普集团	4900	240,100.00	0.06
219	002185	华天科技	20500	238,005.00	0.06
220	002230	科大讯飞	4900	236,768.00	0.06
221	300972	万辰集团	2900	233,189.00	0.06
222	301004	嘉益股份	2000	231,300.00	0.06
223	600022	山东钢铁	155300	225,185.00	0.06
224	300926	博俊科技	10200	224,502.00	0.06
225	600406	国电南瑞	8900	224,458.00	0.06
226	601633	长城汽车	8500	223,805.00	0.06
227	301061	匠心家居	3600	222,480.00	0.06
228	002920	德赛西威	2000	220,220.00	0.06
229	601985	中国核电	21000	219,030.00	0.06
230	300100	双林股份	7900	218,356.00	0.06
231	603799	华友钴业	7300	213,598.00	0.06
232	300638	广和通	10600	213,590.00	0.06
233	300413	芒果超媒	7800	209,742.00	0.06
234	002881	美格智能	7000	209,720.00	0.06
235	000049	德赛电池	8900	209,239.00	0.06
236	688396	华润微	4400	207,636.00	0.06
237	688234	天岳先进	4000	204,800.00	0.06
238	002938	鹏鼎控股	5600	204,288.00	0.06
239	300570	太辰光	2800	203,560.00	0.05
240	688019	安集科技	1458	203,186.88	0.05
241	600782	新钢股份	60500	202,070.00	0.05
242	000923	河钢资源	14500	201,550.00	0.05
243	002396	星网锐捷	10600	201,294.00	0.05
244	000792	盐湖股份	12000	197,520.00	0.05
245	688120	华海清科	1200	195,588.00	0.05
246	688608	恒玄科技	600	195,222.00	0.05
247	688028	沃尔德	8600	190,318.00	0.05
248	002352	顺丰控股	4700	189,410.00	0.05
249	300790	宇瞳光学	9900	188,991.00	0.05
250	300014	亿纬锂能	4000	186,960.00	0.05
251	603083	剑桥科技	4600	186,760.00	0.05

252	688469	芯联集成	36307	186,254.91	0.05
253	600507	方大特钢	45600	184,680.00	0.05
254	688072	拓荆科技	1200	184,404.00	0.05
255	300223	北京君正	2700	184,140.00	0.05
256	002544	普天科技	8500	182,155.00	0.05
257	688080	映翰通	5513	181,487.96	0.05
258	300476	胜宏科技	4300	180,987.00	0.05
259	603019	中科曙光	2500	180,800.00	0.05
260	000898	鞍钢股份	74900	179,760.00	0.05
261	002600	领益智造	22400	179,200.00	0.05
262	600171	上海贝岭	4500	178,560.00	0.05
263	300244	迪安诊断	15700	178,195.00	0.05
264	002093	国脉科技	22700	177,060.00	0.05
265	600733	北汽蓝谷	21900	175,200.00	0.05
266	000810	创维数字	11000	175,120.00	0.05
267	600704	物产中大	34200	173,052.00	0.05
268	688047	龙芯中科	1300	171,964.00	0.05
269	688213	思特威	2200	170,984.00	0.05
270	300015	爱尔眼科	12850	170,262.50	0.05
271	002138	顺络电子	5400	169,992.00	0.05
272	600583	海油工程	30500	166,835.00	0.04
273	300611	美力科技	15700	165,949.00	0.04
274	600575	淮河能源	41800	165,946.00	0.04
275	000032	深桑达 A	9300	164,052.00	0.04
276	300960	通业科技	6500	163,800.00	0.04
277	000839	中信国安	53000	163,240.00	0.04
278	002123	梦网科技	15100	163,231.00	0.04
279	603195	公牛集团	2295	161,200.80	0.04
280	601808	中海油服	10500	160,125.00	0.04
281	300855	图南股份	7300	160,016.00	0.04
282	300919	中伟股份	4400	158,928.00	0.04
283	301165	锐捷网络	2200	158,840.00	0.04
284	688408	中信博	2200	158,400.00	0.04
285	688387	信科移动	26549	158,232.04	0.04
286	605080	浙江自然	6700	157,450.00	0.04
287	688269	凯立新材	6300	157,374.00	0.04
288	600295	鄂尔多斯	16100	157,136.00	0.04
289	603893	瑞芯微	1400	154,084.00	0.04
290	688249	晶合集成	6600	154,044.00	0.04
291	002459	晶澳科技	11100	152,625.00	0.04
292	001380	华纬科技	6968	152,599.20	0.04
293	002467	二六三	27600	152,352.00	0.04
294	601117	中国化学	18300	151,707.00	0.04

295	002085	万丰奥威	8000	151,600.00	0.04
296	688337	普源精电	3864	150,696.00	0.04
297	300346	南大光电	3900	150,501.00	0.04
298	002891	中宠股份	4200	149,940.00	0.04
299	688525	佰维存储	2400	148,728.00	0.04
300	688312	燕麦科技	4774	147,039.20	0.04
301	688361	中科飞测	1678	146,908.90	0.04
302	688076	诺泰生物	2800	145,376.00	0.04
303	000021	深科技	7600	144,856.00	0.04
304	600378	昊华科技	5000	144,550.00	0.04
305	688187	时代电气	3000	143,760.00	0.04
306	000807	云铝股份	10600	143,418.00	0.04
307	688111	金山办公	499	142,908.61	0.04
308	603596	伯特利	3200	142,688.00	0.04
309	600307	酒钢宏兴	89400	142,146.00	0.04
310	600859	王府井	9200	141,772.00	0.04
311	300604	长川科技	3200	141,216.00	0.04
312	688618	三旺通信	6708	140,935.08	0.04
313	600655	豫园股份	21800	140,174.00	0.04
314	603220	中贝通信	6100	140,117.00	0.04
315	601137	博威合金	6900	140,070.00	0.04
316	000959	首钢股份	45800	139,690.00	0.04
317	600060	海信视像	7000	139,580.00	0.04
318	300458	全志科技	3600	139,536.00	0.04
319	000703	恒逸石化	22200	139,416.00	0.04
320	603681	永冠新材	10800	139,212.00	0.04
321	300857	协创数据	1300	138,957.00	0.04
322	600363	联创光电	2900	138,852.00	0.04
323	002574	明牌珠宝	29800	137,378.00	0.04
324	002961	瑞达期货	9500	136,515.00	0.04
325	002550	千红制药	22000	136,400.00	0.04
326	688002	睿创微纳	2900	136,329.00	0.04
327	601966	玲珑轮胎	7500	135,300.00	0.04
328	601686	友发集团	24500	133,770.00	0.04
329	601799	星宇股份	1000	133,480.00	0.04
330	600419	天润乳业	14300	133,133.00	0.04
331	600968	海油发展	30800	131,516.00	0.04
332	600755	厦门国贸	19800	131,472.00	0.04
333	300677	英科医疗	5200	131,456.00	0.04
334	688313	仕佳光子	8000	131,120.00	0.04
335	002436	兴森科技	11800	131,098.00	0.04
336	300353	东土科技	11400	130,872.00	0.04
337	600563	法拉电子	1100	130,812.00	0.04

338	603609	禾丰股份	15100	130,162.00	0.04
339	601061	中信金属	17900	129,954.00	0.04
340	600111	北方稀土	6100	129,442.00	0.03
341	600905	三峡能源	29600	129,352.00	0.03
342	002221	东华能源	13600	129,064.00	0.03
343	300662	科锐国际	6100	128,466.00	0.03
344	300986	志特新材	10578	128,416.92	0.03
345	300800	力合科技	12300	128,289.00	0.03
346	688588	凌志软件	9279	128,050.20	0.03
347	688386	泛亚微透	4236	128,011.92	0.03
348	603221	爱丽家居	14000	127,820.00	0.03
349	002409	雅克科技	2200	127,490.00	0.03
350	300001	特锐德	5800	127,310.00	0.03
351	603005	晶方科技	4500	127,125.00	0.03
352	300373	扬杰科技	2900	126,208.00	0.03
353	605056	咸亨国际	10100	126,149.00	0.03
354	603129	春风动力	800	125,656.00	0.03
355	300851	交大思诺	4700	124,550.00	0.03
356	001203	大中矿业	14300	123,838.00	0.03
357	300498	温氏股份	7500	123,825.00	0.03
358	300947	德必集团	7800	123,786.00	0.03
359	300371	汇中股份	12900	123,711.00	0.03
360	301029	怡合达	5000	123,600.00	0.03
361	002126	银轮股份	6600	123,552.00	0.03
362	603385	惠达卫浴	19100	121,476.00	0.03
363	301056	森赫股份	14800	121,064.00	0.03
364	688521	芯原股份	2300	120,589.00	0.03
365	002416	爱施德	7400	120,398.00	0.03
366	688606	奥泰生物	1900	120,270.00	0.03
367	300679	电连技术	2000	119,400.00	0.03
368	002110	三钢闽光	35900	119,188.00	0.03
369	688205	德科立	1300	118,300.00	0.03
370	300666	江丰电子	1700	118,065.00	0.03
371	300783	三只松鼠	3200	117,984.00	0.03
372	601012	隆基绿能	7500	117,825.00	0.03
373	603993	洛阳钼业	17700	117,705.00	0.03
374	600236	桂冠电力	17300	117,640.00	0.03
375	300077	国民技术	4900	116,816.00	0.03
376	688347	华虹公司	2500	116,175.00	0.03
377	002402	和而泰	6400	115,904.00	0.03
378	600177	雅戈尔	13000	115,700.00	0.03
379	002139	拓邦股份	8500	115,685.00	0.03
380	000921	海信家电	4000	115,600.00	0.03

381	605111	新洁能	3400	115,294.00	0.03
382	300033	同花顺	400	115,000.00	0.03
383	603166	福达股份	15700	114,139.00	0.03
384	300446	航天智造	6900	113,919.00	0.03
385	601969	海南矿业	15900	112,731.00	0.03
386	600521	华海药业	6300	112,581.00	0.03
387	300620	光库科技	2300	111,780.00	0.03
388	000938	紫光股份	4000	111,320.00	0.03
389	603969	银龙股份	16400	110,864.00	0.03
390	600117	西宁特钢	49200	110,700.00	0.03
391	300563	神宇股份	2000	110,320.00	0.03
392	002478	常宝股份	20800	110,032.00	0.03
393	600198	大唐电信	12700	109,601.00	0.03
394	300623	捷捷微电	3200	109,312.00	0.03
395	601238	广汽集团	11700	109,278.00	0.03
396	300088	长信科技	16600	108,564.00	0.03
397	300292	吴通控股	22300	108,155.00	0.03
398	000717	中南股份	39300	106,896.00	0.03
399	600551	时代出版	12400	106,764.00	0.03
400	300296	利亚德	16400	105,616.00	0.03
401	603209	兴通股份	6600	105,468.00	0.03
402	000050	深天马 A	11600	104,748.00	0.03
403	688052	纳芯微	800	104,240.00	0.03
404	000829	天音控股	7900	104,122.00	0.03
405	605358	立昂微	4200	104,034.00	0.03
406	002461	珠江啤酒	10500	103,845.00	0.03
407	002479	富春环保	21900	103,806.00	0.03
408	600667	太极实业	15000	103,800.00	0.03
409	600759	洲际油气	45700	103,739.00	0.03
410	300590	移为通信	6700	103,582.00	0.03
411	601058	赛轮轮胎	7200	103,176.00	0.03
412	600776	东方通信	9200	102,948.00	0.03
413	688009	中国通号	16397	102,645.22	0.03
414	000039	中集集团	13200	102,564.00	0.03
415	300115	长盈精密	6300	102,312.00	0.03
416	300322	硕贝德	7800	102,258.00	0.03
417	600989	宝丰能源	6000	101,040.00	0.03
418	600150	中国船舶	2800	100,688.00	0.03
419	688037	芯源微	1200	100,356.00	0.03
420	002714	牧原股份	2600	99,944.00	0.03
421	600058	五矿发展	14000	99,680.00	0.03
422	600547	山东黄金	4400	99,572.00	0.03
423	603322	超讯通信	2600	98,800.00	0.03

424	000975	山金国际	6400	98,368.00	0.03
425	000983	山西焦煤	11900	98,056.00	0.03
426	000906	浙商中拓	14800	97,680.00	0.03
427	688322	奥比中光	2100	97,650.00	0.03
428	002929	润建股份	2900	97,498.00	0.03
429	002222	福晶科技	3000	97,200.00	0.03
430	605123	派克新材	1800	96,768.00	0.03
431	002508	老板电器	4500	96,435.00	0.03
432	600775	南京熊猫	9600	96,384.00	0.03
433	688385	复旦微电	2500	95,975.00	0.03
434	000887	中鼎股份	7300	95,776.00	0.03
435	688582	芯动联科	1900	95,589.00	0.03
436	002194	武汉凡谷	8500	95,370.00	0.03
437	002297	博云新材	13800	94,944.00	0.03
438	688279	峰昭科技	600	94,620.00	0.03
439	002155	湖南黄金	6000	94,380.00	0.03
440	688100	威胜信息	2600	94,120.00	0.03
441	688200	华峰测控	900	94,050.00	0.03
442	600699	均胜电子	6000	94,020.00	0.03
443	000977	浪潮信息	1800	93,384.00	0.03
444	600871	石化油服	45600	93,024.00	0.03
445	000951	中国重汽	5400	91,692.00	0.02
446	002913	奥士康	3800	91,618.00	0.02
447	301078	孩子王	8000	91,040.00	0.02
448	002897	意华股份	2200	90,970.00	0.02
449	000636	风华高科	6300	90,405.00	0.02
450	300025	华星创业	8400	90,300.00	0.02
451	603290	斯达半导	1000	89,820.00	0.02
452	300081	恒信东方	12500	89,750.00	0.02
453	603179	新泉股份	2100	89,670.00	0.02
454	600707	彩虹股份	10900	89,598.00	0.02
455	300213	佳讯飞鸿	11600	89,204.00	0.02
456	002408	齐翔腾达	17700	89,031.00	0.02
457	600339	中油工程	24800	88,784.00	0.02
458	300134	大富科技	7500	87,975.00	0.02
459	300613	富瀚微	1500	87,750.00	0.02
460	003816	中国广核	21200	87,556.00	0.02
461	688186	广大特材	5700	87,495.00	0.02
462	688418	震有科技	3000	87,480.00	0.02
463	601231	环旭电子	5300	87,450.00	0.02
464	600916	中国黄金	10100	87,062.00	0.02
465	600398	海澜之家	11600	87,000.00	0.02
466	603225	新风鸣	7800	86,814.00	0.02

467	000785	居然智家	24300	86,751.00	0.02
468	002947	恒铭达	2600	86,658.00	0.02
469	688220	翱捷科技	1600	86,544.00	0.02
470	002648	卫星化学	4600	86,434.00	0.02
471	603118	共进股份	9700	86,330.00	0.02
472	002128	电投能源	4400	86,152.00	0.02
473	002443	金洲管道	14600	85,848.00	0.02
474	002745	木林森	9700	84,584.00	0.02
475	300493	润欣科技	3000	84,390.00	0.02
476	600426	华鲁恒升	3900	84,279.00	0.02
477	300735	光弘科技	3000	83,970.00	0.02
478	002127	南极电商	19000	83,600.00	0.02
479	603619	中曼石油	4300	83,248.00	0.02
480	688772	珠海冠宇	5100	82,008.00	0.02
481	600206	有研新材	5200	81,484.00	0.02
482	002091	江苏国泰	11100	81,252.00	0.02
483	601777	力帆科技	10600	81,090.00	0.02
484	600581	八一钢铁	26400	81,048.00	0.02
485	688766	普冉股份	800	81,008.00	0.02
486	600877	电科芯片	6100	80,459.00	0.02
487	600688	上海石化	26500	80,030.00	0.02
488	600160	巨化股份	3300	79,596.00	0.02
489	601669	中国电建	14500	79,170.00	0.02
490	600009	上海机场	2300	78,545.00	0.02
491	300432	富临精工	5100	78,438.00	0.02
492	002045	国光电器	3600	78,084.00	0.02
493	688538	和辉光电	33573	77,889.36	0.02
494	002792	通宇通讯	5200	77,376.00	0.02
495	600089	特变电工	6060	77,204.40	0.02
496	688728	格科微	5700	76,608.00	0.02
497	300184	力源信息	8200	76,506.00	0.02
498	300752	隆利科技	4500	76,500.00	0.02
499	603920	世运电路	2600	76,440.00	0.02
500	688609	九联科技	7200	76,320.00	0.02
501	688123	聚辰股份	1300	76,076.00	0.02
502	300603	立昂技术	6800	75,752.00	0.02
503	688484	南芯科技	2100	75,684.00	0.02
504	002484	江海股份	4300	75,594.00	0.02
505	002179	中航光电	1900	74,670.00	0.02
506	002032	苏泊尔	1400	74,494.00	0.02
507	000801	四川九洲	5200	74,412.00	0.02
508	002601	龙佰集团	4200	74,214.00	0.02
509	601965	中国汽研	4200	74,004.00	0.02

510	603529	爱玛科技	1800	73,836.00	0.02
511	002017	东信和平	7100	73,627.00	0.02
512	601121	宝地矿业	10500	73,500.00	0.02
513	300672	国科微	1100	73,425.00	0.02
514	600489	中金黄金	6100	73,383.00	0.02
515	688127	蓝特光学	2700	73,170.00	0.02
516	600875	东方电气	4600	73,094.00	0.02
517	600166	福田汽车	29000	72,790.00	0.02
518	601111	中国国航	9200	72,772.00	0.02
519	002296	辉煌科技	7400	72,594.00	0.02
520	002429	兆驰股份	12500	72,250.00	0.02
521	603878	武进不锈	12600	72,072.00	0.02
522	601699	潞安环能	5000	71,800.00	0.02
523	688049	炬芯科技	1600	71,792.00	0.02
524	601869	长飞光纤	2400	71,736.00	0.02
525	300183	东软载波	3700	71,595.00	0.02
526	002036	联创电子	7600	71,440.00	0.02
527	300979	华利集团	900	70,785.00	0.02
528	002161	远望谷	12700	70,739.00	0.02
529	688183	生益电子	1800	70,668.00	0.02
530	688093	世华科技	3500	70,665.00	0.02
531	300131	英唐智控	8700	70,557.00	0.02
532	300456	赛微电子	4100	70,438.00	0.02
533	600570	恒生电子	2500	69,975.00	0.02
534	002387	维信诺	6800	69,904.00	0.02
535	002867	周大生	4800	69,744.00	0.02
536	688311	盟升电子	2100	69,531.00	0.02
537	300913	兆龙互连	1200	69,012.00	0.02
538	600029	南方航空	10500	68,145.00	0.02
539	300657	弘信电子	3000	67,980.00	0.02
540	002906	华阳集团	2200	67,650.00	0.02
541	688141	杰华特	2200	67,342.00	0.02
542	688498	源杰科技	500	67,100.00	0.02
543	002067	景兴纸业	16900	66,924.00	0.02
544	600515	海南机场	17700	66,906.00	0.02
545	600352	浙江龙盛	6500	66,885.00	0.02
546	002426	胜利精密	24900	66,732.00	0.02
547	002654	万润科技	5500	66,715.00	0.02
548	688159	有方科技	2200	66,528.00	0.02
549	300319	麦捷科技	5300	66,144.00	0.02
550	688591	泰凌微	2100	65,940.00	0.02
551	600011	华能国际	9700	65,669.00	0.02
552	600115	中国东航	16400	65,600.00	0.02

553	603766	隆鑫通用	7200	65,520.00	0.02
554	300303	聚飞光电	9600	65,472.00	0.02
555	600612	老凤祥	1200	65,124.00	0.02
556	600552	凯盛科技	5700	65,037.00	0.02
557	688536	思瑞浦	700	64,750.00	0.02
558	600436	片仔癀	300	64,350.00	0.02
559	002668	TCL 智家	4900	64,288.00	0.02
560	000521	长虹美菱	7800	63,648.00	0.02
561	688630	芯碁微装	1100	63,492.00	0.02
562	600694	大商股份	2400	63,288.00	0.02
563	603688	石英股份	2200	63,206.00	0.02
564	601360	三六零	6100	63,135.00	0.02
565	002709	天赐材料	3200	63,104.00	0.02
566	003031	中瓷电子	1200	62,868.00	0.02
567	688798	艾为电子	900	62,838.00	0.02
568	600130	波导股份	13300	62,776.00	0.02
569	688486	龙迅股份	800	62,432.00	0.02
570	600345	长江通信	2700	62,424.00	0.02
571	002003	伟星股份	4400	62,348.00	0.02
572	688409	富创精密	1200	61,884.00	0.02
573	603786	科博达	1000	61,800.00	0.02
574	603236	移远通信	900	61,596.00	0.02
575	600729	重庆百货	2100	61,425.00	0.02
576	002449	国星光电	4500	61,290.00	0.02
577	688191	智洋创新	3600	61,272.00	0.02
578	002148	北纬科技	9200	60,812.00	0.02
579	688150	莱特光电	2700	60,804.00	0.02
580	600569	安阳钢铁	32600	60,636.00	0.02
581	002681	奋达科技	9700	60,528.00	0.02
582	000761	本钢板材	18900	60,480.00	0.02
583	300053	航宇微	4600	60,214.00	0.02
584	688508	芯朋微	1400	60,158.00	0.02
585	688110	东芯股份	2400	59,760.00	0.02
586	300578	会畅通讯	3100	59,675.00	0.02
587	000933	神火股份	3500	59,150.00	0.02
588	000016	深康佳 A	10700	59,064.00	0.02
589	600619	海立股份	4800	58,560.00	0.02
590	600845	宝信软件	2000	58,520.00	0.02
591	605050	福然德	6000	58,200.00	0.02
592	000059	华锦股份	12100	57,959.00	0.02
593	601021	春秋航空	1000	57,670.00	0.02
594	300565	科信技术	4800	57,552.00	0.02
595	000501	武商集团	5500	57,530.00	0.02

596	603803	瑞斯康达	6000	57,240.00	0.02
597	603306	华懋科技	1800	56,898.00	0.02
598	000819	岳阳兴长	3400	56,882.00	0.02
599	002252	上海莱士	7800	56,316.00	0.02
600	300327	中颖电子	2300	56,281.00	0.02
601	688668	鼎通科技	1200	56,232.00	0.02
602	603997	继峰股份	4900	56,105.00	0.02
603	000408	藏格矿业	2000	55,460.00	0.01
604	688262	国芯科技	2000	55,400.00	0.01
605	600674	川投能源	3200	55,200.00	0.01
606	000727	冠捷科技	19800	55,044.00	0.01
607	000655	金岭矿业	8900	54,735.00	0.01
608	603009	北特科技	1400	54,712.00	0.01
609	000536	华映科技	12100	54,571.00	0.01
610	002640	跨境通	14200	54,528.00	0.01
611	002351	漫步者	3300	54,450.00	0.01
612	002079	苏州固锝	5300	54,431.00	0.01
613	001965	招商公路	3900	54,405.00	0.01
613	300046	台基股份	1500	54,405.00	0.01
614	002048	宁波华翔	4300	54,266.00	0.01
615	600231	凌钢股份	30300	54,237.00	0.01
616	000800	一汽解放	6600	54,120.00	0.01
617	603890	春秋电子	4600	54,050.00	0.01
618	688362	甬矽电子	1600	53,888.00	0.01
619	603958	哈森股份	3000	53,370.00	0.01
620	600718	东软集团	4900	52,773.00	0.01
621	002239	奥特佳	17300	52,765.00	0.01
622	001309	德明利	600	52,320.00	0.01
623	000559	万向钱潮	8500	52,275.00	0.01
624	688332	中科蓝讯	400	52,200.00	0.01
625	600933	爱柯迪	3200	52,160.00	0.01
626	002997	瑞鹄模具	1500	51,975.00	0.01
627	300102	乾照光电	5000	51,800.00	0.01
628	002697	红旗连锁	8700	51,417.00	0.01
629	002812	恩捷股份	1600	51,184.00	0.01
630	002488	金固股份	4900	51,156.00	0.01
631	002865	钧达股份	1000	51,100.00	0.01
632	688119	中钢洛耐	13079	51,008.10	0.01
633	301297	富乐德	1200	51,000.00	0.01
634	300050	世纪鼎利	9500	50,825.00	0.01
635	603605	珀莱雅	600	50,820.00	0.01
636	688271	联影医疗	400	50,560.00	0.01
637	688702	盛科通信	600	50,400.00	0.01

638	301358	湖南裕能	1100	49,852.00	0.01
639	603602	纵横通信	3100	49,600.00	0.01
640	002410	广联达	4200	49,392.00	0.01
641	688696	极米科技	500	49,010.00	0.01
642	300323	华灿光电	5900	48,852.00	0.01
643	300037	新宙邦	1300	48,672.00	0.01
644	301269	华大九天	400	48,440.00	0.01
645	300698	万马科技	1400	48,244.00	0.01
646	603366	日出东方	4100	48,011.00	0.01
647	300571	平治信息	1900	47,652.00	0.01
648	300304	云意电气	5900	47,200.00	0.01
649	300342	天银机电	2900	47,067.00	0.01
650	002106	莱宝高科	4300	46,913.00	0.01
651	300054	鼎龙股份	1800	46,836.00	0.01
652	601877	正泰电器	2000	46,820.00	0.01
653	600023	浙能电力	8200	46,412.00	0.01
654	000981	山子高科	23200	46,400.00	0.01
655	000980	众泰汽车	19400	46,366.00	0.01
656	002035	华帝股份	6300	46,242.00	0.01
657	300708	聚灿光电	3700	46,213.00	0.01
658	688400	凌云光	2100	46,032.00	0.01
659	300454	深信服	800	45,920.00	0.01
660	600582	天地科技	7400	45,732.00	0.01
661	301205	联特科技	600	45,414.00	0.01
662	600233	圆通速递	3200	45,408.00	0.01
663	600609	金杯汽车	6300	45,360.00	0.01
664	688475	萤石网络	1500	45,285.00	0.01
665	601216	君正集团	8600	45,236.00	0.01
666	688209	英集芯	2534	44,775.78	0.01
667	301191	菲菱科思	500	44,725.00	0.01
668	300232	洲明科技	6500	44,655.00	0.01
669	603260	合盛硅业	800	44,448.00	0.01
670	300073	当升科技	1100	44,308.00	0.01
671	300709	精研科技	1100	44,187.00	0.01
672	002284	亚太股份	5700	44,118.00	0.01
673	000670	盈方微	5300	44,096.00	0.01
674	300711	广哈通信	1900	43,985.00	0.01
675	300597	吉大通信	5000	43,750.00	0.01
676	688018	乐鑫科技	200	43,600.00	0.01
677	001208	华菱线缆	4800	43,584.00	0.01
678	688629	华丰科技	1300	43,537.00	0.01
679	600141	兴发集团	2000	43,400.00	0.01
680	300560	中富通	2800	43,344.00	0.01

680	600362	江西铜业	2100	43,344.00	0.01
681	300504	天邑股份	2400	43,272.00	0.01
682	688403	汇成股份	4800	43,008.00	0.01
683	000882	华联股份	20600	42,848.00	0.01
684	002832	比音勒芬	2000	42,820.00	0.01
685	002986	宇新股份	3600	42,768.00	0.01
686	688388	嘉元科技	2900	42,717.00	0.01
687	603380	易德龙	1700	42,483.00	0.01
688	300217	东方电热	9400	42,394.00	0.01
689	600143	金发科技	4900	42,336.00	0.01
690	688233	神工股份	1800	42,210.00	0.01
691	300888	稳健医疗	1000	42,080.00	0.01
692	688270	臻镭科技	1200	42,000.00	0.01
693	002815	崇达技术	4100	41,820.00	0.01
694	601003	柳钢股份	15100	41,676.00	0.01
695	603197	保隆科技	1100	41,525.00	0.01
696	300264	佳创视讯	7700	41,503.00	0.01
697	300256	星星科技	9400	41,172.00	0.01
698	002993	奥海科技	1000	41,000.00	0.01
699	605277	新亚电子	2900	40,919.00	0.01
700	300007	汉威科技	2000	40,900.00	0.01
701	600790	轻纺城	10900	40,875.00	0.01
702	001287	中电港	2000	40,620.00	0.01
703	000901	航天科技	3700	40,589.00	0.01
704	000968	蓝焰控股	6100	40,565.00	0.01
705	600486	扬农化工	700	40,509.00	0.01
706	002705	新宝股份	2700	40,500.00	0.01
707	002837	英维克	1000	40,400.00	0.01
707	301379	天山电子	2000	40,400.00	0.01
708	002796	世嘉科技	3600	40,392.00	0.01
709	605589	圣泉集团	1700	40,086.00	0.01
710	002635	安洁科技	2500	39,800.00	0.01
711	300959	线上线下	900	39,744.00	0.01
712	605599	菜百股份	3500	39,725.00	0.01
713	600391	航发科技	2000	39,700.00	0.01
714	301345	涛涛车业	600	39,660.00	0.01
715	603158	腾龙股份	4900	39,592.00	0.01
716	688699	明微电子	1100	39,534.00	0.01
717	300793	佳禾智能	2000	39,420.00	0.01
718	000786	北新建材	1300	39,403.00	0.01
719	000096	广聚能源	3200	39,232.00	0.01
720	002922	伊戈尔	2200	39,204.00	0.01
721	300128	锦富技术	7600	39,140.00	0.01

722	600480	凌云股份	3600	38,916.00	0.01
723	301039	中集车辆	4300	38,915.00	0.01
724	000034	神州数码	1100	38,555.00	0.01
725	688007	光峰科技	2600	38,454.00	0.01
726	300602	飞荣达	2000	38,440.00	0.01
727	002556	辉隆股份	6900	38,433.00	0.01
728	688593	新相微	2100	38,430.00	0.01
729	002077	大港股份	2600	38,142.00	0.01
730	002803	吉宏股份	3000	38,040.00	0.01
731	000733	振华科技	900	37,953.00	0.01
732	300921	南凌科技	1400	37,940.00	0.01
733	002454	松芝股份	5700	37,905.00	0.01
734	603800	洪田股份	1500	37,875.00	0.01
735	000541	佛山照明	6100	37,820.00	0.01
736	002379	宏创控股	4200	37,674.00	0.01
737	000417	合百集团	5900	37,642.00	0.01
738	002064	华峰化学	4600	37,628.00	0.01
739	000568	泸州老窖	300	37,560.00	0.01
740	300384	三联虹普	2000	37,240.00	0.01
741	601718	际华集团	13100	37,204.00	0.01
742	605378	野马电池	1800	37,080.00	0.01
743	300842	帝科股份	900	36,918.00	0.01
744	300390	天华新能	1600	36,880.00	0.01
745	300785	值得买	1100	36,850.00	0.01
746	600809	山西汾酒	200	36,842.00	0.01
747	603358	华达科技	1100	36,740.00	0.01
748	000151	中成股份	2600	36,686.00	0.01
749	603223	恒通股份	3500	36,680.00	0.01
750	002345	潮宏基	6300	36,603.00	0.01
751	600588	用友网络	3400	36,482.00	0.01
752	301095	广立微	700	36,449.00	0.01
753	688352	颀中科技	3000	36,390.00	0.01
754	002356	赫美集团	11000	36,190.00	0.01
755	002312	川发龙蟒	2500	36,175.00	0.01
756	600673	东阳光	3200	36,128.00	0.01
757	000913	钱江摩托	2000	36,020.00	0.01
758	600651	飞乐音响	8700	36,018.00	0.01
759	603595	东尼电子	2100	35,889.00	0.01
760	688380	中微半导	1200	35,880.00	0.01
761	300496	中科创达	600	35,736.00	0.01
762	688223	晶科能源	5013	35,642.43	0.01
763	002419	天虹股份	6000	35,160.00	0.01
764	688372	伟测科技	600	35,112.00	0.01

765	688800	瑞可达	700	35,077.00	0.01
766	300893	松原股份	1200	35,016.00	0.01
767	002344	海宁皮城	7500	34,875.00	0.01
768	300701	森霸传感	3400	34,850.00	0.01
769	600113	浙江东日	2500	34,800.00	0.01
770	000404	长虹华意	4700	34,780.00	0.01
771	600803	新奥股份	1600	34,688.00	0.01
772	000988	华工科技	800	34,640.00	0.01
773	600824	益民集团	7700	34,419.00	0.01
774	603040	新坐标	1500	34,380.00	0.01
775	603031	安孚科技	1200	34,320.00	0.01
776	300976	达瑞电子	500	34,250.00	0.01
777	301139	元道通信	1500	34,125.00	0.01
778	688172	燕东微	1700	34,085.00	0.01
779	300285	国瓷材料	2000	34,080.00	0.01
780	601366	利群股份	6700	33,902.00	0.01
781	603936	博敏电子	4000	33,680.00	0.01
782	688326	经纬恒润	400	33,640.00	0.01
783	300792	壹网壹创	1400	33,600.00	0.01
784	603328	依顿电子	3400	33,524.00	0.01
785	300487	蓝晓科技	700	33,509.00	0.01
786	300515	三德科技	2800	33,348.00	0.01
787	603508	思维列控	1400	33,292.00	0.01
788	300135	宝利国际	8400	33,264.00	0.01
789	600838	上海九百	3400	33,082.00	0.01
790	603206	嘉环科技	1900	33,022.00	0.01
791	600506	统一股份	1600	32,960.00	0.01
792	603738	泰晶科技	2200	32,956.00	0.01
793	002925	盈趣科技	2100	32,886.00	0.01
794	300403	汉字集团	3300	32,835.00	0.01
795	601010	文峰股份	11900	32,725.00	0.01
796	300975	商络电子	2900	32,625.00	0.01
797	600027	华电国际	5800	32,538.00	0.01
797	688107	安路科技	1100	32,538.00	0.01
798	002407	多氟多	2700	32,400.00	0.01
799	601113	华鼎股份	8300	32,370.00	0.01
800	002577	雷柏科技	1700	32,181.00	0.01
801	002510	天汽模	5500	32,120.00	0.01
802	300870	欧陆通	300	32,034.00	0.01
803	000823	超声电子	3100	31,992.00	0.01
804	000400	许继电气	1158	31,879.74	0.01
805	600482	中国动力	1300	31,811.00	0.01
806	002683	广东宏大	1200	31,776.00	0.01

807	600320	振华重工	8100	31,752.00	0.01
808	300825	阿尔特	2800	31,640.00	0.01
809	603305	旭升集团	2400	31,560.00	0.01
810	300566	激智科技	1600	31,552.00	0.01
811	000554	泰山石油	5300	31,482.00	0.01
812	002322	理工能科	2500	31,475.00	0.01
813	600278	东方创业	4500	31,455.00	0.01
814	600355	精伦电子	9200	31,372.00	0.01
815	600203	福日电子	3500	31,360.00	0.01
816	600026	中远海能	2700	31,320.00	0.01
817	301031	中熔电气	300	31,206.00	0.01
818	002859	洁美科技	1500	31,125.00	0.01
819	300568	星源材质	3200	31,104.00	0.01
820	688116	天奈科技	800	31,048.00	0.01
821	688065	凯赛生物	800	31,040.00	0.01
822	002119	康强电子	2000	30,960.00	0.01
823	600372	中航机载	2500	30,825.00	0.01
824	688698	伟创电气	700	30,800.00	0.01
825	301110	青木科技	500	30,770.00	0.01
826	000159	国际实业	5100	30,600.00	0.01
827	603788	宁波高发	2200	30,426.00	0.01
828	600336	澳柯玛	4500	30,420.00	0.01
829	002554	惠博普	12100	30,371.00	0.01
830	603773	沃格光电	1200	30,360.00	0.01
831	300414	中光防雷	3800	30,248.00	0.01
832	300580	贝斯特	1300	29,835.00	0.01
833	000957	中通客车	2700	29,700.00	0.01
833	688515	裕太微	300	29,700.00	0.01
834	000572	海马汽车	7100	29,678.00	0.01
835	688365	光云科技	2600	29,406.00	0.01
836	603039	泛微网络	600	29,400.00	0.01
836	688299	长阳科技	2000	29,400.00	0.01
837	002369	卓翼科技	4600	29,256.00	0.01
838	000903	云内动力	8500	29,240.00	0.01
839	600866	星湖科技	4500	29,115.00	0.01
840	603119	浙江荣泰	1300	29,107.00	0.01
841	688601	力芯微	700	29,001.00	0.01
842	300122	智飞生物	1100	28,930.00	0.01
843	600353	旭光电子	4000	28,880.00	0.01
844	002134	天津普林	1500	28,800.00	0.01
845	002563	森马服饰	4100	28,782.00	0.01
846	603035	常熟汽饰	2000	28,780.00	0.01
847	002561	徐家汇	3100	28,582.00	0.01

848	300113	顺网科技	1700	28,577.00	0.01
849	300710	万隆光电	1600	28,576.00	0.01
850	601717	郑煤机	2200	28,556.00	0.01
851	300755	华致酒行	1600	28,544.00	0.01
852	600025	华能水电	3000	28,530.00	0.01
853	688025	杰普特	600	28,500.00	0.01
854	002476	宝莫股份	6700	28,274.00	0.01
855	002876	三利谱	1100	28,226.00	0.01
856	000893	亚钾国际	1400	28,224.00	0.01
857	300582	英飞特	2000	28,160.00	0.01
858	603297	永新光学	300	28,146.00	0.01
859	605555	德昌股份	1300	28,132.00	0.01
860	688195	腾景科技	700	28,126.00	0.01
861	000700	模塑科技	4000	28,080.00	0.01
862	601399	国机重装	9100	28,028.00	0.01
863	688281	华秦科技	300	27,930.00	0.01
864	603809	豪能股份	2400	27,912.00	0.01
865	003010	若羽臣	1000	27,900.00	0.01
866	600628	新世界	3400	27,778.00	0.01
867	603072	天和磁材	2255	27,736.50	0.01
868	301511	德福科技	2200	27,632.00	0.01
869	603318	水发燃气	3800	27,360.00	0.01
870	603077	和邦生物	13400	27,336.00	0.01
871	301162	国能日新	600	27,300.00	0.01
872	688048	长光华芯	700	27,293.00	0.01
873	002845	同兴达	1800	27,288.00	0.01
874	301187	欧圣电气	800	27,280.00	0.01
875	301428	世纪恒通	700	27,125.00	0.01
876	688432	有研硅	2400	27,120.00	0.01
877	688088	虹软科技	700	26,992.00	0.01
878	002818	富森美	1800	26,892.00	0.01
879	002835	同为股份	1400	26,880.00	0.01
880	600237	铜峰电子	4100	26,855.00	0.01
881	002189	中光学	1300	26,754.00	0.01
882	688653	康希通信	2100	26,670.00	0.01
883	002765	蓝黛科技	3100	26,660.00	0.01
884	300227	光韵达	3200	26,656.00	0.01
885	002536	飞龙股份	2300	26,634.00	0.01
886	002283	天润工业	5000	26,600.00	0.01
886	600693	东百集团	3800	26,600.00	0.01
887	002042	华孚时尚	5900	26,550.00	0.01
887	600742	一汽富维	3000	26,550.00	0.01
888	300470	中密控股	700	26,390.00	0.01

889	002516	旷达科技	5200	26,364.00	0.01
890	002101	广东鸿图	2200	26,356.00	0.01
890	300680	隆盛科技	1100	26,356.00	0.01
891	301291	明阳电气	600	26,352.00	0.01
892	688181	八亿时空	800	26,320.00	0.01
893	300219	鸿利智汇	3500	26,215.00	0.01
894	000759	中百集团	2000	26,160.00	0.01
894	002430	杭氧股份	1200	26,160.00	0.01
895	300032	金龙机电	5800	26,158.00	0.01
896	688146	中船特气	900	26,136.00	0.01
897	002962	五方光电	1500	26,085.00	0.01
898	688360	德马科技	1400	26,012.00	0.01
899	300005	探路者	3700	25,937.00	0.01
900	300617	安靠智电	900	25,929.00	0.01
901	688711	宏微科技	1500	25,920.00	0.01
902	002242	九阳股份	2500	25,900.00	0.01
903	600517	国网英大	4700	25,897.00	0.01
904	002517	恺英网络	1900	25,859.00	0.01
905	002614	奥佳华	3900	25,818.00	0.01
906	002587	奥拓电子	4300	25,800.00	0.01
907	688628	优利德	700	25,788.00	0.01
908	300201	海伦哲	4900	25,774.00	0.01
909	300831	派瑞股份	1600	25,760.00	0.01
910	003015	日久光电	1800	25,758.00	0.01
911	688248	南网科技	800	25,672.00	0.01
912	688392	骄成超声	629	25,663.20	0.01
913	002676	顺威股份	4300	25,628.00	0.01
914	002708	光洋股份	2300	25,622.00	0.01
915	301348	蓝箭电子	1000	25,620.00	0.01
916	002884	凌霄泵业	1400	25,578.00	0.01
917	300896	爱美客	140	25,550.00	0.01
918	300777	中简科技	900	25,461.00	0.01
919	002758	浙农股份	2900	25,375.00	0.01
920	000528	柳工	2100	25,326.00	0.01
921	002579	中京电子	3200	25,280.00	0.01
922	600862	中航高科	1000	25,260.00	0.01
923	000422	湖北宜化	2000	25,240.00	0.01
924	002190	成飞集成	1300	25,142.00	0.01
925	300579	数字认证	800	25,136.00	0.01
926	300545	联得装备	800	25,064.00	0.01
927	688543	国科军工	500	25,060.00	0.01
928	603708	家家悦	2200	25,058.00	0.01
929	600071	凤凰光学	1200	25,020.00	0.01

930	000818	航锦科技	1300	24,830.00	0.01
931	688030	山石网科	1600	24,800.00	0.01
932	300307	慈星股份	3000	24,720.00	0.01
932	300968	格林精密	1500	24,720.00	0.01
933	603530	神马电力	1000	24,710.00	0.01
933	603583	捷昌驱动	1000	24,710.00	0.01
934	600280	中央商场	6000	24,660.00	0.01
935	603999	读者传媒	4000	24,600.00	0.01
936	002249	大洋电机	4180	24,536.60	0.01
937	002801	微光股份	1000	24,460.00	0.01
938	688510	航亚科技	1400	24,388.00	0.01
939	603699	纽威股份	1100	24,387.00	0.01
940	603337	杰克股份	800	24,368.00	0.01
941	688039	当虹科技	900	24,363.00	0.01
942	688597	煜邦电力	2500	24,325.00	0.01
943	300699	光威复材	700	24,255.00	0.01
944	300770	新媒股份	600	24,246.00	0.01
945	603703	盛洋科技	2200	24,222.00	0.01
946	300241	瑞丰光电	4400	24,156.00	0.01
947	603727	博迈科	2100	24,108.00	0.01
948	600633	浙数文化	2300	24,058.00	0.01
949	002380	科远智慧	1300	24,024.00	0.01
950	600800	渤海化学	7900	24,016.00	0.01
951	300247	融捷健康	6700	23,986.00	0.01
952	000538	云南白药	400	23,980.00	0.01
953	002959	小熊电器	500	23,955.00	0.01
954	301486	致尚科技	500	23,925.00	0.01
955	688663	新风光	1100	23,881.00	0.01
956	603100	川仪股份	1100	23,705.00	0.01
957	300691	联合光电	1200	23,664.00	0.01
958	301558	三态股份	2700	23,652.00	0.01
959	603638	艾迪精密	1400	23,646.00	0.01
960	301318	维海德	800	23,616.00	0.01
960	688330	宏力达	900	23,616.00	0.01
961	002662	京威股份	6100	23,607.00	0.01
962	301299	卓创资讯	400	23,568.00	0.01
963	002434	万里扬	3800	23,560.00	0.01
964	300996	普联软件	1300	23,556.00	0.01
965	002543	万和电气	2300	23,552.00	0.01
966	600261	阳光照明	7200	23,544.00	0.01
967	300360	炬华科技	1400	23,478.00	0.01
968	300743	天地数码	1540	23,454.20	0.01
969	688153	唯捷创芯	700	23,422.00	0.01

970	300766	每日互动	1600	23,376.00	0.01
971	002154	报喜鸟	5300	23,373.00	0.01
971	688376	美埃科技	700	23,373.00	0.01
972	603611	诺力股份	1300	23,335.00	0.01
973	688685	迈信林	700	23,233.00	0.01
974	600814	杭州解百	2800	23,212.00	0.01
975	002582	好想你	2800	23,184.00	0.01
976	002073	软控股份	2800	23,128.00	0.01
977	300514	友讯达	1600	23,104.00	0.01
978	300460	惠伦晶体	1900	23,066.00	0.01
979	002129	TCL 中环	2600	23,062.00	0.01
980	603379	三美股份	600	23,028.00	0.01
981	003019	宸展光电	900	23,022.00	0.01
982	300615	欣天科技	2000	22,980.00	0.01
983	300689	澄天伟业	900	22,968.00	0.01
983	688586	江航装备	2400	22,968.00	0.01
984	002967	广电计量	1400	22,960.00	0.01
984	688595	芯海科技	700	22,960.00	0.01
985	603025	大豪科技	1500	22,875.00	0.01
986	601116	三江购物	2100	22,848.00	0.01
987	002643	万润股份	1900	22,800.00	0.01
988	300445	康斯特	1400	22,778.00	0.01
989	688155	先惠技术	600	22,764.00	0.01
990	300768	迪普科技	1300	22,750.00	0.01
991	002703	浙江世宝	2000	22,740.00	0.01
992	688206	概伦电子	1200	22,692.00	0.01
993	688686	奥普特	300	22,683.00	0.01
994	002187	广百股份	3200	22,656.00	0.01
995	600114	东睦股份	1400	22,638.00	0.01
996	300263	隆华科技	3100	22,630.00	0.01
997	688128	中国电研	1071	22,501.71	0.01
998	603112	华翔股份	1800	22,500.00	0.01
999	002063	远光软件	3900	22,464.00	0.01
1000	300797	钢研纳克	1900	22,439.00	0.01
1001	300035	中科电气	1500	22,425.00	0.01
1002	300236	上海新阳	600	22,422.00	0.01
1003	002483	润邦股份	4300	22,403.00	0.01
1004	301262	海看股份	900	22,383.00	0.01
1005	603111	康尼机电	3700	22,311.00	0.01
1006	688535	华海诚科	300	22,305.00	0.01
1007	300048	合康新能	4400	22,176.00	0.01
1008	688503	聚和材料	500	22,145.00	0.01
1009	002153	石基信息	3100	22,134.00	0.01

1010	002606	大连电瓷	2400	22,128.00	0.01
1010	300769	德方纳米	600	22,128.00	0.01
1011	603068	博通集成	800	22,120.00	0.01
1012	300365	恒华科技	3600	22,104.00	0.01
1013	300771	智莱科技	2100	22,092.00	0.01
1014	688135	利扬芯片	1100	22,077.00	0.01
1015	300415	伊之密	1100	22,066.00	0.01
1016	688109	品茗科技	900	22,059.00	0.01
1017	688102	斯瑞新材	2500	22,050.00	0.01
1018	002111	威海广泰	2000	22,040.00	0.01
1018	600495	晋西车轴	5800	22,040.00	0.01
1019	001308	康冠科技	800	22,000.00	0.01
1020	603629	利通电子	1100	21,901.00	0.01
1021	688589	力合微	800	21,896.00	0.01
1022	600738	丽尚国潮	4400	21,868.00	0.01
1023	301550	斯菱股份	300	21,837.00	0.01
1024	000026	飞亚达	2100	21,777.00	0.01
1025	300946	恒而达	800	21,728.00	0.01
1026	002202	金风科技	2100	21,693.00	0.01
1027	300508	维宏股份	800	21,640.00	0.01
1028	603861	白云电器	2400	21,600.00	0.01
1029	301028	东亚机械	2000	21,580.00	0.01
1029	603680	今创集团	2600	21,580.00	0.01
1030	301183	东田微	400	21,520.00	0.01
1031	002376	新北洋	3300	21,516.00	0.01
1032	688147	微导纳米	800	21,512.00	0.01
1033	002782	可立克	1700	21,505.00	0.01
1034	301421	波长光电	400	21,468.00	0.01
1035	300150	世纪瑞尔	4900	21,462.00	0.01
1036	300507	苏奥传感	3200	21,440.00	0.01
1037	600981	汇鸿集团	8300	21,414.00	0.01
1038	688122	西部超导	500	21,410.00	0.01
1039	688596	正帆科技	600	21,330.00	0.01
1040	002843	泰嘉股份	1000	21,320.00	0.01
1041	603737	三棵树	500	21,300.00	0.01
1042	601868	中国能建	9300	21,297.00	0.01
1043	603296	华勤技术	300	21,285.00	0.01
1044	688381	帝奥微	1100	21,208.00	0.01
1045	002955	鸿合科技	900	21,168.00	0.01
1046	300228	富瑞特装	3000	21,150.00	0.01
1047	603392	万泰生物	300	21,138.00	0.01
1048	688083	中望软件	247	21,135.79	0.01
1049	301419	阿莱德	700	21,133.00	0.01

1050	000419	通程控股	3700	21,127.00	0.01
1051	300079	数码视讯	3900	21,099.00	0.01
1052	600596	新安股份	2400	21,072.00	0.01
1053	301383	天键股份	400	21,060.00	0.01
1054	301217	铜冠铜箔	1900	21,052.00	0.01
1055	300659	中孚信息	1300	21,047.00	0.01
1056	001391	国货航	3010	20,947.59	0.01
1057	300272	开能健康	3400	20,910.00	0.01
1058	002328	新朋股份	3400	20,842.00	0.01
1059	688512	慧智微	2100	20,811.00	0.01
1060	603868	飞科电器	500	20,760.00	0.01
1061	001314	亿道信息	400	20,740.00	0.01
1062	605136	丽人丽妆	2400	20,712.00	0.01
1063	603730	岱美股份	2300	20,677.00	0.01
1064	600326	西藏天路	3200	20,672.00	0.01
1065	603327	福蓉科技	1700	20,638.00	0.01
1066	001301	尚太科技	300	20,565.00	0.01
1067	600335	国机汽车	3300	20,559.00	0.01
1068	000698	沈阳化工	6100	20,557.00	0.01
1069	300894	火星人	1500	20,550.00	0.01
1070	002597	金禾实业	900	20,547.00	0.01
1071	603101	汇嘉时代	2200	20,526.00	0.01
1072	002290	禾盛新材	1200	20,520.00	0.01
1073	301381	赛维时代	900	20,484.00	0.01
1074	301489	思泉新材	300	20,472.00	0.01
1075	688305	科德数控	300	20,451.00	0.01
1076	600822	上海物贸	2000	20,440.00	0.01
1077	300151	昌红科技	1200	20,400.00	0.01
1078	600653	申华控股	9500	20,330.00	0.01
1079	688237	超卓航科	900	20,313.00	0.01
1080	603214	爱婴室	900	20,304.00	0.01
1081	002293	罗莱生活	2600	20,280.00	0.01
1081	002937	兴瑞科技	1200	20,280.00	0.01
1082	300180	华峰超纤	3200	20,160.00	0.01
1083	688095	福昕软件	300	20,148.00	0.01
1084	301285	鸿日达	700	20,076.00	0.01
1085	300279	和晶科技	3300	19,998.00	0.01
1086	688789	宏华数科	300	19,914.00	0.01
1087	000661	长春高新	200	19,888.00	0.01
1088	600879	航天电子	2200	19,712.00	0.01
1089	603319	湘油泵	1000	19,700.00	0.01
1090	002076	星光股份	8200	19,680.00	0.01
1090	300939	秋田微	600	19,680.00	0.01

1091	300127	银河磁体	800	19,664.00	0.01
1092	688458	美芯晟	600	19,650.00	0.01
1093	603883	老百姓	1200	19,644.00	0.01
1094	002612	朗姿股份	1200	19,632.00	0.01
1095	000902	新洋丰	1500	19,560.00	0.01
1096	002590	万安科技	1600	19,552.00	0.01
1097	002850	科达利	200	19,536.00	0.01
1098	688303	大全能源	806	19,456.84	0.01
1099	002327	富安娜	2200	19,448.00	0.01
1100	600987	航民股份	2800	19,432.00	0.01
1101	600858	银座股份	3500	19,425.00	0.01
1101	688188	柏楚电子	100	19,425.00	0.01
1102	002448	中原内配	3100	19,406.00	0.01
1103	300667	必创科技	1200	19,404.00	0.01
1104	002264	新华都	3100	19,158.00	0.01
1105	000045	深纺织 A	1800	19,134.00	0.01
1106	002074	国轩高科	900	19,098.00	0.01
1107	002215	诺普信	1700	19,091.00	0.01
1108	002615	哈尔斯	2400	19,080.00	0.01
1109	300647	超频三	3100	19,065.00	0.01
1110	300409	道氏技术	1400	19,054.00	0.01
1111	300910	瑞丰新材	400	19,036.00	0.01
1112	002418	康盛股份	7800	19,032.00	0.01
1113	301051	信濠光电	700	18,942.00	0.01
1114	000066	中国长城	1300	18,941.00	0.01
1115	603348	文灿股份	800	18,928.00	0.01
1116	600131	国网信通	1000	18,910.00	0.01
1117	600500	中化国际	4700	18,894.00	0.01
1118	300632	光莆股份	1700	18,853.00	0.01
1119	688173	希荻微	1700	18,836.00	0.01
1120	600373	中文传媒	1500	18,825.00	0.01
1121	002731	萃华珠宝	2000	18,780.00	0.01
1122	300655	晶瑞电材	2000	18,720.00	0.01
1123	600178	东安动力	1600	18,624.00	0.01
1124	000532	华金资本	1400	18,480.00	0.00
1125	605128	上海沿浦	500	18,475.00	0.00
1126	688401	路维光电	700	18,473.00	0.00
1127	688599	天合光能	956	18,450.80	0.00
1128	002403	爱仕达	1300	18,421.00	0.00
1129	300903	科翔股份	2300	18,377.00	0.00
1130	688035	德邦科技	500	18,375.00	0.00
1131	600760	中航沈飞	360	18,259.20	0.00
1132	688778	厦钨新能	400	18,256.00	0.00

1133	603989	艾华集团	1200	18,096.00	0.00
1134	603515	欧普照明	1100	18,095.00	0.00
1135	002083	孚日股份	3700	18,093.00	0.00
1136	301200	大族数控	500	18,090.00	0.00
1137	300956	英力股份	800	18,080.00	0.00
1137	601611	中国核建	2000	18,080.00	0.00
1138	603599	广信股份	1500	18,075.00	0.00
1138	688286	敏芯股份	300	18,075.00	0.00
1139	300576	容大感光	400	18,072.00	0.00
1140	301332	德尔玛	1800	18,036.00	0.00
1141	600697	欧亚集团	1400	17,990.00	0.00
1142	002422	科伦药业	600	17,958.00	0.00
1143	688368	晶丰明源	200	17,800.00	0.00
1144	000509	华塑控股	5300	17,649.00	0.00
1145	002677	浙江美大	2400	17,616.00	0.00
1146	600676	交运股份	3900	17,589.00	0.00
1147	605088	冠盛股份	700	17,556.00	0.00
1148	688259	创耀科技	500	17,555.00	0.00
1149	600730	中国高科	2900	17,545.00	0.00
1150	601599	浙文影业	4900	17,542.00	0.00
1151	001298	好上好	700	17,535.00	0.00
1152	300843	胜蓝股份	500	17,505.00	0.00
1153	603650	彤程新材	500	17,485.00	0.00
1154	603922	金鸿顺	700	17,458.00	0.00
1155	000030	富奥股份	3400	17,442.00	0.00
1156	300473	德尔股份	700	17,437.00	0.00
1157	300656	民德电子	700	17,416.00	0.00
1158	600196	复星医药	700	17,395.00	0.00
1159	301366	一博科技	400	17,364.00	0.00
1160	601678	滨化股份	4600	17,296.00	0.00
1161	002895	川恒股份	700	17,220.00	0.00
1162	002004	华邦健康	3800	17,176.00	0.00
1163	688010	福光股份	600	17,100.00	0.00
1164	300957	贝泰妮	400	17,076.00	0.00
1165	600630	龙头股份	1800	17,064.00	0.00
1166	688519	南亚新材	800	17,008.00	0.00
1167	000726	鲁泰 A	2600	16,952.00	0.00
1168	300516	久之洋	500	16,915.00	0.00
1169	603186	华正新材	700	16,863.00	0.00
1170	300706	阿石创	700	16,835.00	0.00
1171	002553	南方精工	1300	16,718.00	0.00
1172	301160	翔楼新材	300	16,680.00	0.00
1173	300739	明阳电路	1100	16,654.00	0.00

1174	603505	金石资源	700	16,618.00	0.00
1175	300162	雷曼光电	2200	16,566.00	0.00
1176	301007	德迈仕	900	16,542.00	0.00
1177	600328	中盐化工	2100	16,527.00	0.00
1178	300822	贝仕达克	800	16,520.00	0.00
1179	002660	茂硕电源	1600	16,512.00	0.00
1180	002539	云图控股	2100	16,422.00	0.00
1181	300347	泰格医药	300	16,386.00	0.00
1182	688678	福立旺	1100	16,335.00	0.00
1183	000868	安凯客车	3200	16,320.00	0.00
1183	002269	美邦服饰	8000	16,320.00	0.00
1184	000420	吉林化纤	4500	16,245.00	0.00
1185	600085	同仁堂	400	16,236.00	0.00
1186	600409	三友化工	3000	16,200.00	0.00
1187	300252	金信诺	1500	16,140.00	0.00
1188	603889	新澳股份	2300	16,123.00	0.00
1189	688235	百济神州	100	16,102.00	0.00
1190	300650	太龙股份	1400	16,100.00	0.00
1191	000589	贵州轮胎	3200	16,096.00	0.00
1192	300945	曼卡龙	1400	16,086.00	0.00
1193	603368	柳药集团	900	16,074.00	0.00
1194	301215	中汽股份	2700	16,065.00	0.00
1195	300258	精锻科技	1800	16,038.00	0.00
1196	688138	清溢光电	700	16,030.00	0.00
1197	605218	伟时电子	600	16,002.00	0.00
1198	000715	中兴商业	2300	15,985.00	0.00
1199	601568	北元集团	3800	15,960.00	0.00
1200	300694	蠡湖股份	1000	15,950.00	0.00
1201	603798	康普顿	1800	15,894.00	0.00
1202	603950	长源东谷	900	15,849.00	0.00
1203	600218	全柴动力	2000	15,800.00	0.00
1204	300994	久祺股份	1400	15,792.00	0.00
1205	300543	朗科智能	1500	15,720.00	0.00
1206	002860	星帅尔	1600	15,696.00	0.00
1207	600250	南京商旅	1700	15,657.00	0.00
1208	300911	亿田智能	600	15,648.00	0.00
1209	600397	安源煤业	3700	15,614.00	0.00
1210	603219	富佳股份	1100	15,587.00	0.00
1211	600854	春兰股份	3400	15,572.00	0.00
1212	002636	金安国纪	2000	15,480.00	0.00
1213	002855	捷荣技术	800	15,376.00	0.00
1214	002324	普利特	1600	15,248.00	0.00
1215	600315	上海家化	900	15,219.00	0.00

1216	002326	永太科技	1700	15,198.00	0.00
1217	603085	天成自控	1400	15,190.00	0.00
1218	002226	江南化工	2800	15,176.00	0.00
1219	600970	中材国际	1600	15,168.00	0.00
1220	002130	沃尔核材	600	15,150.00	0.00
1221	688548	广钢气体	1500	15,105.00	0.00
1222	301150	中一科技	700	15,008.00	0.00
1223	300916	朗特智能	500	15,000.00	0.00
1224	600057	厦门象屿	2300	14,927.00	0.00
1225	300577	开润股份	600	14,910.00	0.00
1226	300641	正丹股份	600	14,904.00	0.00
1227	002420	毅昌科技	2800	14,784.00	0.00
1227	600983	惠而浦	1600	14,784.00	0.00
1228	603227	雪峰科技	1700	14,773.00	0.00
1229	603281	江瀚新材	600	14,640.00	0.00
1230	000028	国药一致	500	14,625.00	0.00
1231	000701	厦门信达	3200	14,624.00	0.00
1232	301326	捷邦科技	200	14,620.00	0.00
1233	301035	润丰股份	300	14,616.00	0.00
1234	002025	航天电器	300	14,568.00	0.00
1235	300884	狄耐克	1300	14,534.00	0.00
1236	600439	瑞贝卡	4300	14,491.00	0.00
1237	600712	南宁百货	2000	14,460.00	0.00
1238	603353	和顺石油	900	14,445.00	0.00
1239	002552	宝鼎科技	1100	14,432.00	0.00
1240	603061	金海通	200	14,416.00	0.00
1241	002080	中材科技	1100	14,388.00	0.00
1242	688779	五矿新能	2700	14,364.00	0.00
1243	603659	璞泰来	900	14,319.00	0.00
1244	300909	汇创达	600	14,310.00	0.00
1245	300375	鹏翎股份	3100	14,291.00	0.00
1246	300072	海新能科	4000	14,200.00	0.00
1247	300832	新产业	200	14,170.00	0.00
1248	603303	得邦照明	1200	14,124.00	0.00
1249	688478	晶升股份	500	14,105.00	0.00
1250	002254	泰和新材	1500	14,100.00	0.00
1251	600458	时代新材	1100	14,091.00	0.00
1252	688139	海尔生物	400	14,080.00	0.00
1253	600079	人福医药	600	14,028.00	0.00
1254	300733	西菱动力	1200	14,004.00	0.00
1255	600063	皖维高新	3500	14,000.00	0.00
1255	603026	石大胜华	400	14,000.00	0.00
1255	603701	德宏股份	1000	14,000.00	0.00

1256	301251	威尔高	400	13,956.00	0.00
1257	300548	博创科技	300	13,923.00	0.00
1258	603551	奥普科技	1300	13,884.00	0.00
1259	000963	华东医药	400	13,840.00	0.00
1260	000626	远大控股	2400	13,800.00	0.00
1261	601865	福莱特	700	13,783.00	0.00
1262	301439	泓淋电力	1000	13,750.00	0.00
1263	002029	七匹狼	2100	13,734.00	0.00
1264	301387	光大同创	400	13,720.00	0.00
1264	603518	锦泓集团	1400	13,720.00	0.00
1265	300876	蒙泰高新	500	13,700.00	0.00
1266	601179	中国西电	1800	13,662.00	0.00
1267	603178	圣龙股份	700	13,587.00	0.00
1268	601208	东材科技	1800	13,572.00	0.00
1269	600698	湖南天雁	3000	13,560.00	0.00
1270	300868	杰美特	500	13,540.00	0.00
1271	688029	南微医学	200	13,518.00	0.00
1272	600100	同方股份	1900	13,509.00	0.00
1273	600527	江南高纤	6100	13,481.00	0.00
1274	688383	新益昌	300	13,461.00	0.00
1275	300863	卡倍亿	300	13,410.00	0.00
1276	603107	上海汽配	800	13,392.00	0.00
1277	603360	百傲化学	600	13,350.00	0.00
1278	603386	骏亚科技	1200	13,344.00	0.00
1279	603806	福斯特	900	13,320.00	0.00
1280	000999	华润三九	300	13,302.00	0.00
1281	300343	联创股份	2300	13,271.00	0.00
1282	300812	易天股份	600	13,224.00	0.00
1283	603679	华体科技	1000	13,170.00	0.00
1284	300389	艾比森	1100	13,101.00	0.00
1285	002170	芭田股份	1500	13,095.00	0.00
1286	000985	大庆华科	700	13,090.00	0.00
1287	002863	今飞凯达	2800	12,992.00	0.00
1288	300814	中富电路	400	12,968.00	0.00
1289	603558	健盛集团	1200	12,912.00	0.00
1290	600528	中铁工业	1600	12,896.00	0.00
1291	688639	华恒生物	400	12,884.00	0.00
1292	688300	联瑞新材	200	12,880.00	0.00
1293	300625	三雄极光	1100	12,826.00	0.00
1294	000850	华茂股份	3100	12,803.00	0.00
1295	600518	康美药业	5400	12,636.00	0.00
1296	605319	无锡振华	600	12,630.00	0.00
1297	600623	华谊集团	1800	12,600.00	0.00

1298	605365	立达信	800	12,560.00	0.00
1299	600299	安迪苏	1000	12,550.00	0.00
1300	000423	东阿阿胶	200	12,544.00	0.00
1301	002870	香山股份	400	12,520.00	0.00
1302	601339	百隆东方	2300	12,512.00	0.00
1303	603037	凯众股份	900	12,492.00	0.00
1304	600400	红豆股份	5000	12,450.00	0.00
1305	301099	雅创电子	300	12,435.00	0.00
1306	605499	东鹏饮料	50	12,426.00	0.00
1307	003043	华亚智能	300	12,420.00	0.00
1308	688055	龙腾光电	3000	12,390.00	0.00
1309	300067	安诺其	2000	12,340.00	0.00
1310	600255	鑫科材料	3600	12,312.00	0.00
1311	600161	天坛生物	600	12,300.00	0.00
1312	300707	威唐工业	800	12,296.00	0.00
1313	301123	奕东电子	600	12,270.00	0.00
1314	601500	通用股份	2300	12,259.00	0.00
1315	300686	智动力	1400	12,222.00	0.00
1316	300596	利安隆	400	12,200.00	0.00
1317	603612	索通发展	900	12,159.00	0.00
1318	300940	南极光	900	12,150.00	0.00
1319	603121	华培动力	1100	12,133.00	0.00
1320	002440	闰土股份	1800	12,078.00	0.00
1321	601163	三角轮胎	800	12,056.00	0.00
1322	301041	金百泽	500	12,000.00	0.00
1323	300429	强力新材	1000	11,990.00	0.00
1324	600960	渤海汽车	3600	11,988.00	0.00
1325	603013	亚普股份	800	11,984.00	0.00
1326	300978	东箭科技	1100	11,979.00	0.00
1327	605166	聚合顺	1000	11,970.00	0.00
1328	300951	博硕科技	400	11,948.00	0.00
1329	603215	比依股份	700	11,914.00	0.00
1330	688106	金宏气体	700	11,907.00	0.00
1331	002368	太极股份	500	11,840.00	0.00
1332	002725	跃岭股份	1100	11,803.00	0.00
1333	603917	合力科技	1000	11,750.00	0.00
1334	300824	北鼎股份	1200	11,736.00	0.00
1335	002727	一心堂	900	11,718.00	0.00
1336	301389	隆扬电子	700	11,704.00	0.00
1337	600666	奥瑞德	4600	11,684.00	0.00
1338	002274	华昌化工	1500	11,655.00	0.00
1339	300261	雅本化学	1700	11,645.00	0.00
1340	600389	江山股份	800	11,560.00	0.00

1341	301321	翰博高新	800	11,520.00	0.00
1341	600312	平高电气	600	11,520.00	0.00
1342	002108	沧州明珠	3200	11,488.00	0.00
1343	300808	久量股份	500	11,485.00	0.00
1344	600589	大位科技	2500	11,450.00	0.00
1345	000936	华西股份	1400	11,438.00	0.00
1346	603033	三维股份	900	11,421.00	0.00
1347	600332	白云山	400	11,368.00	0.00
1348	603067	振华股份	900	11,367.00	0.00
1349	600828	茂业商业	2600	11,362.00	0.00
1350	600075	新疆天业	2600	11,310.00	0.00
1351	000973	佛塑科技	1900	11,286.00	0.00
1352	002806	华锋股份	1000	11,280.00	0.00
1353	002363	隆基机械	1700	11,169.00	0.00
1354	603579	荣泰健康	770	11,165.00	0.00
1355	002404	嘉欣丝绸	1800	11,142.00	0.00
1356	688549	中巨芯	1300	11,076.00	0.00
1357	002588	史丹利	1500	11,070.00	0.00
1358	000678	襄阳轴承	1700	11,067.00	0.00
1359	301045	天禄科技	500	11,060.00	0.00
1360	301488	豪恩汽电	200	11,058.00	0.00
1361	300041	回天新材	1200	11,040.00	0.00
1362	600732	爱旭股份	1000	11,020.00	0.00
1363	003022	联泓新科	800	11,016.00	0.00
1363	300547	川环科技	400	11,016.00	0.00
1364	301322	绿通科技	500	10,990.00	0.00
1365	603311	金海高科	1100	10,989.00	0.00
1366	002386	天原股份	2400	10,968.00	0.00
1367	002223	鱼跃医疗	300	10,947.00	0.00
1368	301071	力量钻石	300	10,875.00	0.00
1369	002533	金杯电工	1100	10,824.00	0.00
1370	603239	浙江仙通	800	10,760.00	0.00
1371	003028	振邦智能	300	10,755.00	0.00
1372	002952	亚世光电	400	10,740.00	0.00
1373	300787	海能实业	800	10,736.00	0.00
1374	600955	维远股份	700	10,689.00	0.00
1375	000523	红棉股份	3500	10,675.00	0.00
1376	688550	瑞联新材	341	10,669.89	0.00
1377	002009	天奇股份	700	10,654.00	0.00
1378	002068	黑猫股份	1000	10,640.00	0.00
1378	002724	海洋王	2000	10,640.00	0.00
1379	301121	紫建电子	200	10,612.00	0.00
1380	688020	方邦股份	300	10,605.00	0.00

1381	603685	晨丰科技	900	10,584.00	0.00
1382	601086	国芳集团	1800	10,566.00	0.00
1383	300320	海达股份	1100	10,560.00	0.00
1383	688690	纳微科技	600	10,560.00	0.00
1384	688598	金博股份	500	10,530.00	0.00
1385	300852	四会富仕	400	10,488.00	0.00
1386	301369	联动科技	200	10,476.00	0.00
1387	000925	众合科技	1200	10,404.00	0.00
1388	603181	皇马科技	900	10,377.00	0.00
1389	603877	太平鸟	700	10,360.00	0.00
1389	603906	龙蟠科技	1000	10,360.00	0.00
1389	603977	国泰集团	800	10,360.00	0.00
1390	002361	神剑股份	1900	10,355.00	0.00
1391	300991	创益通	500	10,345.00	0.00
1392	001311	多利科技	400	10,316.00	0.00
1393	300174	元力股份	700	10,304.00	0.00
1394	301397	溯联股份	400	10,300.00	0.00
1395	300759	康龙化成	400	10,280.00	0.00
1396	603010	万盛股份	1000	10,270.00	0.00
1397	600081	东风科技	1000	10,250.00	0.00
1398	002585	双星新材	1900	10,146.00	0.00
1399	002780	三夫户外	800	10,120.00	0.00
1400	300821	东岳硅材	1300	10,088.00	0.00
1401	002125	湘潭电化	1000	10,080.00	0.00
1402	600929	雪天盐业	1800	10,062.00	0.00
1403	001319	铭科精技	400	10,060.00	0.00
1404	603078	江化微	600	10,044.00	0.00
1405	688683	莱尔科技	500	9,930.00	0.00
1406	002258	利尔化学	1200	9,924.00	0.00
1407	002250	联化科技	1800	9,918.00	0.00
1408	600062	华润双鹤	500	9,900.00	0.00
1409	603390	通达电气	900	9,882.00	0.00
1410	300928	华安鑫创	300	9,867.00	0.00
1411	688707	振华新材	900	9,855.00	0.00
1412	002983	芯瑞达	500	9,820.00	0.00
1413	603286	日盈电子	500	9,790.00	0.00
1414	603867	新化股份	400	9,752.00	0.00
1415	603365	水星家纺	600	9,720.00	0.00
1416	002455	百川股份	1300	9,711.00	0.00
1417	300121	阳谷华泰	800	9,672.00	0.00
1418	688275	万润新能	200	9,666.00	0.00
1419	300142	沃森生物	800	9,664.00	0.00
1420	603826	坤彩科技	500	9,625.00	0.00

1421	300155	安居宝	2000	9,580.00	0.00
1422	300643	万通智控	800	9,568.00	0.00
1423	002390	信邦制药	2100	9,555.00	0.00
1424	000731	四川美丰	1300	9,542.00	0.00
1425	688079	美迪凯	1100	9,526.00	0.00
1426	000955	欣龙控股	2300	9,522.00	0.00
1427	603578	三星新材	800	9,480.00	0.00
1428	301238	瑞泰新材	600	9,396.00	0.00
1429	603933	睿能科技	600	9,324.00	0.00
1430	002294	信立泰	300	9,279.00	0.00
1431	300587	天铁股份	2100	9,219.00	0.00
1432	002888	惠威科技	500	9,210.00	0.00
1433	001267	汇绿生态	1200	9,168.00	0.00
1434	002545	东方铁塔	1300	9,139.00	0.00
1435	600271	航天信息	1000	9,110.00	0.00
1436	605258	协和电子	300	9,105.00	0.00
1437	688050	爱博医疗	100	9,103.00	0.00
1438	000719	中原传媒	800	9,088.00	0.00
1439	603758	秦安股份	1100	9,086.00	0.00
1440	300806	斯迪克	700	9,065.00	0.00
1441	601101	昊华能源	1100	9,053.00	0.00
1442	002394	联发股份	1200	9,024.00	0.00
1443	002199	东晶电子	1200	8,988.00	0.00
1444	300684	中石科技	400	8,972.00	0.00
1445	600148	长春一东	500	8,970.00	0.00
1446	603187	海容冷链	800	8,952.00	0.00
1447	300652	雷迪克	300	8,916.00	0.00
1448	603299	苏盐井神	800	8,912.00	0.00
1449	002715	登云股份	600	8,910.00	0.00
1450	600763	通策医疗	200	8,880.00	0.00
1450	600889	南京化纤	500	8,880.00	0.00
1451	603900	莱绅通灵	1600	8,848.00	0.00
1452	000949	新乡化纤	2200	8,822.00	0.00
1453	603087	甘李药业	200	8,820.00	0.00
1454	300019	硅宝科技	600	8,784.00	0.00
1455	002759	天际股份	1000	8,770.00	0.00
1456	688216	气派科技	400	8,712.00	0.00
1457	002206	海利得	2000	8,580.00	0.00
1458	000878	云南铜业	700	8,533.00	0.00
1459	000822	山东海化	1500	8,520.00	0.00
1460	301487	盟固利	400	8,508.00	0.00
1461	688053	思科瑞	300	8,490.00	0.00
1462	688689	银河微电	400	8,476.00	0.00

1463	002263	大东南	3400	8,432.00	0.00
1464	002007	华兰生物	500	8,425.00	0.00
1465	301329	信音电子	400	8,420.00	0.00
1466	601566	九牧王	1000	8,410.00	0.00
1467	601607	上海医药	400	8,400.00	0.00
1468	688260	昀冢科技	600	8,370.00	0.00
1469	002687	乔治白	1900	8,322.00	0.00
1470	002096	易普力	700	8,316.00	0.00
1471	301298	东利机械	600	8,268.00	0.00
1472	002741	光华科技	500	8,260.00	0.00
1473	603767	中马传动	700	8,246.00	0.00
1474	600865	百大集团	700	8,239.00	0.00
1475	002491	通鼎互联	1600	8,224.00	0.00
1476	600765	中航重机	400	8,188.00	0.00
1477	603194	中力股份	291	8,185.83	0.00
1478	300969	恒帅股份	100	8,167.00	0.00
1479	002432	九安医疗	200	8,156.00	0.00
1480	605588	冠石科技	200	8,152.00	0.00
1481	002783	凯龙股份	1000	8,150.00	0.00
1482	300586	美联新材	1000	8,140.00	0.00
1483	605020	永和股份	400	8,132.00	0.00
1484	600810	神马股份	1000	8,090.00	0.00
1485	603002	宏昌电子	1500	8,055.00	0.00
1486	688212	澳华内镜	200	8,036.00	0.00
1487	688091	上海谊众	200	7,984.00	0.00
1488	002053	云南能投	700	7,980.00	0.00
1489	603663	三祥新材	500	7,975.00	0.00
1490	300740	水羊股份	600	7,932.00	0.00
1490	605058	澳弘电子	400	7,932.00	0.00
1491	600099	林海股份	900	7,920.00	0.00
1492	002584	西陇科学	1100	7,909.00	0.00
1493	002637	赞宇科技	800	7,880.00	0.00
1494	300591	万里马	1900	7,809.00	0.00
1495	003016	欣贺股份	900	7,785.00	0.00
1496	603116	红蜻蜓	1400	7,770.00	0.00
1497	600529	山东药玻	300	7,731.00	0.00
1498	001331	胜通能源	700	7,707.00	0.00
1499	605336	帅丰电器	600	7,704.00	0.00
1500	002094	青岛金王	1400	7,700.00	0.00
1501	300856	科思股份	300	7,686.00	0.00
1502	601279	英利汽车	2000	7,660.00	0.00
1503	003004	声迅股份	300	7,617.00	0.00
1504	002821	凯莱英	100	7,609.00	0.00

1505	000513	丽珠集团	200	7,600.00	0.00
1506	002674	兴业科技	800	7,592.00	0.00
1507	300936	中英科技	200	7,560.00	0.00
1507	603587	地素时尚	600	7,560.00	0.00
1507	688733	壹石通	400	7,560.00	0.00
1508	301371	敷尔佳	200	7,558.00	0.00
1509	605228	神通科技	700	7,553.00	0.00
1510	300107	建新股份	800	7,552.00	0.00
1511	300481	濮阳惠成	500	7,410.00	0.00
1512	300985	致远新能	400	7,364.00	0.00
1513	605077	华康股份	500	7,360.00	0.00
1514	688278	特宝生物	100	7,337.00	0.00
1515	002262	恩华药业	300	7,305.00	0.00
1516	603655	朗博科技	300	7,287.00	0.00
1517	603161	科华控股	700	7,273.00	0.00
1518	688520	神州细胞	200	7,246.00	0.00
1519	603939	益丰药房	300	7,239.00	0.00
1520	603586	金麒麟	500	7,235.00	0.00
1521	300918	南山智尚	700	7,217.00	0.00
1522	300505	川金诺	500	7,200.00	0.00
1522	603110	东方材料	500	7,200.00	0.00
1523	300758	七彩化学	600	7,188.00	0.00
1524	300964	本川智能	200	7,180.00	0.00
1525	603982	泉峰汽车	900	7,164.00	0.00
1526	300796	贝斯美	700	7,147.00	0.00
1527	603212	赛伍技术	700	7,126.00	0.00
1528	605118	力鼎光电	400	7,124.00	0.00
1529	300901	中胤时尚	600	7,116.00	0.00
1530	002749	国光股份	500	7,110.00	0.00
1530	600685	中船防务	300	7,110.00	0.00
1531	603926	铁流股份	800	7,080.00	0.00
1532	688425	铁建重工	1600	7,040.00	0.00
1533	000912	泸天化	1600	7,008.00	0.00
1533	300221	银禧科技	1200	7,008.00	0.00
1534	002981	朝阳科技	300	6,996.00	0.00
1535	603808	歌力思	1000	6,990.00	0.00
1536	300573	兴齐眼药	100	6,978.00	0.00
1537	688610	埃科光电	200	6,940.00	0.00
1538	600367	红星发展	600	6,924.00	0.00
1539	002768	国恩股份	300	6,921.00	0.00
1539	605266	健之佳	300	6,921.00	0.00
1540	002224	三力士	1600	6,912.00	0.00
1541	002044	美年健康	1500	6,885.00	0.00

1542	300532	今天国际	600	6,852.00	0.00
1543	600511	国药股份	200	6,844.00	0.00
1544	600731	湖南海利	1200	6,840.00	0.00
1545	300003	乐普医疗	600	6,804.00	0.00
1546	002562	兄弟科技	1600	6,800.00	0.00
1547	603677	奇精机械	500	6,740.00	0.00
1547	605183	确成股份	400	6,740.00	0.00
1548	603190	亚通精工	300	6,726.00	0.00
1549	603196	日播时尚	500	6,725.00	0.00
1550	002813	路畅科技	300	6,699.00	0.00
1551	300230	永利股份	1500	6,675.00	0.00
1552	600727	鲁北化工	900	6,669.00	0.00
1553	600691	阳煤化工	3000	6,660.00	0.00
1554	002886	沃特股份	400	6,648.00	0.00
1554	688456	有研粉材	200	6,648.00	0.00
1555	000707	双环科技	900	6,642.00	0.00
1556	002763	汇洁股份	1000	6,640.00	0.00
1557	600702	舍得酒业	100	6,593.00	0.00
1558	600601	方正科技	1500	6,585.00	0.00
1559	301152	天力锂能	200	6,570.00	0.00
1560	002453	华软科技	1300	6,565.00	0.00
1561	002976	瑞玛精密	300	6,561.00	0.00
1562	600227	赤天化	2700	6,534.00	0.00
1563	605005	合兴股份	400	6,520.00	0.00
1564	001278	一彬科技	400	6,500.00	0.00
1565	603983	丸美生物	200	6,452.00	0.00
1566	600230	沧州大化	600	6,432.00	0.00
1567	002810	山东赫达	500	6,425.00	0.00
1568	002165	红宝丽	1500	6,420.00	0.00
1569	300132	青松股份	1300	6,409.00	0.00
1570	002603	以岭药业	400	6,404.00	0.00
1571	688045	必易微	200	6,380.00	0.00
1572	000766	通化金马	400	6,280.00	0.00
1573	002992	宝明科技	100	6,260.00	0.00
1574	603787	新日股份	600	6,252.00	0.00
1575	688266	泽璟制药	100	6,231.00	0.00
1576	002632	道明光学	700	6,230.00	0.00
1577	000020	深华发 A	500	6,210.00	0.00
1578	300218	安利股份	400	6,160.00	0.00
1579	000677	恒天海龙	1500	6,150.00	0.00
1580	605018	长华集团	700	6,146.00	0.00
1581	600998	九州通	1200	6,144.00	0.00
1582	605188	国光连锁	800	6,112.00	0.00

1583	300169	天晟新材	800	6,088.00	0.00
1584	300294	博雅生物	200	6,056.00	0.00
1585	300890	翔丰华	200	6,052.00	0.00
1586	688166	博瑞医药	200	6,040.00	0.00
1587	000553	安道麦 A	900	6,012.00	0.00
1588	603768	常青股份	500	6,010.00	0.00
1589	300255	常山药业	300	5,997.00	0.00
1590	688578	艾力斯	100	5,990.00	0.00
1591	688295	中复神鹰	300	5,979.00	0.00
1592	688793	倍轻松	200	5,960.00	0.00
1593	002805	丰元股份	500	5,950.00	0.00
1594	300537	广信材料	300	5,934.00	0.00
1595	600135	乐凯胶片	900	5,931.00	0.00
1596	301069	凯盛新材	400	5,928.00	0.00
1597	600618	氯碱化工	600	5,916.00	0.00
1598	002838	道恩股份	500	5,905.00	0.00
1599	688298	东方生物	200	5,866.00	0.00
1600	002522	浙江众成	1500	5,865.00	0.00
1601	600566	济川药业	200	5,816.00	0.00
1602	600078	澄星股份	1000	5,800.00	0.00
1603	300200	高盟新材	700	5,796.00	0.00
1604	600535	天士力	400	5,784.00	0.00
1605	002669	康达新材	600	5,778.00	0.00
1606	000599	青岛双星	1300	5,772.00	0.00
1607	600232	金鹰股份	1100	5,753.00	0.00
1608	301529	福赛科技	200	5,752.00	0.00
1609	600764	中国海防	200	5,664.00	0.00
1610	300082	奥克股份	900	5,643.00	0.00
1611	600867	通化东宝	700	5,642.00	0.00
1612	300829	金丹科技	300	5,637.00	0.00
1613	600380	健康元	500	5,635.00	0.00
1614	002971	和远气体	300	5,625.00	0.00
1615	600746	江苏索普	800	5,608.00	0.00
1616	600497	驰宏锌锗	1000	5,570.00	0.00
1617	603228	景旺电子	200	5,568.00	0.00
1618	000657	中钨高新	600	5,526.00	0.00
1619	688179	阿拉丁	400	5,520.00	0.00
1620	002549	凯美特气	900	5,517.00	0.00
1621	002240	盛新锂能	400	5,512.00	0.00
1622	002391	长青股份	1100	5,511.00	0.00
1623	002694	顾地科技	1200	5,496.00	0.00
1624	688180	君实生物	200	5,466.00	0.00
1625	600118	中国卫星	200	5,460.00	0.00

1625	600470	六国化工	1000	5,460.00	0.00
1626	301325	曼恩斯特	100	5,419.00	0.00
1627	603020	爱普股份	700	5,418.00	0.00
1628	300558	贝达药业	100	5,393.00	0.00
1629	603089	正裕工业	600	5,382.00	0.00
1630	605068	明新旭腾	400	5,380.00	0.00
1631	603601	再升科技	1600	5,376.00	0.00
1632	003033	征和工业	200	5,370.00	0.00
1633	000920	沃顿科技	600	5,352.00	0.00
1634	300765	新诺威	200	5,318.00	0.00
1635	601065	江盐集团	600	5,262.00	0.00
1636	301206	三元生物	200	5,242.00	0.00
1637	600785	新华百货	400	5,228.00	0.00
1638	600993	马应龙	200	5,222.00	0.00
1639	603991	至正股份	100	5,220.00	0.00
1640	300741	华宝股份	300	5,217.00	0.00
1641	603006	联明股份	500	5,215.00	0.00
1642	300905	宝丽迪	200	5,212.00	0.00
1643	603686	福龙马	500	5,200.00	0.00
1644	300009	安科生物	600	5,184.00	0.00
1644	603238	诺邦股份	400	5,184.00	0.00
1645	300298	三诺生物	200	5,162.00	0.00
1646	300199	翰宇药业	400	5,156.00	0.00
1647	300601	康泰生物	300	5,145.00	0.00
1648	300847	中船汉光	300	5,142.00	0.00
1649	688219	会通股份	500	5,130.00	0.00
1650	002915	中欣氟材	400	5,112.00	0.00
1651	688363	华熙生物	100	5,104.00	0.00
1652	600610	中毅达	1200	5,076.00	0.00
1653	605016	百龙创园	300	5,070.00	0.00
1654	000510	新金路	1400	5,040.00	0.00
1655	688443	智翔金泰	200	5,018.00	0.00
1656	300622	博士眼镜	100	4,980.00	0.00
1657	300522	世名科技	400	4,956.00	0.00
1658	002395	双象股份	300	4,953.00	0.00
1659	600129	太极集团	200	4,944.00	0.00
1660	600469	风神股份	800	4,928.00	0.00
1661	600579	克劳斯	400	4,880.00	0.00
1662	000739	普洛药业	300	4,878.00	0.00
1663	603822	嘉澳环保	100	4,876.00	0.00
1664	300848	美瑞新材	300	4,875.00	0.00
1665	002317	众生药业	400	4,860.00	0.00
1666	301090	华润材料	700	4,858.00	0.00

1667	300575	中旗股份	800	4,856.00	0.00
1668	002442	龙星化工	800	4,808.00	0.00
1669	605151	西上海	300	4,803.00	0.00
1670	603949	雪龙集团	400	4,796.00	0.00
1671	300109	新开源	300	4,785.00	0.00
1672	002734	利民股份	600	4,782.00	0.00
1673	002917	金奥博	500	4,780.00	0.00
1674	300340	科恒股份	500	4,765.00	0.00
1675	002109	兴化股份	1500	4,755.00	0.00
1675	600422	昆药集团	300	4,755.00	0.00
1675	601811	新华文轩	300	4,755.00	0.00
1676	001289	龙源电力	300	4,713.00	0.00
1677	688114	华大智造	100	4,679.00	0.00
1678	603193	润本股份	200	4,670.00	0.00
1679	002381	双箭股份	700	4,662.00	0.00
1680	002054	德美化工	800	4,648.00	0.00
1681	603931	格林达	200	4,638.00	0.00
1682	300181	佐力药业	300	4,608.00	0.00
1683	001378	德冠新材	200	4,584.00	0.00
1684	300980	祥源新材	200	4,580.00	0.00
1685	000782	恒申新材	1000	4,560.00	0.00
1685	300685	艾德生物	200	4,560.00	0.00
1686	600750	江中药业	200	4,540.00	0.00
1686	688289	圣湘生物	200	4,540.00	0.00
1687	600935	华塑股份	1800	4,536.00	0.00
1688	688199	久日新材	300	4,515.00	0.00
1689	003002	壶化股份	200	4,512.00	0.00
1690	603916	苏博特	600	4,476.00	0.00
1691	300695	兆丰股份	100	4,460.00	0.00
1692	688148	芳源股份	900	4,455.00	0.00
1693	600056	中国医药	400	4,440.00	0.00
1694	603330	天洋新材	700	4,438.00	0.00
1695	600285	羚锐制药	200	4,432.00	0.00
1696	603130	云中马	200	4,430.00	0.00
1697	603908	牧高笛	200	4,420.00	0.00
1698	000503	国新健康	400	4,392.00	0.00
1699	300644	南京聚隆	200	4,372.00	0.00
1700	603658	安图生物	100	4,364.00	0.00
1701	002666	德联集团	1000	4,360.00	0.00
1702	301293	三博脑科	100	4,328.00	0.00
1703	300731	科创新源	200	4,322.00	0.00
1704	300798	锦鸡股份	600	4,290.00	0.00
1705	002019	亿帆医药	400	4,288.00	0.00

1706	601991	大唐发电	1500	4,275.00	0.00
1707	603970	中农立华	300	4,260.00	0.00
1708	002319	乐通股份	400	4,252.00	0.00
1709	000403	派林生物	200	4,226.00	0.00
1710	000516	国际医学	800	4,224.00	0.00
1711	605488	福莱新材	200	4,222.00	0.00
1712	603722	阿科力	100	4,200.00	0.00
1713	300676	华大基因	100	4,197.00	0.00
1714	600572	康恩贝	900	4,194.00	0.00
1715	002427	尤夫股份	1200	4,176.00	0.00
1716	600976	健民集团	100	4,168.00	0.00
1717	688192	迪哲医药	100	4,147.00	0.00
1718	603630	拉芳家化	300	4,134.00	0.00
1719	600423	柳化股份	1400	4,116.00	0.00
1720	603456	九洲药业	300	4,104.00	0.00
1721	002939	长城证券	500	4,100.00	0.00
1722	300891	惠云钛业	500	4,085.00	0.00
1723	600249	两面针	800	4,072.00	0.00
1724	301276	嘉曼服饰	200	4,070.00	0.00
1725	300387	富邦股份	500	4,000.00	0.00
1725	300610	晨化股份	400	4,000.00	0.00
1726	301323	新莱福	100	3,987.00	0.00
1727	603707	健友股份	300	3,981.00	0.00
1728	002332	仙琚制药	400	3,976.00	0.00
1729	002773	康弘药业	200	3,920.00	0.00
1729	301036	双乐股份	100	3,920.00	0.00
1730	300214	日科化学	700	3,913.00	0.00
1731	002136	安纳达	400	3,900.00	0.00
1731	300819	聚杰微纤	300	3,900.00	0.00
1731	603511	爱慕股份	300	3,900.00	0.00
1732	600714	金瑞矿业	400	3,888.00	0.00
1733	001207	联科科技	200	3,878.00	0.00
1734	688177	百奥泰	200	3,876.00	0.00
1735	603839	安正时尚	700	3,864.00	0.00
1735	605138	盛泰集团	700	3,864.00	0.00
1736	600645	中源协和	200	3,860.00	0.00
1737	600038	中直股份	100	3,856.00	0.00
1738	002020	京新药业	300	3,840.00	0.00
1738	600844	丹化科技	1500	3,840.00	0.00
1738	603125	常青科技	200	3,840.00	0.00
1739	688560	明冠新材	300	3,837.00	0.00
1740	300747	锐科激光	200	3,832.00	0.00
1741	688722	同益中	300	3,825.00	0.00

1742	600789	鲁抗医药	400	3,820.00	0.00
1743	603188	亚邦股份	1100	3,817.00	0.00
1744	300243	瑞丰高材	400	3,808.00	0.00
1745	300026	红日药业	1000	3,790.00	0.00
1745	300595	欧普康视	200	3,790.00	0.00
1746	301072	中捷精工	200	3,788.00	0.00
1747	000565	渝三峡 A	700	3,787.00	0.00
1748	605003	众望布艺	200	3,780.00	0.00
1749	600722	金牛化工	800	3,744.00	0.00
1750	603639	海利尔	300	3,720.00	0.00
1751	000545	金浦钛业	1700	3,706.00	0.00
1752	600211	西藏药业	100	3,694.00	0.00
1753	688075	安旭生物	100	3,688.00	0.00
1754	688323	瑞华泰	300	3,687.00	0.00
1755	300637	扬帆新材	400	3,680.00	0.00
1756	002675	东诚药业	300	3,666.00	0.00
1757	300721	怡达股份	300	3,654.00	0.00
1758	002469	三维化学	500	3,650.00	0.00
1759	605189	富春染织	300	3,645.00	0.00
1760	603683	晶华新材	400	3,616.00	0.00
1761	002389	航天彩虹	200	3,610.00	0.00
1762	300767	震安科技	400	3,608.00	0.00
1762	688613	奥精医疗	200	3,608.00	0.00
1763	603062	麦加芯彩	100	3,599.00	0.00
1764	002137	实益达	400	3,596.00	0.00
1765	600420	国药现代	300	3,582.00	0.00
1765	605008	长鸿高科	300	3,582.00	0.00
1766	300211	亿通科技	400	3,560.00	0.00
1767	301301	川宁生物	300	3,558.00	0.00
1768	002999	天禾股份	600	3,552.00	0.00
1769	603519	立霸股份	300	3,546.00	0.00
1770	301286	侨源股份	100	3,544.00	0.00
1771	301087	可孚医疗	100	3,536.00	0.00
1772	605399	晨光新材	300	3,504.00	0.00
1773	600370	三房巷	1900	3,496.00	0.00
1774	000880	潍柴重机	200	3,460.00	0.00
1775	001218	丽臣实业	200	3,446.00	0.00
1776	301019	宁波色母	200	3,428.00	0.00
1777	603086	先达股份	800	3,424.00	0.00
1778	600967	内蒙一机	400	3,400.00	0.00
1779	300727	润禾材料	100	3,374.00	0.00
1780	603255	鼎际得	100	3,368.00	0.00
1781	300725	药石科技	100	3,360.00	0.00

1782	603256	宏和科技	400	3,340.00	0.00
1783	600587	新华医疗	200	3,330.00	0.00
1784	603127	昭衍新药	200	3,326.00	0.00
1785	002653	海思科	100	3,325.00	0.00
1786	603711	香飘飘	200	3,280.00	0.00
1787	300305	裕兴股份	600	3,270.00	0.00
1788	603217	元利科技	200	3,256.00	0.00
1789	605366	宏柏新材	600	3,252.00	0.00
1790	603938	三孚股份	300	3,243.00	0.00
1791	301363	美好医疗	100	3,242.00	0.00
1792	301349	信德新材	100	3,218.00	0.00
1793	603041	美思德	300	3,207.00	0.00
1794	600252	中恒集团	1300	3,198.00	0.00
1795	300316	晶盛机电	100	3,190.00	0.00
1796	603108	润达医疗	200	3,186.00	0.00
1797	001328	登康口腔	100	3,176.00	0.00
1798	300801	泰和科技	200	3,174.00	0.00
1799	603858	步长制药	200	3,160.00	0.00
1799	688575	亚辉龙	200	3,160.00	0.00
1800	300049	福瑞股份	100	3,154.00	0.00
1800	300363	博腾股份	200	3,154.00	0.00
1801	002753	永东股份	500	3,135.00	0.00
1802	300034	钢研高纳	200	3,120.00	0.00
1802	605086	龙高股份	100	3,120.00	0.00
1803	000635	英力特	400	3,112.00	0.00
1804	600329	达仁堂	100	3,080.00	0.00
1805	300538	同益股份	200	3,046.00	0.00
1806	600055	万东医疗	200	3,020.00	0.00
1807	603825	华扬联众	200	3,018.00	0.00
1808	688331	荣昌生物	100	3,011.00	0.00
1809	605066	天正电气	500	3,010.00	0.00
1810	605100	华丰股份	200	2,996.00	0.00
1811	002038	双鹭药业	400	2,988.00	0.00
1812	002909	集泰股份	600	2,982.00	0.00
1813	605055	迎丰股份	600	2,952.00	0.00
1814	300633	开立医疗	100	2,939.00	0.00
1815	300401	花园生物	200	2,932.00	0.00
1816	600664	哈药股份	700	2,891.00	0.00
1817	300599	雄塑科技	400	2,888.00	0.00
1818	000650	仁和药业	500	2,880.00	0.00
1819	003042	中农联合	200	2,850.00	0.00
1820	002030	达安基因	500	2,840.00	0.00
1821	000915	华特达因	100	2,818.00	0.00

1822	600200	江苏吴中	300	2,796.00	0.00
1823	603823	百合花	300	2,790.00	0.00
1824	603968	醋化股份	300	2,781.00	0.00
1825	603882	金域医学	100	2,753.00	0.00
1826	603276	恒兴新材	200	2,728.00	0.00
1827	600557	康缘药业	200	2,724.00	0.00
1828	603155	新亚强	200	2,690.00	0.00
1829	688382	益方生物	200	2,660.00	0.00
1830	300171	东富龙	200	2,656.00	0.00
1831	300463	迈克生物	200	2,640.00	0.00
1832	002102	能特科技	1000	2,620.00	0.00
1833	000421	南京公用	400	2,592.00	0.00
1834	603115	海星股份	200	2,582.00	0.00
1835	002099	海翔药业	500	2,580.00	0.00
1836	688739	成大生物	100	2,578.00	0.00
1837	603378	亚士创能	400	2,568.00	0.00
1838	300249	依米康	200	2,556.00	0.00
1839	002827	高争民爆	100	2,531.00	0.00
1840	688276	百克生物	100	2,511.00	0.00
1841	002437	誉衡药业	1000	2,490.00	0.00
1842	301015	百洋医药	100	2,421.00	0.00
1843	300233	金城医药	200	2,400.00	0.00
1844	603585	苏利股份	200	2,394.00	0.00
1845	600850	电科数字	100	2,390.00	0.00
1846	002802	洪汇新材	200	2,370.00	0.00
1847	301555	惠柏新材	100	2,347.00	0.00
1848	002902	铭普光磁	100	2,338.00	0.00
1849	301092	争光股份	100	2,333.00	0.00
1850	603567	珍宝岛	200	2,320.00	0.00
1851	002349	精华制药	300	2,295.00	0.00
1852	300482	万孚生物	100	2,241.00	0.00
1853	300194	福安药业	500	2,230.00	0.00
1854	688105	诺唯赞	100	2,217.00	0.00
1855	603790	雅运股份	200	2,204.00	0.00
1856	603095	越剑智能	100	2,201.00	0.00
1857	603301	振德医疗	100	2,199.00	0.00
1858	603065	宿迁联盛	300	2,181.00	0.00
1859	002055	得润电子	300	2,160.00	0.00
1860	000950	重药控股	400	2,152.00	0.00
1861	600479	千金药业	200	2,136.00	0.00
1862	300653	正海生物	100	2,130.00	0.00
1863	603896	寿仙谷	100	2,121.00	0.00
1864	688085	三友医疗	100	2,119.00	0.00

1865	002219	新里程	800	2,112.00	0.00
1865	605116	奥锐特	100	2,112.00	0.00
1866	000597	东北制药	400	2,108.00	0.00
1867	301059	金三江	170	2,091.00	0.00
1868	603998	方盛制药	200	2,084.00	0.00
1869	605507	国邦医药	100	2,083.00	0.00
1870	600812	华北制药	400	2,068.00	0.00
1871	002382	蓝帆医疗	400	2,052.00	0.00
1872	002737	葵花药业	100	2,049.00	0.00
1873	000078	海王生物	800	2,040.00	0.00
1874	300357	我武生物	100	2,032.00	0.00
1875	688062	迈威生物	100	2,020.00	0.00
1876	688571	杭华股份	300	2,013.00	0.00
1877	603229	奥翔药业	200	1,998.00	0.00
1877	688277	天智航	200	1,998.00	0.00
1878	600562	国睿科技	100	1,993.00	0.00
1879	300583	赛托生物	100	1,955.00	0.00
1880	688108	赛诺医疗	200	1,952.00	0.00
1881	300326	凯利泰	300	1,950.00	0.00
1882	301267	华夏眼科	100	1,904.00	0.00
1882	688351	微电生理	100	1,904.00	0.00
1883	301065	本立科技	100	1,875.00	0.00
1884	688321	微芯生物	100	1,858.00	0.00
1885	300039	上海凯宝	300	1,854.00	0.00
1886	603948	建业股份	100	1,843.00	0.00
1887	002932	明德生物	100	1,840.00	0.00
1887	300143	盈康生命	200	1,840.00	0.00
1888	002693	双成药业	100	1,833.00	0.00
1889	300006	莱美药业	500	1,830.00	0.00
1890	600351	亚宝药业	300	1,827.00	0.00
1891	688133	泰坦科技	100	1,824.00	0.00
1892	300705	九典制药	100	1,795.00	0.00
1893	002728	特一药业	200	1,790.00	0.00
1894	002589	瑞康医药	600	1,782.00	0.00
1895	002393	力生制药	100	1,764.00	0.00
1896	603580	艾艾精工	100	1,752.00	0.00
1897	301207	华兰疫苗	100	1,751.00	0.00
1898	601106	中国一重	600	1,746.00	0.00
1899	001333	光华股份	100	1,731.00	0.00
1900	603332	苏州龙杰	200	1,722.00	0.00
1901	300723	一品红	100	1,706.00	0.00
1902	300530	领湃科技	100	1,693.00	0.00
1903	603201	常润股份	100	1,691.00	0.00

1904	300267	尔康制药	600	1,668.00	0.00
1904	300497	富祥药业	200	1,668.00	0.00
1905	300702	天宇股份	100	1,666.00	0.00
1906	603928	兴业股份	200	1,656.00	0.00
1907	300927	江天化学	100	1,647.00	0.00
1908	300396	迪瑞医疗	100	1,634.00	0.00
1908	603633	徕木股份	200	1,634.00	0.00
1909	688317	之江生物	100	1,625.00	0.00
1910	300111	向日葵	500	1,620.00	0.00
1911	301518	长华化学	100	1,607.00	0.00
1912	601089	福元医药	100	1,600.00	0.00
1913	600327	大东方	300	1,599.00	0.00
1914	300636	同和药业	200	1,594.00	0.00
1915	002173	创新医疗	200	1,592.00	0.00
1916	000756	新华制药	100	1,571.00	0.00
1917	000813	德展健康	500	1,565.00	0.00
1918	688505	复旦张江	200	1,534.00	0.00
1919	002275	桂林三金	100	1,509.00	0.00
1920	301263	泰恩康	100	1,499.00	0.00
1921	002166	莱茵生物	200	1,494.00	0.00
1922	300453	三鑫医疗	200	1,492.00	0.00
1923	688389	普门科技	100	1,489.00	0.00
1924	300562	乐心医疗	100	1,488.00	0.00
1924	600713	南京医药	300	1,488.00	0.00
1925	603192	汇得科技	100	1,484.00	0.00
1926	300204	舒泰神	200	1,482.00	0.00
1927	002198	嘉应制药	200	1,464.00	0.00
1928	688658	悦康药业	100	1,441.00	0.00
1929	000931	中关村	300	1,428.00	0.00
1930	002942	新农股份	100	1,412.00	0.00
1930	300642	透景生命	100	1,412.00	0.00
1931	300110	华仁药业	400	1,408.00	0.00
1932	600072	中船科技	100	1,405.00	0.00
1933	300381	溢多利	200	1,404.00	0.00
1934	300869	康泰医学	100	1,394.00	0.00
1935	603718	海利生物	200	1,382.00	0.00
1936	603367	辰欣药业	100	1,374.00	0.00
1937	300358	楚天科技	200	1,372.00	0.00
1938	603222	济民健康	200	1,358.00	0.00
1938	688176	亚虹医药	200	1,358.00	0.00
1939	002213	大为股份	100	1,357.00	0.00
1940	301246	宏源药业	100	1,353.00	0.00
1941	600833	第一医药	100	1,350.00	0.00

1942	688398	赛特新材	100	1,348.00	0.00
1943	002688	金河生物	300	1,341.00	0.00
1944	300406	九强生物	100	1,336.00	0.00
1945	688585	上纬新材	200	1,332.00	0.00
1946	002940	昂利康	100	1,318.00	0.00
1946	600721	百花医药	200	1,318.00	0.00
1947	000919	金陵药业	200	1,316.00	0.00
1948	603980	吉华集团	300	1,311.00	0.00
1949	603439	贵州三力	100	1,300.00	0.00
1950	002462	嘉事堂	100	1,292.00	0.00
1951	000534	万泽股份	100	1,287.00	0.00
1952	002082	万邦德	200	1,286.00	0.00
1952	300981	中红医疗	100	1,286.00	0.00
1953	688046	药康生物	100	1,285.00	0.00
1954	300149	睿智医药	200	1,284.00	0.00
1955	600488	津药药业	300	1,272.00	0.00
1956	002755	奥赛康	100	1,271.00	0.00
1956	603538	美诺华	100	1,271.00	0.00
1957	301507	民生健康	100	1,269.00	0.00
1958	002022	科华生物	200	1,262.00	0.00
1959	300239	东宝生物	200	1,252.00	0.00
1960	688315	诺禾致源	100	1,250.00	0.00
1961	300016	北陆药业	200	1,240.00	0.00
1962	688222	成都先导	100	1,232.00	0.00
1963	688428	诺诚健华	100	1,228.00	0.00
1964	605180	华生科技	100	1,227.00	0.00
1965	000153	丰原药业	200	1,226.00	0.00
1966	300452	山河药辅	100	1,211.00	0.00
1967	300238	冠昊生物	100	1,204.00	0.00
1968	002412	汉森制药	200	1,202.00	0.00
1969	000788	北大医药	200	1,200.00	0.00
1970	603309	维力医疗	100	1,198.00	0.00
1971	300639	凯普生物	200	1,186.00	0.00
1972	000790	华神科技	300	1,170.00	0.00
1973	600851	海欣股份	200	1,160.00	0.00
1974	002793	罗欣药业	300	1,146.00	0.00
1975	300318	博晖创新	200	1,144.00	0.00
1976	300314	戴维医疗	100	1,126.00	0.00
1977	300206	理邦仪器	100	1,118.00	0.00
1978	688410	山外山	100	1,116.00	0.00
1979	301408	华人健康	100	1,103.00	0.00
1980	301370	国科恒泰	100	1,080.00	0.00
1981	002399	海普瑞	100	1,069.00	0.00

1982	000411	英特集团	100	1,065.00	0.00
1983	688319	欧林生物	100	1,060.00	0.00
1984	603669	灵康药业	200	1,050.00	0.00
1985	300439	美康生物	100	1,045.00	0.00
1986	002826	易明医药	100	1,036.00	0.00
1987	600222	太龙药业	200	1,018.00	0.00
1988	603676	卫信康	100	995.00	0.00
1989	600513	联环药业	100	991.00	0.00
1990	688238	和元生物	200	988.00	0.00
1990	688373	盟科药业	200	988.00	0.00
1991	002900	哈三联	100	985.00	0.00
1992	300289	利德曼	200	980.00	0.00
1993	688221	前沿生物	100	976.00	0.00
1994	002923	润都股份	100	954.00	0.00
1995	002873	新天药业	100	947.00	0.00
1996	002172	澳洋健康	300	939.00	0.00
1997	002551	尚荣医疗	300	924.00	0.00
1997	300412	迦南科技	200	924.00	0.00
1998	002370	亚太药业	300	915.00	0.00
1999	301060	兰卫医学	100	911.00	0.00
2000	300254	仟源医药	100	875.00	0.00
2001	002950	奥美医疗	100	873.00	0.00
2001	300404	博济医药	100	873.00	0.00
2002	300534	陇神戎发	100	870.00	0.00
2003	603520	司太立	100	869.00	0.00
2004	300942	易瑞生物	100	857.00	0.00
2005	000710	贝瑞基因	100	845.00	0.00
2006	000504	南华生物	100	835.00	0.00
2007	300434	金石亚药	100	825.00	0.00
2008	002788	鹭燕医药	100	821.00	0.00
2009	002365	永安药业	100	799.00	0.00
2010	000705	浙江震元	100	791.00	0.00
2011	688488	艾迪药业	100	786.00	0.00
2012	600080	金花股份	100	781.00	0.00
2013	002644	佛慈制药	100	772.00	0.00
2013	603811	诚意药业	100	772.00	0.00
2014	600829	人民同泰	100	750.00	0.00
2015	600774	汉商集团	100	749.00	0.00
2016	002524	光正眼科	200	728.00	0.00
2017	603987	康德莱	100	718.00	0.00
2018	300485	赛升药业	100	701.00	0.00
2019	600613	神奇制药	100	686.00	0.00
2020	688468	科美诊断	100	685.00	0.00

2021	002566	益盛药业	100	682.00	0.00
2022	603168	莎普爱思	100	670.00	0.00
2023	300246	宝莱特	100	659.00	0.00
2024	002817	黄山胶囊	100	626.00	0.00
2025	000952	广济药业	100	618.00	0.00
2026	000953	河化股份	100	559.00	0.00
2027	300030	阳普医疗	100	552.00	0.00
2028	300086	康芝药业	100	490.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	166,729,280.20	24.92
2	601318	中国平安	132,603,701.74	19.82
3	300750	宁德时代	110,244,907.36	16.48
4	000333	美的集团	107,357,424.71	16.05
5	601288	农业银行	97,685,213.00	14.60
6	601166	兴业银行	90,780,519.60	13.57
7	601857	中国石油	88,392,903.70	13.21
8	601398	工商银行	85,025,237.49	12.71
9	600900	长江电力	82,146,072.80	12.28
10	601328	交通银行	71,797,821.50	10.73
11	600919	江苏银行	71,402,601.06	10.67
12	000001	平安银行	67,934,132.16	10.15
13	601229	上海银行	63,787,287.16	9.53
14	000651	格力电器	63,628,244.73	9.51
15	002594	比亚迪	62,136,344.00	9.29
16	300760	迈瑞医疗	59,745,529.49	8.93
17	601668	中国建筑	59,564,724.20	8.90
18	601601	中国太保	56,881,711.00	8.50
19	601899	紫金矿业	53,894,027.70	8.06
20	000568	泸州老窖	52,204,512.00	7.80
21	000858	五粮液	49,935,205.00	7.46
22	601088	中国神华	48,404,246.98	7.23
23	002475	立讯精密	44,540,260.00	6.66
24	002415	海康威视	43,597,086.13	6.52
25	600028	中国石化	43,455,558.50	6.49
26	601816	京沪高铁	43,273,487.00	6.47
27	600000	浦发银行	42,810,332.22	6.40
28	300274	阳光电源	42,574,174.00	6.36
29	601988	中国银行	42,469,459.00	6.35

30	605499	东鹏饮料	41,857,978.40	6.26
31	600016	民生银行	41,734,142.46	6.24
32	600276	恒瑞医药	41,097,970.20	6.14
33	002027	分众传媒	41,031,714.02	6.13
34	601009	南京银行	40,242,918.50	6.01
35	600015	华夏银行	39,839,154.49	5.95
36	601728	中国电信	39,718,761.00	5.94
37	603259	药明康德	39,411,916.20	5.89
38	601169	北京银行	39,196,653.72	5.86
39	601658	邮储银行	37,359,197.00	5.58
40	000625	长安汽车	36,620,296.54	5.47
41	603501	韦尔股份	34,962,958.08	5.23
42	601138	工业富联	34,892,937.90	5.22
43	600030	中信证券	34,592,704.62	5.17
44	601211	国泰君安	34,103,265.74	5.10
45	600887	伊利股份	33,518,650.23	5.01
46	600050	中国联通	33,474,989.00	5.00
47	300059	东方财富	33,344,383.12	4.98
48	600406	国电南瑞	33,319,142.56	4.98
49	002371	北方华创	33,255,120.00	4.97
50	601225	陕西煤业	32,822,986.00	4.91
51	601997	贵阳银行	32,453,509.20	4.85
52	601390	中国中铁	31,957,784.66	4.78
53	300394	天孚通信	31,766,302.80	4.75
54	600926	杭州银行	31,474,657.48	4.70
55	601998	中信银行	30,881,317.67	4.62
56	601186	中国铁建	30,830,592.00	4.61
57	600309	万华化学	30,794,867.88	4.60
58	300308	中际旭创	30,629,378.26	4.58
59	601766	中国中车	30,248,462.00	4.52
60	601231	环旭电子	29,664,695.60	4.43
61	600438	通威股份	29,465,334.74	4.40
62	600809	山西汾酒	29,139,461.00	4.36
63	601939	建设银行	29,060,408.84	4.34
64	600019	宝钢股份	28,961,816.00	4.33
65	000725	京东方 A	28,926,611.00	4.32
66	601577	长沙银行	28,803,394.69	4.31
67	603323	苏农银行	28,530,780.90	4.26
68	600066	宇通客车	28,418,874.90	4.25
69	600089	特变电工	27,995,189.49	4.18
70	601012	隆基绿能	27,860,160.07	4.16
71	002714	牧原股份	27,738,065.40	4.15
72	600941	中国移动	26,753,198.42	4.00

73	002001	新和成	26,231,987.28	3.92
74	300433	蓝思科技	26,059,768.00	3.89
75	600741	华域汽车	25,987,276.00	3.88
76	300498	温氏股份	25,417,006.47	3.80
77	601319	中国人保	25,392,935.00	3.80
78	600346	恒力石化	25,239,140.60	3.77
79	601818	光大银行	24,955,253.00	3.73
80	688036	传音控股	24,357,132.82	3.64
81	601985	中国核电	24,246,325.00	3.62
82	603993	洛阳钼业	23,969,824.45	3.58
83	600737	中粮糖业	23,952,959.00	3.58
84	300124	汇川技术	23,869,594.24	3.57
85	000009	中国宝安	23,271,353.00	3.48
86	000338	潍柴动力	22,891,321.56	3.42
87	002648	卫星化学	22,803,067.86	3.41
88	601633	长城汽车	22,632,860.93	3.38
89	600489	中金黄金	22,378,924.89	3.34
90	600989	宝丰能源	22,160,119.50	3.31
91	600096	云天化	22,080,238.00	3.30
92	002142	宁波银行	21,826,315.00	3.26
93	600998	九州通	21,450,606.37	3.21
94	600674	川投能源	21,067,012.00	3.15
95	601688	华泰证券	21,050,659.99	3.15
96	601600	中国铝业	20,652,997.00	3.09
97	002241	歌尔股份	20,355,760.00	3.04
98	300390	天华新能	19,943,893.30	2.98
99	600886	国投电力	19,860,206.00	2.97
100	300408	三环集团	19,666,884.00	2.94
101	002600	领益智造	19,620,709.46	2.93
102	600760	中航沈飞	19,574,858.88	2.93
103	601919	中远海控	19,513,252.90	2.92
104	300828	锐新科技	19,225,513.66	2.87
105	002595	豪迈科技	19,055,942.11	2.85
106	601628	中国人寿	18,915,664.00	2.83
107	689009	九号公司	18,835,335.99	2.82
108	688041	海光信息	18,760,235.94	2.80
109	601117	中国化学	18,269,001.00	2.73
110	605117	德业股份	18,160,311.80	2.71
111	000800	一汽解放	18,139,296.44	2.71
112	601077	渝农商行	18,120,811.00	2.71
113	300502	新易盛	18,077,811.00	2.70
114	601607	上海医药	17,965,408.24	2.69
115	603198	迎驾贡酒	17,334,374.78	2.59

116	600795	国电电力	17,293,467.00	2.58
117	688314	康拓医疗	17,170,766.27	2.57
118	688599	天合光能	16,888,803.24	2.52
119	000002	万科 A	16,741,480.00	2.50
120	600585	海螺水泥	16,519,849.53	2.47
121	002459	晶澳科技	16,495,850.00	2.47
122	000090	天健集团	16,442,043.00	2.46
123	002938	鹏鼎控股	16,375,560.00	2.45
124	601336	新华保险	16,352,614.08	2.44
125	688012	中微公司	16,242,113.55	2.43
126	000550	江铃汽车	16,146,926.87	2.41
127	688408	中信博	16,047,804.50	2.40
128	600938	中国海油	15,783,387.00	2.36
129	002048	宁波华翔	15,749,865.00	2.35
130	688981	中芯国际	15,656,366.37	2.34
131	600150	中国船舶	15,629,055.00	2.34
132	601888	中国中免	15,539,818.00	2.32
133	002179	中航光电	15,470,756.56	2.31
134	000768	中航西飞	15,427,092.00	2.31
135	300532	今天国际	15,263,675.00	2.28
136	600018	上港集团	15,205,929.00	2.27
137	600547	山东黄金	15,120,782.16	2.26
138	002394	联发股份	15,000,814.00	2.24
139	601898	中煤能源	14,953,084.00	2.23
140	600803	新奥股份	14,856,267.80	2.22
141	601006	大秦铁路	14,837,759.00	2.22
142	603080	新疆火炬	14,829,292.81	2.22
143	002236	大华股份	14,782,274.64	2.21
144	000596	古井贡酒	14,780,153.98	2.21
145	600660	福耀玻璃	14,732,337.00	2.20
146	300492	华图山鼎	14,589,684.00	2.18
147	601717	郑煤机	14,516,890.00	2.17
148	688008	澜起科技	14,481,743.70	2.16
149	688312	燕麦科技	14,479,771.58	2.16
150	002984	森麒麟	14,401,130.77	2.15
151	601618	中国中冶	14,338,003.00	2.14
152	000521	长虹美菱	14,205,702.93	2.12
153	600582	天地科技	14,159,879.00	2.12
154	601127	赛力斯	14,022,421.00	2.10
155	600029	南方航空	13,918,394.80	2.08
156	603385	惠达卫浴	13,741,242.36	2.05
157	600690	海尔智家	13,715,496.00	2.05
158	603368	柳药集团	13,638,683.52	2.04

159	600051	宁波联合	13,600,217.47	2.03
160	600356	恒丰纸业	13,516,136.69	2.02
161	601886	江河集团	13,473,852.65	2.01

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

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	600519	贵州茅台	162,924,725.60	24.35
2	601318	中国平安	131,221,518.76	19.61
3	300750	宁德时代	125,494,503.22	18.76
4	000333	美的集团	108,798,218.44	16.26
5	601857	中国石油	104,646,898.90	15.64
6	601288	农业银行	99,048,953.00	14.80
7	601166	兴业银行	92,359,643.42	13.80
8	600900	长江电力	84,510,795.10	12.63
9	601398	工商银行	82,262,439.10	12.30
10	601328	交通银行	69,076,022.10	10.32
11	000651	格力电器	68,830,048.77	10.29
12	600919	江苏银行	68,461,925.62	10.23
13	300760	迈瑞医疗	66,698,730.29	9.97
14	002594	比亚迪	66,351,659.47	9.92
15	000001	平安银行	64,561,863.50	9.65
16	601229	上海银行	64,426,567.00	9.63
17	601899	紫金矿业	64,297,936.00	9.61
18	601601	中国太保	61,132,513.00	9.14
19	000858	五粮液	59,333,491.98	8.87
20	601668	中国建筑	57,768,000.40	8.63
21	000568	泸州老窖	54,215,349.00	8.10
22	300274	阳光电源	51,002,670.50	7.62
23	601088	中国神华	50,457,731.71	7.54
24	002475	立讯精密	47,751,238.89	7.14
25	600028	中国石化	47,732,726.00	7.13
26	002027	分众传媒	45,303,323.00	6.77
27	601138	工业富联	44,996,658.28	6.73
28	605499	东鹏饮料	44,916,887.60	6.71
29	300394	天孚通信	43,427,294.37	6.49
30	601816	京沪高铁	42,861,315.00	6.41
31	600015	华夏银行	42,601,551.03	6.37
32	002415	海康威视	41,763,982.02	6.24
33	600000	浦发银行	41,730,324.51	6.24
34	600016	民生银行	41,692,661.60	6.23
35	600276	恒瑞医药	41,404,385.70	6.19

36	601988	中国银行	41,148,440.00	6.15
37	601009	南京银行	40,083,317.11	5.99
38	603259	药明康德	39,986,511.98	5.98
39	601169	北京银行	39,940,258.55	5.97
40	300059	东方财富	39,790,504.30	5.95
41	000625	长安汽车	39,311,403.57	5.88
42	601658	邮储银行	36,383,865.00	5.44
43	600089	特变电工	36,254,152.83	5.42
44	601728	中国电信	36,047,492.00	5.39
45	603501	韦尔股份	35,551,893.25	5.31
46	600438	通威股份	34,400,949.00	5.14
47	002371	北方华创	34,019,859.93	5.08
48	601997	贵阳银行	33,931,828.00	5.07
49	601225	陕西煤业	33,918,618.35	5.07
50	600309	万华化学	33,693,713.50	5.04
51	600030	中信证券	33,594,496.65	5.02
52	601211	国泰君安	33,344,179.49	4.98
53	601012	隆基绿能	33,332,111.40	4.98
54	600406	国电南瑞	33,269,303.97	4.97
55	688036	传音控股	32,380,195.59	4.84
56	002714	牧原股份	32,101,338.00	4.80
57	601985	中国核电	31,817,341.50	4.76
58	600926	杭州银行	31,714,203.00	4.74
59	000725	京东方 A	31,666,194.75	4.73
60	600050	中国联通	31,651,354.00	4.73
61	600941	中国移动	30,804,625.00	4.60
62	601231	环旭电子	30,535,028.00	4.56
63	300308	中际旭创	30,510,665.00	4.56
64	600809	山西汾酒	30,325,875.62	4.53
65	601186	中国铁建	30,023,917.00	4.49
66	601390	中国中铁	29,759,860.00	4.45
67	600066	宇通客车	29,508,552.78	4.41
68	600741	华域汽车	29,142,395.00	4.36
69	600887	伊利股份	29,011,636.00	4.34
70	603323	苏农银行	28,623,337.10	4.28
71	601766	中国中车	28,460,515.00	4.25
72	601939	建设银行	28,452,427.00	4.25
73	601818	光大银行	28,382,837.00	4.24
74	601577	长沙银行	28,377,446.92	4.24
75	300124	汇川技术	27,983,711.37	4.18
76	601600	中国铝业	27,933,948.00	4.18
77	603993	洛阳钼业	27,802,296.29	4.16
78	300498	温氏股份	25,511,491.80	3.81

79	600737	中粮糖业	25,456,872.00	3.80
80	600019	宝钢股份	25,143,346.00	3.76
81	300433	蓝思科技	25,118,905.00	3.75
82	601319	中国人保	25,116,529.00	3.75
83	600346	恒力石化	24,861,123.20	3.72
84	600096	云天化	24,715,068.00	3.69
85	002001	新和成	24,214,671.18	3.62
86	002648	卫星化学	22,879,154.76	3.42
87	600886	国投电力	22,771,843.00	3.40
88	601633	长城汽车	22,600,307.00	3.38
89	600989	宝丰能源	22,241,196.00	3.32
90	002459	晶澳科技	21,431,968.80	3.20
91	600489	中金黄金	21,413,781.00	3.20
92	002241	歌尔股份	21,386,755.00	3.20
93	601077	渝农商行	20,840,342.00	3.11
94	600674	川投能源	20,806,372.30	3.11
95	000338	潍柴动力	20,793,971.00	3.11
96	600938	中国海油	20,612,297.00	3.08
97	601117	中国化学	20,582,299.00	3.08
98	002142	宁波银行	20,514,925.10	3.07
99	300390	天华新能	20,477,660.90	3.06
100	688041	海光信息	20,229,012.16	3.02
101	600150	中国船舶	20,178,377.00	3.02
102	600998	九州通	20,083,845.06	3.00
103	688981	中芯国际	19,999,939.47	2.99
104	601628	中国人寿	19,940,943.00	2.98
105	601998	中信银行	19,940,908.00	2.98
106	601688	华泰证券	19,914,345.00	2.98
107	600760	中航沈飞	19,640,924.99	2.94
108	000009	中国宝安	19,608,265.00	2.93
109	002595	豪迈科技	19,480,452.00	2.91
110	002600	领益智造	19,282,260.00	2.88
111	601919	中远海控	19,120,096.97	2.86
112	300828	锐新科技	18,970,718.00	2.84
113	000090	天健集团	18,798,168.63	2.81
114	000002	万科 A	18,643,084.00	2.79
115	300408	三环集团	18,414,059.00	2.75
116	689009	九号公司	18,282,242.56	2.73
117	300532	今天国际	18,221,656.80	2.72
118	603198	迎驾贡酒	18,208,152.00	2.72
119	002236	大华股份	18,104,482.00	2.71
120	601607	上海医药	17,940,315.28	2.68
121	003816	中国广核	17,929,329.00	2.68

122	688599	天合光能	17,905,335.54	2.68
123	601898	中煤能源	17,858,878.00	2.67
124	688012	中微公司	17,761,781.70	2.65
125	600153	建发股份	17,722,183.00	2.65
126	000800	一汽解放	17,627,225.58	2.63
127	600803	新奥股份	17,496,434.00	2.62
128	605117	德业股份	17,443,696.48	2.61
129	002938	鹏鼎控股	17,126,839.00	2.56
130	000933	神火股份	16,861,285.99	2.52
131	688314	康拓医疗	16,780,289.57	2.51
132	000550	江铃汽车	16,636,530.94	2.49
133	601336	新华保险	16,525,603.00	2.47
134	600547	山东黄金	16,497,553.24	2.47
135	600582	天地科技	16,396,210.00	2.45
136	600795	国电电力	16,279,024.00	2.43
137	000932	华菱钢铁	16,197,976.00	2.42
138	002466	天齐锂业	15,830,513.96	2.37
139	600029	南方航空	15,769,719.00	2.36
140	300502	新易盛	15,737,282.00	2.35
141	600585	海螺水泥	15,607,300.00	2.33
142	688408	中信博	15,569,202.79	2.33
143	601127	赛力斯	15,393,106.00	2.30
144	002048	宁波华翔	15,386,786.00	2.30
145	601888	中国中免	15,354,110.00	2.29
146	600436	片仔癀	15,351,764.00	2.29
147	002179	中航光电	15,247,643.40	2.28
148	000521	长虹美菱	15,179,374.76	2.27
149	002394	联发股份	15,090,085.90	2.26
150	000768	中航西飞	15,018,504.76	2.24
151	603080	新疆火炬	15,012,341.00	2.24
152	600018	上港集团	14,665,287.00	2.19
153	600660	福耀玻璃	14,615,691.00	2.18
154	601717	郑煤机	14,600,387.00	2.18
155	688008	澜起科技	14,368,898.76	2.15
156	601111	中国国航	14,274,153.00	2.13
157	601006	大秦铁路	14,016,698.00	2.09
158	002984	森麒麟	13,912,158.00	2.08
159	603385	惠达卫浴	13,786,281.40	2.06
160	603368	柳药集团	13,768,593.00	2.06
161	601618	中国中冶	13,749,816.00	2.06
162	600356	恒丰纸业	13,614,458.88	2.03
163	000895	双汇发展	13,556,185.00	2.03
164	600985	淮北矿业	13,530,066.55	2.02

165	688556	高测股份	13,474,818.86	2.01
166	000596	古井贡酒	13,470,205.00	2.01
167	300652	雷迪克	13,431,834.00	2.01
168	300772	运达股份	13,424,162.60	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	10,320,023,086.63
卖出股票的收入（成交）总额	10,616,861,899.57

注：本项“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

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	5,038,808.22	1.36
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	5,038,808.22	1.36

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019749	24 国债 15	50000	5,038,808.22	1.36

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。本基金的股指期货交易对基金总体风险影响不大，符合本基金的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策程序说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国电信股份有限公司在报告编制前一年受到长沙市应急管理局、江苏省通信管理局、连云港市赣榆区住房和城乡建设局、重庆市黔江区规划和自然资源局、金华市婺城区消防救援大队的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行南阳市分行、国家外汇管理局福建省分局、国家外汇管理局泉州市分局、国家金融监督管理总局上海监管局、大连市市场监督管理局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制前一年受到国家外汇管理局绵阳市分局、国家金融监督管理总局福建监管局、天津市市场监督管理委员会的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制前一年受到中国人民银行四川省分行、国家外汇管理局南通市分局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局吉林监管局的处罚。本基金对上述证券的投资决策程序符合相关法规及公司制度的要求。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 报告期内基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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	-

2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	101,404.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	101,404.07

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

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
博时量化多 策略股票 A	10341	24,875.74	226,780,804.98	88.16%	30,459,215.14	11.84%
博时量化多 策略股票 C	807	49,379.36	33,771,709.18	84.75%	6,077,436.70	15.25%
合计	11095	26,776.85	260,552,514.16	87.70%	36,536,651.84	12.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	博时量化多策略 股票 A	241,410.92	0.09%
	博时量化多策略 股票 C	170.89	0.00%
	合计	241,581.81	0.08%

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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	-
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	博时量化多策略股票 A	0~10
	博时量化多策略股票 C	-
	合计	0~10

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	博时量化多策略股票 A	博时量化多策略股票 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 3 日）基金份额总额	146,135,440.46	765,094,981.90
本报告期期初基金份额总额	504,330,069.27	63,154,117.47
本报告期基金总申购份额	145,646,623.65	34,496,091.12
减：本报告期基金总赎回份额	392,736,672.80	57,801,062.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	257,240,020.12	39,849,145.88

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开持有人大会。

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

基金管理人于 2024 年 4 月 13 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，徐卫先生离任公司副总经理。

基金管理人于 2024 年 5 月 25 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，张东先生任公司总经理。

基金管理人于 2024 年 12 月 7 日发布了《博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，吴曼女士任公司督察长，孙麒清女士离任公司督察长。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金应付审计费为 55000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员没有受到监管部门的稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
招商证券	9	16,777,777,650.36	80.14%	10,114,480.86	76.53%	增加 3 个
中信证券	2	2,383,744,943.83	11.39%	1,778,034.79	13.45%	-
中金公司	2	1,469,188,546.64	7.02%	1,095,879.63	8.29%	-
中泰证券	1	305,120,147.81	1.46%	227,588.37	1.72%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施稳定、响应支持及时、能满足公募基金采用证券公司交易结算模式进行证券交易和结算的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；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；
- 4) 资金划付、交收、调整、差异处理及时，且基金交易、结算、对账等数据的提供能满足证券公司交易结算模式下估值的时效性要求。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期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
招商证券	13,334,110.00	100.00%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	博时基金管理有限公司关于旗下 193 只基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、基金管理人网站、	2024-12-27

		证监会基金电子披露网站	
2	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-12-07
3	博时基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-18
4	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20241106	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-11-06
5	博时量化多策略股票型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-10-25
6	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-30
7	博时基金管理有限公司关于旗下基金持有的长期停牌股票调整估值方法的公告-20240925	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-25
8	博时基金管理有限公司关于董事会成员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-09-21
9	博时量化多策略股票型证券投资基金 2024 年中期报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-30
10	博时基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-23
11	博时基金管理有限公司旗下基金在兴业银行钱大掌柜开展费率优惠活动的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-08-22
12	博时基金管理有限公司关于直销网上交易平台基金转换等业务费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、	2024-08-17

		证监会基金电子披露网站	
13	博时基金管理有限公司关于暂停使用民生银行基金代收付服务办理直销网上交易部分业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-07-20
14	博时量化多策略股票型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-07-19
15	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 A）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
16	博时量化多策略股票型证券投资基金（博时量化多策略股票 C）基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-06-26
17	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-25
18	博时基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-05-15
19	博时基金管理有限公司关于与通联支付网络服务股份有限公司合作开通北京银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
20	博时基金管理有限公司关于与上海富友支付服务有限公司合作开通上海银行借记卡直销网上交易和费率优惠的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-29
21	博时量化多策略股票型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-22
22	博时基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-04-13
23	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站、	2024-03-29

		证监会基金电子披露网站	
24	博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-01
25	博时量化多策略股票型证券投资基金更新招募说明书	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-01
26	博时基金管理有限公司关于博时量化多策略股票型证券投资基金证券交易结算模式转换完成的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-03-01
27	博时基金管理有限公司关于博时量化多策略股票型证券投资基金证券交易结算模式转换有关事项的公告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-02-27
28	博时量化多策略股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2024-01-22

§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	2024-08-29~2024-12-31	100,805,047.41	8,241,902.25	-	109,046,949.66	36.71%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							
在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

注：1. 申购份额包含红利再投资份额。

2. 份额占比为四舍五入后的结果。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准博时量化多策略股票型证券投资基金设立的文件
- 2、《博时量化多策略股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《博时量化多策略股票型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- 5、博时量化多策略股票型证券投资基金各年度审计报告正本
- 6、报告期内博时量化多策略股票型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查询，也可按工本费购买复印件

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司

博时一线通：95105568（免长途话费）

博时基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日