

信复创值 3 号基金 2024 年年度报告

1、基金产品概况

1.1 基金基本情况

| | |
|--------------------------|------------------|
| 基金名称 | 信复创值 3 号基金 |
| 基金编码 | S21884 |
| 基金运作方式 | 开放式 |
| 基金成立日期 | 2014 年 10 月 24 日 |
| 基金管理人 | 北京信复创值投资管理有限公司 |
| 基金托管人（如有） | 招商证券股份有限公司 |
| 投资顾问（如有） | - |
| 期末基金总份额（万份）/期末基金实缴总额（万元） | 1,590.320567 |
| 基金到期日期 | 2034 年 10 月 23 日 |

1.2 基金产品说明

| | |
|------------|---|
| 投资目标 | 追求长期年平均回报率超越沪深 300 指数，为客户创造长期稳定的绝对回报。 |
| 投资策略 | 公司用“量化选股，量化择时，量化对冲”的投资策略，将长期的主动投资实战方法与量化投资方法相结合，形成了公司多策略的投资体系。公司采用立足于大数据研究之上的量化模型投资方法，以公开的市场数据为基础，采用不同的量化工具识别跟踪市场最具上涨潜力的股票组合，并量化择时投资，以追求风险调整后的最优回报。 |
| 业绩比较基准（如有） | 无 |
| 风险收益特征 | 高风险高收益。 |

1.3 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 | | 北京信复创值投资管理有限公司 | 招商证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 贾佳 | 韩鑫普 |
| | 联系电话 | 010-65189877 | 0755-82943666 |
| | 电子邮箱 | jiajia@faithfulvalue.com | tgb@cmschina.com.cn |
| 传真 | | 64093287 | 0755-82960794 |
| 注册地址 | | 北京市东城区建国门内大街 18 号办二六层 614 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |
| 办公地址 | | 北京市东城区建国门内大街 18 号办二六层 615 | 深圳市福田区福田街道福华一路 111 号 |

| | | |
|-------|--------|--------|
| 邮政编码 | 100005 | 518000 |
| 法定代表人 | 耿立勋 | 霍达 |

1.4 信息披露方式

| |
|---|
| 基金管理人网站 http://www.faitfulvalue.com |
|---|

1.5 其他相关资料（如有）

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|------------------------|
| 会计师事务所 | 北京永晴会计师事务所 | 北京市石景山区苹果园路2号院1号楼6层603 |
| 注册登记机构 | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路111号 |
| 外包机构 | 招商证券股份有限公司 | 深圳市福田区福田街道福华一路111号 |
| - | - | - |

2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

2.1 主要会计数据和财务指标

| 期间数据和指标 | 2024 年 | 2023 年 | 2022 年 |
|--------------|---------------|---------------|----------------|
| 本期已实现收益 | -4,616,745.23 | 7,172,124.89 | -13,008,326.58 |
| 本期利润 | -6,446,368.85 | 9,911,135.39 | -4,322,667.24 |
| 期末数据和指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 期末可供分配利润 | 17,031,703.90 | 21,440,993.83 | 13,033,966.35 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.0710 | 1.3973 | 0.8313 |
| 期末基金净资产 | 32,934,909.57 | 37,918,878.12 | 28,712,695.72 |
| 报告期期末单位净值 | 2.0710 | 2.4712 | 1.8313 |
| 累计期末指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 107.10% | 147.12% | 83.13% |

21884A 级主要会计数据和财务指标

| 期间数据和指标 | 2024 年 | 2023 年 | 2022 年 |
|--------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期已实现收益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 本期利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 期末数据和指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 期末可供分配利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 期末基金净资产 | 31,146,275.97 | 34,238,555.59 | 25,985,308.86 |



| | | | |
|-------------|---------|---------|---------|
| 报告期期末单位净值 | 2.0710 | 2.4712 | 1.8313 |
| 累计期末指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 107.20% | 147.24% | 83.22% |

21884B 级主要会计数据和财务指标

| | | | |
|--------------|--------------|--------------|--------------|
| 期间数据和指标 | 2024 年 | 2023 年 | 2022 年 |
| 本期已实现收益 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 本期利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 期末数据和指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 期末可供分配利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 期末基金净资产 | 1,788,633.60 | 3,680,322.53 | 2,727,386.86 |
| 报告期期末单位净值 | 2.0710 | 2.4712 | 1.8313 |
| 累计期末指标 | 2024 年末 | 2023 年末 | 2022 年末 |
| 基金份额累计净值增长率 | 107.10% | 147.12% | 83.13% |

2.2 基金净值表现

| 阶段 | 净值增长率(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准收益率(%) | 业绩比较基准收益率标准差(%) |
|------------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当年 | -16.19 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 107.10 | - | - | - |

注：净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初累计净值

当年净值增长率=（本年度末累计净值-上年度末累计净值）/上年度末累计净值

21884A 级基金净值表现

| 阶段 | 净值增长率(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准收益率(%) | 业绩比较基准收益率标准差(%) |
|------------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当年 | -16.19 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 107.20 | - | - | - |

21884B 级基金净值表现

| 阶段 | 净值增长率(%) | 净值增长率标准差(%) | 业绩比较基准收益率(%) | 业绩比较基准收益率标准差(%) |
|------------|----------|-------------|--------------|-----------------|
| 当年 | -16.19 | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 107.10 | - | - | - |

2.3 过去三年基金的利润分配情况

| 年度 | 每份基金份 | 现金形式发 | 再投资形式 | 年度利润分配 | 备注 |
|----|-------|-------|-------|--------|----|
|----|-------|-------|-------|--------|----|

| | 额分红数 | 放总额 | 发放总额 | 合计 | |
|------|------|------|------|------|---|
| 2024 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2023 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2022 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |

21884A 级过去三年基金的利润分配情况

| 年度 | 每份基金份 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 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2023 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2022 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |

21884B 级过去三年基金的利润分配情况

| 年度 | 每份基金份 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 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2023 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |
| 2022 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | - |

3、基金份额变动情况

单位：万份/万元

| | |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,534.451755 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 118.431961 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 62.563149 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额 | 1,590.320567 |

21884A 级基金份额变动情况

| | |
|---------------------------|--------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,385.521258 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 118.431961 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 0.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额 | 1,503.953219 |

21884B 级基金份额变动情况

| | |
|---------------------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 148.930497 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 0.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 62.563149 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | 0.00 |
| 期末基金总份额/期末基金实缴总额 | 86.367348 |



4、管理人说明的其他情况

1. 基金管理人及基金经理情况

北京信复创值投资管理有限公司成立于 2013 年 7 月。注册资本人民币 2300 万元，实缴 2300 万元。截至本报告期末，公司共管理 14 只基金：信复创值 2 号基金、信复创值 3 号基金、信复创值 5 号基金、信复创值立勋进取私募证券投资基金、信复创值立勋进取 1 号私募证券投资基金、信复创值新起点私募证券投资基金、信复创值价值平衡私募证券投资基金、信复创值 8 号私募证券投资基金、信复创值行稳致远 1 号私募证券投资基金、信复创值行稳致远 2 号私募证券投资基金、信复创值稳中求进私募证券投资基金、信复创值中证 1000 指数增强 1 号私募证券投资基金、信复创值中证 2000 指数增强 1 号私募证券投资基金、信复创值灵活对冲 1 号私募证券投资基金。

基金经理：刘宇晨，毕业于北京工业大学，1998 年创建北京裂变投资顾问有限责任公司，任总经理。2013 年 7 月创建北京信复创值投资管理有限公司，任执行董事、投资总监。20 多年投资实践中，广泛调研了国内 A 股上市公司，在行业研究和公司定价方面有深刻的认识。拥有完善的价值投资理念，善于从基本面出发自下而上的逆向投资策略，形成独特高效的投资方法。

2. 报告期内本基金运作合规守信情况

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

3. 报告期内基金业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，基金单位净值为 2.0710。

5. 内部基金监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通。同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。



5、托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，本托管人——招商证券股份有限公司在对本基金的托管过程中，严格遵守有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

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

本托管人按照基金合同的约定，对本基金报告期的基金资产净值进行了复核；同时依据法律法规和基金合同规定，在托管人履行的投资监督范围内，对本基金报告期的投资情况进行了监督。在本基金合同约定的投资监督范围内，发现监督指标超出合同约定的投资限制。报告期内，本基金的利润分配情况详见本报告中“2、主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况”部分。

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

基于基金管理人提供的必要的估值要素，本托管人参照《私募投资基金监督管理暂行办法》、《私募投资基金信息披露管理办法》等法律法规和基金合同的约定，对基金管理人报告中的主要财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容的真实性、准确性和完整性进行了复核，未发现异常。

6、年度财务报表

6.1 资产负债表

金额单位：元

| 资产 | 2024-12-31 | 2023-12-31 |
|----------|---------------|---------------|
| 资产： | | |
| 银行存款 | 219.45 | 104.87 |
| 结算备付金 | 1,581,739.90 | 370,099.88 |
| 存出保证金 | 1,656,367.20 | 11,908,190.45 |
| 交易性金融资产 | 29,701,681.16 | 24,601,559.00 |
| 其中：股票投资 | 29,701,681.16 | 24,601,559.00 |
| 基金投资 | 0.00 | 0.00 |
| 债券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 资产支持证券投资 | 0.00 | 0.00 |
| 贵金属投资 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融资产 | 0.00 | 1,107,276.69 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | 0.00 | 0.00 |
| 应收股利 | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 |
| 递延所得税资产 | 0.00 | 0.00 |

| | | |
|-----------------|-------------------|-------------------|
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 32,940,007.71 | 37,987,230.89 |
| 负债和所有者权益 | 2024-12-31 | 2023-12-31 |
| 负债: | | |
| 短期借款 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融负债 | 0.00 | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付证券清算款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | 0.00 | 0.00 |
| 应付托管费 | 2,549.07 | 2,773.74 |
| 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 应付交易费用 | 0.00 | 0.00 |
| 应交税费 | 0.00 | 62,805.29 |
| 应付利息 | 0.00 | 0.00 |
| 应付利润 | 0.00 | 0.00 |
| 递延所得税负债 | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | 2,549.07 | 2,773.74 |
| 负债合计 | 5,098.14 | 68,352.77 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 15,903,205.67 | 15,344,517.55 |
| 未分配利润 | 17,031,703.90 | 22,574,360.57 |
| 所有者权益合计 | 32,934,909.57 | 37,918,878.12 |
| 负债和所有者权益总计 | 32,940,007.71 | 37,987,230.89 |

注：1、其他资产：未被统计进前列分类的资产科目，主要包括其他私募基金、基金公司专户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等。

2、其他负债：未被统计进前列分类的负债科目，主要包括应付外包服务费、应付投资顾问费、应付咨询服务费等。

3、6.1 资产负债表中“股票投资”统计所有股票（含新三板股票）投资市值，7.1 章节中“股票投资”统计除新三板投资和上市公司定向增发股票投资以外的市值，新三板投资和上市公司定向增发股票投资有单独指标统计。

4、6.1 资产负债表中“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”单独列示，“其他资产”是总资产与已列示明细资产项的轧差项，7.1 期末基金资产组合情况中“其他资产”中除总资产与已列示明细资产项的轧差项外，还包含“应收股利”、“应收申购款”、“应收利息”。

6.2 利润表

金额单位：元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|-------------------------------------|-------------------------------------|
| | 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日 | 2023 年 01 月 01 日 至 2023 年 12 月 31 日 |



| | | |
|------------------------|---------------|---------------|
| 一、收入 | -6,131,257.25 | 10,100,063.02 |
| 1. 利息收入 | 6,390.93 | 715.95 |
| 其中：存款利息收入 | 4,267.60 | 715.95 |
| 债券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 资产支持证券利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产收入 | 2,123.33 | 0.00 |
| 其他利息收入 | 0.00 | 0.00 |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | -4,228,984.43 | 7,573,107.26 |
| 其中：股票投资收益 | 2,162,082.82 | 3,208,941.91 |
| 基金投资收益 | -5,089.50 | 0.00 |
| 债券投资收益 | 13,153.09 | 30,464.48 |
| 资产支持证券投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 贵金属投资收益 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生工具收益 | -6,950,526.55 | 4,065,721.02 |
| 股利收益 | 551,395.71 | 267,979.85 |
| 其他收益 | 0.00 | 0.00 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -1,829,623.62 | 2,739,010.50 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | 0.00 | 0.00 |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | -79,040.13 | -212,770.69 |
| 减：二、费用 | 315,111.60 | 188,927.63 |
| 1. 管理人报酬 | 0.00 | 0.00 |
| 其中：固定管理费 | 0.00 | 0.00 |
| 业绩报酬 | 0.00 | 0.00 |
| 2. 托管费 | 10,074.03 | 35,607.93 |
| 3. 销售服务费 | 0.00 | 0.00 |
| 4. 外包服务费 | 10,074.03 | 14,374.50 |
| 5. 交易费用 | 284,904.73 | 113,127.68 |
| 6. 利息支出 | 0.00 | 0.00 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 0.00 | 0.00 |
| 7. 其他费用 | 10,058.81 | 25,817.52 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | -6,446,368.85 | 9,911,135.39 |
| 减：所得税费用 | 0.00 | 0.00 |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | -6,446,368.85 | 9,911,135.39 |

注：其他收益：未被统计进前列分类的损益类科目，主要包括投资于其他私募基金、基金公司专

户、券商资管计划、有限合伙企业股权、未上市企业股权等产生的投资收益。

6.3 所有者权益变动表

金额单位：元

| 项目 | 本期 2024年01月01日至2024年12月31日 | | |
|--|------------------------------------|---------------|---------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 15,344,517.55 | 22,574,360.57 | 37,918,878.12 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | 0.00 | -6,446,368.85 | -6,446,368.85 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | 558,688.12 | 903,712.18 | 1,462,400.30 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,184,319.61 | 1,815,680.39 | 3,000,000.00 |
| 2. 基金赎回款 | -625,631.49 | -911,968.21 | -1,537,599.70 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列) | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 15,903,205.67 | 17,031,703.90 | 32,934,909.57 |
| 项目 | 上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益 (基金净值) | 15,678,729.37 | 13,033,966.35 | 28,712,695.72 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润) | 0.00 | 9,911,135.39 | 9,911,135.39 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列) | -334,211.82 | -370,741.17 | -704,952.99 |
| 其中：1. 基金申购款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 2. 基金赎回款 | -334,211.82 | -370,741.17 | -704,952.99 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列) | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末所有者权益 (基金净值) | 15,344,517.55 | 22,574,360.57 | 37,918,878.12 |



7、期末投资组合情况

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：元

| 项目 | 金额 |
|-------------------|---------------|
| 现金类资产 | 219.45 |
| 境内未上市、未挂牌公司股权投资 | 0.00 |
| 其中：优先股 | 0.00 |
| 其他股权类投资 | 0.00 |
| 上市公司定向增发投资 | 0.00 |
| 新三板投资 | 0.00 |
| 境内证券投资规模 | 1,581,739.90 |
| 结算备付金 | 1,656,367.20 |
| 存出保证金 | 29,701,681.16 |
| 股票投资 | 0.00 |
| 债券投资 | 0.00 |
| 其中：银行间市场债券 | 0.00 |
| 其中：利率债 | 0.00 |
| 其中：信用债 | 0.00 |
| 资产支持证券 | 0.00 |
| 基金投资（公募基金） | 0.00 |
| 其中：货币基金 | 0.00 |
| 期货及衍生品交易保证金 | 1,656,367.20 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 |
| 其他证券类标的 | 0.00 |
| 资管计划投资 | 0.00 |
| 商业银行理财产品投资 | 0.00 |
| 信托计划投资 | 0.00 |
| 基金公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00 |
| 保险资产管理计划投资 | 0.00 |
| 证券公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00 |
| 期货公司及其子公司资产管理计划投资 | 0.00 |
| 私募基金产品投资 | 0.00 |
| 未在协会备案的合伙企业份额 | 0.00 |
| 另类投资 | 0.00 |
| 境内债权类投资 | 0.00 |
| 银行委托贷款规模 | 0.00 |
| 信托贷款 | 0.00 |
| 应收账款投资 | 0.00 |
| 各类受（收）益权投资 | 0.00 |
| 票据（承兑汇票等）投资 | 0.00 |
| 其他债权投资 | 0.00 |



| | | |
|--------|---------|------|
| 境外投资 | 境外投资 | 0.00 |
| 其他资产 | 其他资产 | 0.00 |
| 基金负债情况 | 债券回购总额 | 0.00 |
| | 融资、融券总额 | 0.00 |
| | 其中：融券总额 | 0.00 |
| | 银行借款总额 | 0.00 |
| | 其他融资总额 | 0.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：元

| 序号 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 225,297.00 | 0.68 |
| B | 采矿业 | 746,076.00 | 2.27 |
| C | 制造业 | 23,732,496.16 | 72.06 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 324,877.00 | 0.99 |
| E | 建筑业 | 153,517.00 | 0.47 |
| F | 批发和零售业 | 1,125,937.00 | 3.42 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 336,055.00 | 1.02 |
| H | 住宿和餐饮业 | 0.00 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,299,753.00 | 6.98 |
| J | 金融业 | 58,406.00 | 0.18 |
| K | 房地产业 | 270,800.00 | 0.82 |
| L | 租赁和商务服务业 | 0.00 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 308,732.00 | 0.94 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 60,080.00 | 0.18 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | 0.00 | 0.00 |
| P | 教育 | 0.00 | 0.00 |
| Q | 卫生和社会工作 | 0.00 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 59,655.00 | 0.18 |
| S | 综合 | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 29,701,681.16 | 90.18 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合（如有）

| 行业类别 | 公允价值(人民币) | 占基金资产净值比例 (%) |
|------|-----------|------------------|
| 能源 | 0.00 | 0.00 |



| | | |
|----------|------|------|
| 原材料 | 0.00 | 0.00 |
| 工业 | 0.00 | 0.00 |
| 非日常生活消费品 | 0.00 | 0.00 |
| 日常消费品 | 0.00 | 0.00 |
| 医疗保健 | 0.00 | 0.00 |
| 金融 | 0.00 | 0.00 |
| 信息技术 | 0.00 | 0.00 |
| 通讯业务 | 0.00 | 0.00 |
| 公用事业 | 0.00 | 0.00 |
| 房地产 | 0.00 | 0.00 |
| 合计 | 0.00 | 0.00 |

信息披露报告是否经托管机构复核：是

