

28	300228	富瑞特装	2,726,164.57	10.03
29	002013	中航机电	2,706,459.39	9.96

28	300228	富瑞特装	2,726,164.57	10.03
29	002013	中航机电	2,706,459.39	9.96

30	002480	天士力股份	2,626,488,644	93.95
31	002481	双鹤食品	2,406,187,975	50.64
32	002219	恒智重工	2,402,393,123	96.61
33	000759	普洛药业	2,308,423,316	56.03
34	300035	掌趣科技	1,375,402,771	83.52
36	002271	东方雨虹	1,363,740,959	62.59
38	300394	迦安祥泰	2,249,977,597	62.28
37	002036	佳豪新材	1,198,236,676	60.64

28	300002	聚龙股份	2,124,112.17	7月
----	--------	------	--------------	----

39	002882	康泰医疗	2,130,710.00	7.75
40	000495	立信软件	2,033,648.16	7.48
41	200314	大舜科技	2,022,054.90	7.46
42	000791	美利信	1,994,398.00	7.34
43	000072	格力地产	1,966,770.00	7.20
44	000005	中国黄金	1,949,390.11	7.13
45	000066	长城服务	1,633,362.36	7.01
46	000200	华鲁化工	1,567,205.00	7.00
47	000041	二锅头酒	1,507,747.04	6.99
48	002018	华信股份	1,512,250.00	7.04
49	000061	格力集团	1,439,502.10	6.95
50	002666	康达科技	1,088,274.67	6.60

51	300043	北汽银安	1,779,393.37	632
52	000009	中信证券	1,729,029.00	628
53	000040	奇安信	1,719,380.00	626
54	000778	东方集团	1,646,030.00	620
55	300147	奇智创服	1,627,734.23	618
56	000204	神耕股份	1,622,540.40	597
57	300022	贝达药业	1,617,463.66	616
58	000005	世纪华通	1,616,249.24	610
59	000161	中信股份	1,626,403.12	582
60	000039	山东路桥	1,616,476.76	580
61	000079	渤海电力	1,360,790.00	565

63	950000	22710000	1,754,580.00	4.04
64	300000	26000000	1,300,000.00	4.09
65	600000	60000000	1,200,441.01	4.34
66	600000	60000000	1,201,000.78	4.32
67	300000	30000000	1,207,346.46	4.04
68	000000	73100000	1,201,990.02	4.64
69	000000	87000000	1,196,990.00	4.40
70	000000	100000000	1,140,442.47	4.30
71	000000	100000000	1,139,700.57	4.11
72	000000	100000000	1,139,000.00	4.01
73	000000	100000000	1,130,000.00	4.00

74	000002	新湖中宝	1,066,326/34	389
75	000002	飞天诚信	1,027,247/36	275
76	000002	北京商通	998,480/38	367
77	000026	中国大冶	939,171/35	328
78	002010	雪龙龙	877,850/32	323
79	000796	曲江文旅	844,262/39	245
80	000029	涑源股份 A	737,231/21	276

81	300049	金牛万利分	736.34242	2.71
82	300067	安联讯	712.20337	2.62
83	002196	康川制药	707.44151	2.60
84	001601	武汉凡谷	705.98954	2.58
85	300026	红日药业	692.64429	2.57
86	000663	沙隆达A	666.03287	2.46
87	000751	顺门尔达	613.377151	2.28
88	950204	丹农新材	546.86809	2.01

期末	2009.6	限售股份	644,136,508	2.01
----	--------	------	-------------	------

卖出主要一级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及发行权等减少的股票，“卖出金额”按买卖成交金额或成交价乘以数量列报，不考虑相关交易费用。

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

序号	买入股票收入（成交总额）	卖出股票收入（成交总额）
1	344,876,181.16	224,367,912.22

买入包括基金二级市场上市的主要的、新设、控股、上市公司、境外及行权等取得的股票，“买入金额”按买入成交金额或成交均价乘以买入数量，不考虑相关交易费用，卖出是指基金二级市场上市的主要的、新设、控股、境外、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，“卖出金额”按卖出成交金额或成交均价乘以卖出数量，不考虑相关交易费用。

期末按基金品种分类的权益类资产组合

本基金本报告期末持有债券投资

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末持有股票投资

期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名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。

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投资。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

期间损益单位：元

品种 合约名称 数量 公允价值 公允价值变动

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金合同、本基金暂不可投资于国债期货。

2. 投资组合报告附注

21

本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

22

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

期末其他各资产项目构成			单位:人民币元
序号	名称	金额	
1	卖出保证金	61,142,87	
2	应收证券清算款	-	
3	应收股利	-	
4	应收利息	2,026,01	
5	应收申购款	30,561,22	

6	其他应收款	
7	待摊费用	-
8	预提	-
9	合计	104,220.72

24. 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。

25. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

25.1 期末指数投资前十名股票中存在涉及受限情况的说明	
本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在涉及受限的情况。	
25.2 期末积极投资前五名股票中存在涉及受限情况的说明	
本基金本报告期末未持有积极投资股票。	
§8 基金持有人信息	
期末基金份额持有人户数及持有人结构	
	份额单位：份
	持有人户数

机构投资者	持有人(户数)	沪股通投资者的基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有比例	占基金总比例	持有比例	占基金总比例
成交量	624	120,586.29	24,565,318.00	20.05%	16,740,543.00	13.61%
持仓量	3,383	23,059.27	20,319.00	0.02%	10,779,597.00	0.08%
持仓份额	1,638	9,073.42	273,278.53	1.28%	35,446,514.54	98.72%
合计	5,122	30,475.50	24,792,962.53	13.27%	102,606,201.56	99.03%

期末上市基金前十名持有人

原股东A			
序号	持有人名称	持有份额(份)	占上表总份额比例
1	泰康人寿保险股份有限公司-投资-创新动力	5,740,438.00	71.61%
2	叶皓	4,077,162.00	50.62%
3	中信银行-华夏银行-中信证券基金定期组合专户集合资产管理计划	3,398,200.00	4.23%
4	上海中金企业投资有限公司	2,088,236.00	2.59%
5	胡海	2,084,167.00	2.58%

6	冲销	2,521,471.00	3.14%
7	固定权益准备-减值准备-信用减值-信用减值对21号资产管理计划	2,382,448.00	2.90%
8	预收货款	2,000,000.00	2.49%
9	预收款	1,700,000.00	2.11%
10	冲销	1,548,932.00	1.93%
成长B			
项目	持有人名称	持有份额(份)	占上列权益份额比例

1	余本行	3,390,000.00	4.81%
2	徐毅	2,290,000.00	4.01%
3	马瑞忠	898,000.00	1.26%
4	夏国忠	689,236.00	0.92%
5	许永海	620,000.00	0.77%
6	王基	620,000.00	0.77%
7	罗伟强	540,000.00	0.80%

8	流动性		5.00 / 100.00	0.00%
9	规范性		0.07 / 0.0000	0.02%
10	满意度		5.00 / 500.00	0.01%

期末基金管理人从事人员持有本基金的情况

项目	份额范围	持有份额总数(股)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	董事长	--	--
	董事	--	--
	高级管理人员	--	--
	基金经理	5,000 / 41,750.00	0.01%

	合计	100,477.00	100%
期末基金管理人员的从业人员持有本基金的情况			
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门从业人员持有本公司开放式基金	项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
		成长A	0
		成长B	0
		成长分级	0
	合计		0

本基金基金管理人持有本开放式基金	成长A		0
	成长B		0
	成长分级		0
	合计		0
§9 开放式基金份额变动			
单位:份			
项目	成长A	成长B	成长分级

基金合同生效日(2024年04月21日)基金份额总额	74,051,084.00	74,051,084.00	264,231,715.23
本报告期末基金份额总额	8,727,846.00	8,727,846.00	8,147,247.36
本报告基金申购份额	--	--	236,128,007.69
减:本报告基金赎回份额	--	--	158,242,342.44
本报告基金拆分基金份额(份额减少以“-”填列)	70,602,656.00	71,662,656.00	-127,256,221.61
本报告期间基金净申购份额	80,400,020.00	80,400,020.00	16,608,393.64

本报告基金份额变动份额包含基金份额赎回与转换及基金份额折算所引带来的变动数。

基金持有人有权依法召集基金份额持有人大会，审议和决定有关基金的重大事项。

### 3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

基金管理人：中信建投证券  
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址：北京市东城区朝阳门内大街188号  
法定代表人：王常青  
总经理：张松海  
成立日期：2005年10月25日。本公司经中国证监会、银监会核准，获准开展证券投资基金管理业务。  
营业期限长至：2096年11月17日。本公司为股份有限公司，通过中国证监会核准的证券公司融资融券业务。  
2020年01月22日本公司发布公告，聘任魏峻为本基金基金经理，原聘任魏峻因个人原因离职，不再担任本基金基金经理。  
基金管理人：人保财险  
住所为中国基金基金业协会注册地北京通州。

### 基金投资策略的改变

报告期内基金投资运作未发生重大变化。	
6 为基金进行审计的会计师事务所情况	
报告期内为基金进行审计的会计师事务所名称及变更情况	
7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	
报告期内, 本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。	
8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	
7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及债券支付情况	

金额单位:人民币元					
证券名称	交易币种及数量	成交交易		成交支付该证券的资金	
		成交日期	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期股票总佣金比例
华泰证券	1	621,406,307.28	92.03%	403,433.90	74.26%
平安证券	1	40,060,628.07	7.93%	38,977.90	9.74%

基金专用交易席位的选择标准如下：

经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

设备先进运行可靠，安全、稳定的通信条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具有较稳定的交易资金规模，资金来源正当，具备较强的研究能力和对证券的分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的行业研究报告和及时、准确、全面的与证券市场有关的信息服务，能根据公司业务管理基金特定要求，提供有关研究报告，具有开发基金投资创新的能力，能根据公司业务投资业务的开展，提供信息交流及其他方面业务开展的持续良好的服务和支持。

基金专用交易席位的选择标准如下：

基金资产被冻结或质押时,其公允价值按确定日期交易席位位的证券交易所内。

基金管理人或被冻结的证券经营机构签订席位使用协议。

基金专用交易席位的变更情况:

原席位未变更。

72 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占回购债券	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期权证

	成交金额(万元)	成交金额占比例	成交金额(万元)	成交金额占比例	成交金额(万元)	成交金额占比例
陈德胜	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
李国章	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
李国章	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

2016年3月21日,万基基金管理有限公司发布公开转让说明书,披露了关联交易事项及关联交易公允性说明,并与相关监管部门、会计师事务所协商一致,自2016年3月21日起,公司对于关联交易事项进行了充分信息披露,并经过公司董事会、监事会审议通过,并经会计师事务所出具专项审计报告予以鉴证;同时,公司对于关联交易事项进行了充分披露,采用第三方中介机构出具的审计报告予以验证。于2016年3月26日,关联交易事项经一位独立基金资产净值的影响率不超过20%。

**万基基金管理有限公司**

2015年8月26日