

泓德智选启元混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:华泰证券股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年1月1日起至2025年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	77
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	77
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	77
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	77
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
7.12 投资组合报告附注	78
§8 基金份额持有人信息	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	80
§9 开放式基金份额变动.....	80
§10 重大事件揭示.....	80
10.1 基金份额持有人大会决议.....	80
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
10.4 基金投资策略的改变	81
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	81
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	81
10.8 其他重大事件	82
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§12 备查文件目录.....	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德智选启元混合型证券投资基金	
基金简称	泓德智选启元混合	
基金主代码	019982	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年11月21日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	128,435,672.75份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C
下属分级基金的交易代码	019982	019983
报告期末下属分级基金的份额总额	105,245,869.20份	23,189,803.55份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过研究宏观经济周期及调控政策规律，通过分析宏观与微观经济指标、市场指标及政策因素，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。在股票投资中，本基金运用基金管理人开发的"多因子选股模型"以及基本面选股等多种策略进行股票选择并据此构建股票投资组合。在债券投资中，本基金采取适当的久期策略、个券选择策略、可转换债券及可交换债券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略和资产支持证券投资策略。此外，本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货与国债期货投资，以调整投资组合的风险暴露程度，降低系统性风险。
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%＋中国债券综合全价指

	数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期预期风险与预期收益低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金。

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		泓德基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	刘强
	联系电话	010-59850151	025-83387812
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	liuqiang023506@htsc.com
客户服务电话		4009-100-888	95597
传真		010-59850195	025-83387215
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区 北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	江苏省南京市江东中路228号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码		100088	210009
法定代表人		王德晓	张伟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	泓德智选启元混合 A	泓德智选启元混合 C
本期已实现收益	8,826,150.18	2,047,767.19
本期利润	15,147,366.25	3,181,932.32
加权平均基金份额本期利润	0.1376	0.1203
本期加权平均净值利润率	13.04%	11.50%
本期基金份额净值增长率	12.05%	11.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	14,956,504.85	3,123,353.93
期末可供分配基金份额利润	0.1421	0.1347
期末基金资产净值	120,202,374.05	26,313,157.48
期末基金份额净值	1.1421	1.1347
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	14.21%	13.47%

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

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

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

3.2 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

泓德智选启元混合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
过去一个月	5.79%	0.67%	3.91%	0.71%	1.88%	-0.04%
过去三个月	7.65%	1.24%	1.06%	1.34%	6.59%	-0.10%
过去六个月	12.05%	1.13%	3.07%	1.22%	8.98%	-0.09%
过去一年	31.52%	1.54%	18.22%	1.55%	13.30%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	14.21%	1.47%	5.13%	1.47%	9.08%	0.00%

泓德智选启元混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.76%	0.67%	3.91%	0.71%	1.85%	-0.04%
过去三个月	7.54%	1.24%	1.06%	1.34%	6.48%	-0.10%
过去六个月	11.82%	1.13%	3.07%	1.22%	8.75%	-0.09%
过去一年	31.00%	1.54%	18.22%	1.55%	12.78%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	13.47%	1.47%	5.13%	1.47%	8.34%	0.00%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%

基准指数的构建原则如下：

（1）中证 500 指数是中证指数有限公司编制的，反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况的指数，具有良好的市场代表性和市场影响力，适合作为本基金 A 股投资部分的业绩基准。

（2）中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

（3）由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置

比例符合基金合同要求，基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§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

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

泓德基金始终以“为客户创造价值”为己任，坚持长期价值投资理念，发挥主动投资管理优势，致力于为广大投资者提供专业、优质、高效的资产管理服务，力争成为受人尊重的资产管理机构。

公司已建立科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳定专业的投资研究团队，专业高效的市场服务体系，稳健的运营保障体系。公司已覆盖从公募到专户，从主动权益投资、量化投资到固定收益投资，从低风险到中、高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等主流基金品种，产品谱系不断完善，满足居民日益多元的财富管理需求。

未来公司将继续秉持投资者利益至上的初心，不断精进，推动公司高质量发展。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李子昂	本基金的基金经理、智能投资部副总监	2023-11-29	-	11年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。
刘令宇	本基金的基金经理	2024-08-20	-	6年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任泰达宏利基金管

					理有限公司策略投资部研究员。
--	--	--	--	--	----------------

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期，对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。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《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股整体呈现上涨趋势，成交量较为活跃，小盘股好于大盘股，成长风格优于价值风格，过去两年一枝独秀的红利板块出现回调，概念轮动此消彼长，年初的DeepSeek行情、一季度的机器人行情和贯穿整个上半年的创新药行情也让中国的硬科技

价值得到重估。交投活跃且震荡向上的市场对量化策略也较为友好，虽然4月7日美国“对等关税”推出导致市场短期出现恐慌，产品净值也有不小回撤，但超额收益总体稳健，我们在风格暴露上相对较为克制，努力避免因风格收益的大幅波动而造成的超额收益大幅波动，但同时我们也在努力迭代模型，力争让模型更好地适应市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德智选启元混合A基金份额净值为1.1421元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为12.05%，同期业绩比较基准收益率为3.07%；截至报告期末泓德智选启元混合C基金份额净值为1.1347元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.82%，同期业绩比较基准收益率为3.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国科技股出现了明显的估值修复，背后源于我们在硬科技研发上不断的厚积薄发，DeepSeek的横空出世让我们看到了我国自主大模型广阔的发展前景，机器人的百花齐放让我们看到了具身智能的可能性，我们在AI领域拥有大量的人才储备，广阔的下游市场空间和丰厚的资本支持，我们也有理由相信我国AI的发展不是昙花一现，未来的机会很多；创新药领域同样值得期待，我国FIC数量的占比显著提升、License-out交易额逐步提高，是对我国创新药领域政策扶持、融资便利和科学家红利的最好体现。当然，硬科技板块的繁荣和宽松的宏观环境与投资者较高的风险偏好息息相关。宏观方面，上半年宏观经济在险峻的外部环境下依然表现出较好韧性，GDP同比增长5.3%，在补贴等促消费政策的拉动下，消费成为促进GDP增长的主要动力，“抢出口”行为虽然一定程度上预支了出口需求，但也使得在二季度巨大关税威胁冲击下，出口依然对上半年经济增长做出较大贡献，投资总体承压，但结构有所改善，新质生产力加速发展。展望下半年，随着宏观政策的不断发力，国内大循环不断强化，经济稳中向好的发展态势不会改变。回到资本市场，市场的不断上涨也带动了投资者的做多热情，成交量稳步抬升，我们也会继续完善深度学习选股模型，努力通过多模型多策略的方式为投资者创造更好收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值委员会，估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专

业胜任能力。基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。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，托管人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。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2025年06月30日，期末可供分配利润为18,079,858.78元，其中：泓德智选启元混合A期末可供分配利润为14,956,504.85元（泓德智选启元混合A的未分配利润已实现部分为15,220,595.35元，未分配利润未实现部分为-264,090.50元），泓德智选启元混合C期末可供分配利润为3,123,353.93元（泓德智选启元混合C的未分配利润已实现部分为3,180,360.43元，未分配利润未实现部分为-57,006.50元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金2025年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德智选启元混合型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	11,680,554.50	12,418,081.60
结算备付金		1,008.50	1,001.90
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	134,262,279.32	133,105,842.54
其中：股票投资		134,239,478.25	133,099,027.78
基金投资		-	-
债券投资		22,801.07	6,814.76
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,627,632.47	1,988,927.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		148,571,474.79	147,513,853.70

负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,807,375.06	380,473.53
应付管理人报酬		137,039.73	146,829.05
应付托管费		17,129.95	18,353.65
应付销售服务费		8,108.23	12,302.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.01	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	86,290.28	164,057.50
负债合计		2,055,943.26	722,016.02
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	128,435,672.75	144,155,504.73
未分配利润	6.4.7.8	18,079,858.78	2,636,332.95
净资产合计		146,515,531.53	146,791,837.68
负债和净资产总计		148,571,474.79	147,513,853.70

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额总额128,435,672.75份，其中A类基金份额总额为105,245,869.20份，基金份额净值为1.1421元；C类基金份额总额为23,189,803.55份，基金份额净值为1.1347元。

6.2 利润表

会计主体：泓德智选启元混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		19,439,342.41	-36,024,085.12
1.利息收入		69,265.79	94,645.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	69,265.79	94,645.15
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）		11,587,199.78	-28,467,798.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,043,605.09	-30,518,128.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	20,009.76	67,086.49
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,523,584.93	1,983,244.11
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	7,455,381.20	-7,950,265.53
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.15	327,495.64	299,333.57
减：二、营业总支出		1,110,043.84	1,541,788.64
1.管理人报酬		859,005.39	1,060,485.16
2.托管费		107,375.63	132,560.62

3.销售服务费		55,319.66	251,750.37
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	0.09
8.其他费用	6.4.7.16	88,343.16	96,992.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,329,298.57	-37,565,873.76
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		18,329,298.57	-37,565,873.76
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,329,298.57	-37,565,873.76

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选启元混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	144,155,504.73	2,636,332.95	146,791,837.68
二、本期期初净资产	144,155,504.73	2,636,332.95	146,791,837.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,719,831.98	15,443,525.83	-276,306.15
（一）、综合收益	-	18,329,298.57	18,329,298.57

总额			
（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）	-15,719,831.98	-2,885,772.74	-18,605,604.72
其中：1.基金申购款	123,931,316.13	6,949,463.42	130,880,779.55
2.基金赎回款	-139,651,148.11	-9,835,236.16	-149,486,384.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	128,435,672.75	18,079,858.78	146,515,531.53
项 目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	266,461,389.34	-4,341,206.94	262,120,182.40
二、本期期初净资产	266,461,389.34	-4,341,206.94	262,120,182.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,333,168.10	-20,919,752.89	-97,252,920.99
（一）、综合收益总额	-	-37,565,873.76	-37,565,873.76
（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）	-76,333,168.10	16,646,120.87	-59,687,047.23

其中：1.基金申购款	135,135,639.83	-12,916,908.50	122,218,731.33
2.基金赎回款	-211,468,807.93	29,563,029.37	-181,905,778.56
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	190,128,221.24	-25,260,959.83	164,867,261.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓	王德晓	王玲
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德智选启元混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2023]2444号《关于准予泓德智选启元混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德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《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集266,435,025.34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(2023)第0557号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》于2023年11月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为266,461,389.34份，其中认购资金利息折合26,364.00份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

根据《泓德智选启元混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式等不同，将基金份额分为不同的类别。收取认（申）购费，不收取销售服务费的，称为A类基金份额；收取销售服务费，不收取认（申）购费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为：计算

日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

6.4.2 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》、《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年1月1日至2025年6月30日止期间的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2025年6月30日的财务状况以及2025年1月1日至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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。

6.4.6 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[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]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。

(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。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
活期存款	6,403,475.24
等于：本金	6,401,094.96
加：应计利息	2,380.28
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	5,277,079.26
等于：本金	5,276,389.40
加：应计利息	689.86
减：坏账准备	-
合计	11,680,554.50

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	128,686,446.00	-	134,239,478.25	5,553,032.25
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	22,800.00	1.07	22,801.07	-

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	22,800.00	1.07	22,801.07	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		128,709,246.00	1.07	134,262,279.32	5,553,032.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	798.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
其他应付	6,148.20

合计	86,290.28
----	-----------

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德智选启元混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	110,664,572.14	110,664,572.14
本期申购	109,144,524.64	109,144,524.64
本期赎回（以“-”号填列）	-114,563,227.58	-114,563,227.58
本期末	105,245,869.20	105,245,869.20

6.4.7.7.2 泓德智选启元混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	33,490,932.59	33,490,932.59
本期申购	14,786,791.49	14,786,791.49
本期赎回（以“-”号填列）	-25,087,920.53	-25,087,920.53
本期末	23,189,803.55	23,189,803.55

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德智选启元混合A

单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,419,149.41	-4,277,851.49	2,141,297.92
本期期初	6,419,149.41	-4,277,851.49	2,141,297.92
本期利润	8,826,150.18	6,321,216.07	15,147,366.25

本期基金份额交易产生的变动数	-24,704.24	-2,307,455.08	-2,332,159.32
其中：基金申购款	10,607,034.65	-4,542,632.53	6,064,402.12
基金赎回款	-10,631,738.89	2,235,177.45	-8,396,561.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,220,595.35	-264,090.50	14,956,504.85

6.4.7.8.2 泓德智选启元混合C

单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,780,447.55	-1,285,412.52	495,035.03
本期期初	1,780,447.55	-1,285,412.52	495,035.03
本期利润	2,047,767.19	1,134,165.13	3,181,932.32
本期基金份额交易产生的变动数	-647,854.31	94,240.89	-553,613.42
其中：基金申购款	1,336,974.14	-451,912.84	885,061.30
基金赎回款	-1,984,828.45	546,153.73	-1,438,674.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,180,360.43	-57,006.50	3,123,353.93

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	55,992.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	13,147.99
结算备付金利息收入	6.60
其他	118.30
合计	69,265.79

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	525,634,347.26
减：卖出股票成本总额	514,811,191.92
减：交易费用	779,550.25
买卖股票差价收入	10,043,605.09

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	20.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,989.52
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	20,009.76

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	91,413.43
减：卖出债券（债	71,400.00

转股及债券到期兑 付) 成本总额	
减: 应计利息总额	20.24
减: 交易费用	3.67
买卖债券差价收入	19,989.52

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,523,584.93
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	1,523,584.93

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	7,455,381.20
——股票投资	7,456,794.92
——债券投资	-1,413.72
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减: 应税金融商品公允	-

价值变动产生的预估增值税	
合计	7,455,381.20

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	327,392.31
基金转换费收入	103.33
合计	327,495.64

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。
2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费25%的部分归入转出基金的基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
合计	88,343.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30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
华泰证券	100,618,908.16	9.74%	936,662,847.80	64.83%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期债券买	成交金额	占当期债券买

		卖成交 总额的 比例		卖成交 总额的 比例
华泰证券	12,895.86	14.11%	218,517.00	73.80%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30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
华泰证券	43,859.88	9.74%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30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
华泰证券	675,606.34	64.83%	-	-

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服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至20	上年度可比期间 2024年01月01日至20
----	----------------------	---------------------------

	25年06月30日	24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	859,005.39	1,060,485.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	316,946.24	382,110.52
应支付基金管理人的净管理费	542,059.15	678,374.64

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率每日计提，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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	107,375.63	132,560.62

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，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×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C	合计
泓德基金	0.00	10.76	10.76
华泰证券	0.00	30,351.00	30,351.00
合计	0.00	30,361.76	30,361.76
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C	合计
泓德基金	0.00	11,066.71	11,066.71

华泰证券	0.00	174,378.25	174,378.25
合计	0.00	185,444.96	185,444.96

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：
日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

泓德智选启元混合A

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	12,285,002.66
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	12,285,002.66
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.46%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换（入）份额、强制调增份额。
2、基金管理人投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.4.10.4.2 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

泓德智选启元混合A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
-------	--------------------	---------------------

	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例
自然人股 东	209,696.38	0.16%	209,696.38	0.15%

6.4.10.5 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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券- 托管户	6,403,475.24	55,992.90	8,724,673.79	76,516.58
华泰证券- 证券户	939,083.57	708.51	6,841,157.68	4,704.95

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人华泰证券存放在中国工商银行南京奥体支行，按银行同业利率计息；本基金证券户的存款为本基金存放于华泰证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期内，本基金参与了华泰联合证券有限责任公司（基金托管人华泰证券股份有限公司的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的关联方）承销期内承销的钧崴电子科技股份有限公司、胜科纳米（苏州）股份有限公司的首次公开发行人民币普通股（A股）网下申购。（上年度可比期间，本基金参与了华泰联合证券有限责任公司（基金托管人华泰证券股份有限公司的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的关联方）承销期内承销的苏州西典新能源电气股份有限公司、成都华微电子科技股份有限公司、上海龙旗科技股份有限公司的首次公开发行人民币普通股（A股）网下申购。）

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688411	海博思创	2025-01-20	6个月以上	限售股	19.38	83.49	301	5,833.38	25,130.49	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6个月以上	限售股	10.40	34.11	456	4,742.40	15,554.16	-
301602	超研股份	2025-01-15	6个月以上	限售股	6.70	24.80	611	4,093.70	15,152.80	-
688583	思看科技	2025-01-08	6个月以上	限售股	33.46	79.68	177	4,550.56	14,103.36	备注2（1）
688757	胜科纳米	2025-03-18	6个月以上	限售股	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6个月以上	限售股	4.92	18.99	696	3,424.32	13,217.04	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6个月以上	限售股	11.68	26.95	477	5,571.36	12,855.15	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6个月以上	限售股	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
001388	信通电子	2025-06-2	5个交易日	新股未上	16.42	16.42	684	11,231.28	11,231.28	-

		4	日	市						
301678	新恒汇	2025-06-13	6个月以上	限售股	12.80	44.54	238	3,046.40	10,600.52	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6个月以上	限售股	41.90	77.87	116	3,477.70	9,032.92	备注2 (2)
301275	汉朔科技	2025-03-04	6个月以上	限售股	27.50	56.19	127	3,492.50	7,136.13	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月以上	限售股	12.30	54.45	123	1,512.90	6,697.35	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6个月以上	限售股	22.77	39.33	169	3,848.13	6,646.77	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6个月以上	限售股	5.30	14.44	412	2,183.60	5,949.28	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6个月以上	限售股	28.33	44.98	130	3,682.90	5,847.40	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6个月以上	限售股	7.40	20.21	288	2,131.20	5,820.48	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6个月以上	限售股	39.92	45.22	116	3,193.60	5,245.52	备注2 (3)
301595	太力科技	2025-05-12	6个月以上	限售股	17.05	29.10	152	2,591.60	4,423.20	-
603124	江南新材	2025-03-1	6个月以	限售股	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-

		2	上							
301636	泽润新能	2025-04-30	6个月以上	限售股	33.06	47.46	80	2,644.80	3,796.80	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6个月以上	限售股	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6个月以上	限售股	12.08	18.12	142	1,715.36	2,573.04	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月以上	限售股	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月以上	限售股	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
603271	永杰新材	2025-03-04	6个月以上	限售股	20.60	35.08	59	1,215.40	2,069.72	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6个月以上	限售股	20.52	37.47	51	1,046.52	1,910.97	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6个月以上	限售股	24.18	33.32	54	1,305.72	1,799.28	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月以上	新股未上市且限售	16.42	16.42	76	1,247.92	1,247.92	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注

113695	华辰转债	2025-06-23	13个交易日	新债未上市	100.00	100.00	120	12,000.00	12,000.58	-
123257	安克转债	2025-06-16	14个交易日	新债未上市	100.00	100.01	58	5,800.00	5,800.38	-
118057	甬矽转债	2025-06-27	13个交易日	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.11	-

注：1、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。基金参与申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让，其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分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。

2、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：

- （1）该股票于2025年6月19日实施权益分派方案：每股派0.55元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每股转增0.3股。
- （2）该股票于2025年5月28日实施权益分派方案：每10股派15元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增4股。
- （3）该股票于2025年6月6日实施权益分派方案：每10股派5元人民币现金（含税）；同时，以资本公积向全体股东每10股转增4.5股。

6.4.12.2 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项	38.05	2025-07-11	39.98	6,538	147,185.79	248,770.90	-

注：本基金截至2025年6月30日止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股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他信用良好的境内商业银行，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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；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。

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(若有)占基金资产净值的比例为0.02%(上年度末：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12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的情况外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产占基金资产净值比例、单一证券占基金资产净值比例及7日可变现资产价值等流动性指标均符合法律法规的要求。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,680,554.50	-	-	-	11,680,554.50
结算备付金	1,008.50	-	-	-	1,008.50
交易性金融资产	-	-	22,801.07	134,239,478.25	134,262,279.32
应收申购款	-	-	-	2,627,632.47	2,627,632.47
资产总计	11,681,563.00	-	22,801.07	136,867,110.72	148,571,474.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,807,375.06	1,807,375.06
应付管理人报酬	-	-	-	137,039.73	137,039.73
应付托管费	-	-	-	17,129.95	17,129.95
应付销售服务费	-	-	-	8,108.23	8,108.23
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	86,290.28	86,290.28
负债总计	-	-	-	2,055,943.26	2,055,943.26
利率敏感度缺口	11,681,563.00	-	22,801.07	134,811,167.46	146,515,531.53
上年度末 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	12,418,081.60	-	-	-	12,418,081.60
结算备付金	1,001.90	-	-	-	1,001.90
交易性金融资产	-	-	6,814.76	133,099,027.78	133,105,842.54
应收申购款	-	-	-	1,988,927.66	1,988,927.66

资产总计	12,419,083.50	-	6,814.76	135,087,955.44	147,513,853.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	380,473.53	380,473.53
应付管理人报酬	-	-	-	146,829.05	146,829.05
应付托管费	-	-	-	18,353.65	18,353.65
应付销售服务费	-	-	-	12,302.29	12,302.29
其他负债	-	-	-	164,057.50	164,057.50
负债总计	-	-	-	722,016.02	722,016.02
利率敏感度缺口	12,419,083.50	-	6,814.76	134,365,939.42	146,791,837.68

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为0.02%(上年度末：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，及时地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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	134,239,478.25	91.62	133,099,027.78	90.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	134,239,478.25	91.62	133,099,027.78	90.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	6,660,694.05	7,065,740.92
	业绩比较基准下降5%	-6,660,694.05	-7,065,740.92

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	133,764,481.83	132,677,793.81
第二层次	284,051.17	116,196.70
第三层次	213,746.32	311,852.03
合计	134,262,279.32	133,105,842.54

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
----	----	----	--------------

1	权益投资	134,239,478.25	90.35
	其中：股票	134,239,478.25	90.35
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	22,801.07	0.02
	其中：债券	22,801.07	0.02
	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	11,681,563.00	7.86
8	其他各项资产	2,627,632.47	1.77
9	合计	148,571,474.79	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	226,854.00	0.15
B	采矿业	4,674,534.00	3.19
C	制造业	86,361,499.36	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,220,945.00	2.88
E	建筑业	876,975.00	0.60
F	批发和零售业	4,875,388.00	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,922,067.00	1.99
H	住宿和餐饮业	100,980.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,291,415.02	7.02
J	金融业	10,755,971.90	7.34
K	房地产业	1,797,015.00	1.23
L	租赁和商务服务业	1,138,485.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	1,554,865.77	1.06

N	水利、环境和公共设施管理业	1,237,495.20	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	129,291.00	0.09
Q	卫生和社会工作	417,129.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	2,606,233.00	1.78
S	综合	52,335.00	0.04
	合计	134,239,478.25	91.62

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000623	吉林敖东	44,900	761,055.00	0.52
2	002414	高德红外	74,000	758,500.00	0.52
3	300476	胜宏科技	5,000	671,900.00	0.46
4	600998	九州通	121,500	624,510.00	0.43
5	300502	新易盛	4,800	609,696.00	0.42
6	002080	中材科技	31,200	608,400.00	0.42
7	600739	辽宁成大	54,500	599,500.00	0.41
8	605499	东鹏饮料	1,900	596,695.00	0.41
9	002625	光启技术	14,000	559,720.00	0.38
10	002624	完美世界	36,800	558,256.00	0.38
11	600956	新天绿能	72,300	558,156.00	0.38
12	300803	指南针	6,880	554,940.80	0.38
13	000553	安道麦A	76,800	554,496.00	0.38
14	603379	三美股份	11,300	543,756.00	0.37
15	601319	中国人保	60,000	522,600.00	0.36
16	000893	亚钾国际	17,200	518,408.00	0.35
17	601568	北元集团	123,400	512,110.00	0.35
18	000783	长江证券	72,600	503,118.00	0.34

19	601991	大唐发电	158,300	501,811.00	0.34
20	601963	重庆银行	45,200	490,872.00	0.34
21	000050	深天马 A	57,400	489,048.00	0.33
22	603444	吉比特	1,600	483,120.00	0.33
23	688188	柏楚电子	3,660	481,875.60	0.33
24	688208	道通科技	15,708	480,664.80	0.33
25	002532	天山铝业	57,200	475,332.00	0.32
26	002203	海亮股份	45,700	471,624.00	0.32
27	603132	金徽股份	35,300	468,431.00	0.32
28	300140	节能环保	75,600	466,452.00	0.32
29	603858	步长制药	28,200	457,968.00	0.31
30	600499	科达制造	46,600	456,680.00	0.31
31	002202	金风科技	43,300	443,825.00	0.30
32	603113	金能科技	63,800	442,134.00	0.30
33	002373	千方科技	46,700	434,310.00	0.30
34	002128	电投能源	21,800	431,204.00	0.29
35	600578	京能电力	95,800	430,142.00	0.29
36	000959	首钢股份	124,200	422,280.00	0.29
37	601899	紫金矿业	21,600	421,200.00	0.29
38	688055	龙腾光电	113,600	420,320.00	0.29
39	300972	万辰集团	2,300	414,552.00	0.28
40	688668	鼎通科技	6,600	412,236.00	0.28
41	003022	联泓新科	25,600	405,248.00	0.28
42	300750	宁德时代	1,600	403,552.00	0.28
43	600873	梅花生物	37,500	400,875.00	0.27
44	300101	振芯科技	17,200	389,236.00	0.27
45	000776	广发证券	23,100	388,311.00	0.27
46	300690	双一科技	16,000	387,360.00	0.26
47	600760	中航沈飞	6,600	386,892.00	0.26
48	002595	豪迈科技	6,500	384,930.00	0.26
49	002463	沪电股份	9,000	383,220.00	0.26

50	301180	万祥科技	25,900	381,507.00	0.26
51	600219	南山铝业	99,500	381,085.00	0.26
52	300017	网宿科技	35,300	378,416.00	0.26
53	600685	中船防务	13,900	377,941.00	0.26
54	002587	奥拓电子	58,500	377,325.00	0.26
55	603993	洛阳钼业	44,800	377,216.00	0.26
56	688588	凌志软件	25,866	376,867.62	0.26
57	600663	陆家嘴	42,400	375,664.00	0.26
58	603799	华友钴业	10,100	373,902.00	0.26
59	601678	滨化股份	90,100	373,014.00	0.25
60	001203	大中矿业	39,400	372,330.00	0.25
61	601717	中创智领	22,400	372,288.00	0.25
62	600862	中航高科	14,100	367,728.00	0.25
63	301318	维海德	10,830	366,487.20	0.25
64	601919	中远海控	24,100	362,464.00	0.25
65	300274	阳光电源	5,300	359,181.00	0.25
66	600039	四川路桥	36,100	357,390.00	0.24
67	300447	全信股份	22,800	357,276.00	0.24
68	605218	伟时电子	15,800	353,604.00	0.24
69	300373	扬杰科技	6,800	352,920.00	0.24
70	603898	好莱客	32,000	351,680.00	0.24
71	600887	伊利股份	12,600	351,288.00	0.24
72	603087	甘李药业	6,400	350,592.00	0.24
73	300768	迪普科技	20,300	348,145.00	0.24
74	601098	中南传媒	26,500	347,680.00	0.24
75	300369	绿盟科技	44,700	347,319.00	0.24
76	603676	卫信康	34,100	345,433.00	0.24
77	605058	澳弘电子	11,200	342,272.00	0.23
78	300866	安克创新	3,000	340,800.00	0.23
79	600030	中信证券	12,300	339,726.00	0.23
80	601555	东吴证券	38,800	339,500.00	0.23

81	601456	国联民生	32,600	337,410.00	0.23
82	603259	药明康德	4,800	333,840.00	0.23
83	600295	鄂尔多斯	38,000	330,980.00	0.23
84	000166	申万宏源	65,500	328,810.00	0.22
85	002384	东山精密	8,600	324,822.00	0.22
86	603380	易德龙	12,200	324,520.00	0.22
87	002648	卫星化学	18,700	324,071.00	0.22
88	300777	中简科技	8,900	322,625.00	0.22
89	300559	佳发教育	27,300	322,140.00	0.22
90	600061	国投资本	42,700	321,104.00	0.22
91	601928	凤凰传媒	28,700	320,579.00	0.22
92	002925	盈趣科技	17,700	318,246.00	0.22
93	000733	振华科技	6,300	315,315.00	0.22
94	300752	隆利科技	13,900	312,472.00	0.21
95	603213	镇洋发展	27,900	311,643.00	0.21
96	600418	江淮汽车	7,700	308,693.00	0.21
97	605138	盛泰集团	46,000	308,200.00	0.21
98	002001	新 和 成	14,400	306,288.00	0.21
99	002142	宁波银行	11,100	303,696.00	0.21
100	600329	达仁堂	9,100	303,576.00	0.21
101	002983	芯瑞达	14,300	303,017.00	0.21
102	002311	海大集团	5,100	298,809.00	0.20
103	688018	乐鑫科技	2,040	298,044.00	0.20
104	301195	北路智控	8,300	297,140.00	0.20
105	002461	珠江啤酒	26,300	296,927.00	0.20
106	601126	四方股份	18,000	292,860.00	0.20
107	002736	国信证券	25,200	290,304.00	0.20
108	002500	山西证券	49,500	289,080.00	0.20
109	601958	金钼股份	26,400	288,816.00	0.20
110	002558	巨人网络	12,100	284,955.00	0.19
111	600655	豫园股份	50,900	282,495.00	0.19

112	000301	东方盛虹	33,800	281,554.00	0.19
113	601218	吉鑫科技	68,000	279,480.00	0.19
114	600638	新黄浦	47,400	277,764.00	0.19
115	000825	太钢不锈	77,200	277,148.00	0.19
116	002911	佛燃能源	26,700	273,942.00	0.19
117	002099	海翔药业	49,700	273,350.00	0.19
118	603040	新坐标	6,800	273,156.00	0.19
119	002977	天箭科技	6,400	271,808.00	0.19
120	688552	航天南湖	6,800	271,388.00	0.19
121	600918	中泰证券	42,200	271,346.00	0.19
122	601811	新华文轩	18,600	271,002.00	0.18
123	301102	兆讯传媒	24,800	270,816.00	0.18
124	301196	唯科科技	4,000	270,680.00	0.18
125	002315	焦点科技	5,900	269,571.00	0.18
126	300990	同飞股份	5,400	269,460.00	0.18
127	300850	新强联	7,400	265,068.00	0.18
128	603529	爱玛科技	7,700	264,880.00	0.18
129	600583	海油工程	48,500	264,810.00	0.18
130	300512	中亚股份	30,800	264,264.00	0.18
131	603633	徕木股份	30,400	264,176.00	0.18
132	002266	浙富控股	85,600	263,648.00	0.18
133	300821	东岳硅材	33,300	261,738.00	0.18
134	600096	云天化	11,900	261,443.00	0.18
135	300852	四会富仕	8,100	261,387.00	0.18
136	603466	风语筑	25,900	261,331.00	0.18
137	000807	云铝股份	16,300	260,474.00	0.18
138	688112	鼎阳科技	7,044	260,416.68	0.18
139	300548	长芯博创	3,900	260,403.00	0.18
140	300162	雷曼光电	34,200	259,920.00	0.18
141	301396	宏景科技	4,180	259,619.80	0.18
142	600109	国金证券	29,600	259,592.00	0.18

143	603173	福斯达	7,300	259,515.00	0.18
144	301419	阿莱德	9,360	258,336.00	0.18
145	300830	金现代	28,200	257,466.00	0.18
146	688183	生益电子	5,028	257,433.60	0.18
147	601336	新华保险	4,400	257,400.00	0.18
148	600350	山东高速	24,100	256,906.00	0.18
149	688508	芯朋微	4,600	256,772.00	0.18
150	603713	密尔克卫	4,800	255,936.00	0.17
151	688093	世华科技	8,239	255,820.95	0.17
152	000977	浪潮信息	5,000	254,400.00	0.17
153	300080	易成新能	60,800	254,144.00	0.17
154	688509	正元地信	59,200	253,968.00	0.17
155	301031	中熔电气	3,180	253,287.00	0.17
156	688223	晶科能源	48,800	253,272.00	0.17
157	601211	国泰海通	13,200	252,912.00	0.17
158	002206	海利得	49,400	252,434.00	0.17
159	600983	惠而浦	24,300	252,234.00	0.17
160	603520	司太立	25,700	251,860.00	0.17
161	300824	北鼎股份	21,100	251,723.00	0.17
162	688128	中国电研	10,274	251,713.00	0.17
163	688800	瑞可达	5,109	251,362.80	0.17
164	002996	顺博合金	34,100	250,976.00	0.17
165	600662	外服控股	49,100	250,901.00	0.17
166	600460	士兰微	10,100	250,682.00	0.17
167	300484	蓝海华腾	11,200	250,544.00	0.17
168	300279	和晶科技	36,100	250,173.00	0.17
169	002534	西子洁能	22,200	249,528.00	0.17
170	301221	光庭信息	4,800	249,456.00	0.17
171	000100	TCL科技	57,600	249,408.00	0.17
172	300434	金石亚药	25,900	249,158.00	0.17
173	301109	军信股份	16,740	249,091.20	0.17

174	002293	罗莱生活	28,500	249,090.00	0.17
175	000885	城发环境	18,700	249,084.00	0.17
176	301017	漱玉平民	19,400	248,902.00	0.17
177	688313	仕佳光子	6,538	248,770.90	0.17
178	601900	南方传媒	15,900	248,676.00	0.17
179	002314	南山控股	94,500	248,535.00	0.17
180	603327	福蓉科技	26,850	248,362.50	0.17
181	301526	国际复材	68,200	248,248.00	0.17
182	002096	易普力	20,000	248,200.00	0.17
183	002939	长城证券	29,600	248,048.00	0.17
184	600132	重庆啤酒	4,500	247,950.00	0.17
185	600031	三一重工	13,800	247,710.00	0.17
186	600675	中华企业	86,000	247,680.00	0.17
187	002588	史丹利	28,100	247,561.00	0.17
188	600179	安通控股	89,500	247,020.00	0.17
189	002025	航天电器	4,800	246,768.00	0.17
190	600866	星湖科技	35,600	245,996.00	0.17
191	600796	钱江生化	41,800	245,366.00	0.17
192	002563	森马服饰	46,500	244,590.00	0.17
193	603565	中谷物流	25,600	244,480.00	0.17
194	300573	兴齐眼药	4,720	244,448.80	0.17
195	301060	兰卫医学	25,300	244,145.00	0.17
196	300879	大叶股份	6,200	243,536.00	0.17
197	601686	友发集团	42,800	243,104.00	0.17
198	600271	航天信息	26,300	243,012.00	0.17
199	000651	格力电器	5,400	242,568.00	0.17
200	600997	开滦股份	41,100	242,079.00	0.17
201	002353	杰瑞股份	6,900	241,500.00	0.16
202	301362	民爆光电	5,900	240,779.00	0.16
203	301132	满坤科技	6,800	239,904.00	0.16
204	000333	美的集团	3,300	238,260.00	0.16

205	603129	春风动力	1,100	238,150.00	0.16
206	300257	开山股份	23,600	237,652.00	0.16
207	000877	天山股份	51,200	237,568.00	0.16
208	002545	东方铁塔	26,600	236,474.00	0.16
209	600517	国网英大	46,200	235,620.00	0.16
210	300206	理邦仪器	19,600	235,592.00	0.16
211	003031	中瓷电子	4,400	234,124.00	0.16
212	600704	物产中大	44,400	233,988.00	0.16
213	688281	华秦科技	3,811	230,603.61	0.16
214	600362	江西铜业	9,800	229,614.00	0.16
215	688779	五矿新能	42,200	229,568.00	0.16
216	600906	财达证券	33,600	229,152.00	0.16
217	301376	致欧科技	12,500	228,125.00	0.16
218	300406	九强生物	16,100	227,815.00	0.16
219	002299	圣农发展	15,900	227,211.00	0.16
220	002950	奥美医疗	26,400	227,040.00	0.15
221	002714	牧原股份	5,400	226,854.00	0.15
222	600416	湘电股份	16,600	223,104.00	0.15
223	002493	荣盛石化	26,700	221,076.00	0.15
224	688122	西部超导	4,257	220,853.16	0.15
225	002831	裕同科技	9,400	220,148.00	0.15
226	000915	华特达因	6,200	219,170.00	0.15
227	601609	金田股份	31,200	218,712.00	0.15
228	688636	智明达	6,387	215,816.73	0.15
229	688041	海光信息	1,514	213,913.06	0.15
230	600007	中国国贸	10,300	211,974.00	0.14
231	605118	力鼎光电	8,400	208,572.00	0.14
232	600062	华润双鹤	11,100	207,126.00	0.14
233	000719	中原传媒	16,600	206,006.00	0.14
234	002913	奥士康	7,000	205,870.00	0.14
235	600928	西安银行	52,400	205,408.00	0.14

236	688213	思特威	2,000	204,440.00	0.14
237	600961	株冶集团	18,100	202,358.00	0.14
238	601019	山东出版	21,300	201,711.00	0.14
239	688617	惠泰医疗	670	198,990.00	0.14
240	002294	信立泰	4,200	198,786.00	0.14
241	000401	冀东水泥	45,200	197,976.00	0.14
242	601857	中国石油	23,100	197,505.00	0.13
243	603868	飞科电器	5,500	197,285.00	0.13
244	001322	箭牌家居	23,100	195,195.00	0.13
245	002867	周大生	14,800	195,064.00	0.13
246	600496	精工钢构	60,900	194,880.00	0.13
247	603933	睿能科技	11,300	194,586.00	0.13
248	603882	金域医学	6,800	194,208.00	0.13
249	300812	易天股份	8,400	194,124.00	0.13
250	002701	奥瑞金	32,600	193,970.00	0.13
251	601158	重庆水务	41,800	193,952.00	0.13
252	300533	冰川网络	5,800	193,778.00	0.13
253	603766	隆鑫通用	14,900	190,124.00	0.13
254	600744	华银电力	42,100	189,871.00	0.13
255	600988	赤峰黄金	7,600	189,088.00	0.13
256	300360	炬华科技	12,000	189,000.00	0.13
257	002170	芭田股份	18,400	188,600.00	0.13
258	600507	方大特钢	43,400	188,356.00	0.13
259	002508	老板电器	9,900	188,199.00	0.13
260	002661	克明食品	18,800	188,188.00	0.13
261	605599	菜百股份	11,500	188,025.00	0.13
262	601677	明泰铝业	15,100	187,542.00	0.13
263	002479	富春环保	37,300	186,873.00	0.13
264	600885	宏发股份	8,360	186,511.60	0.13
265	002852	道道全	19,500	186,420.00	0.13
266	002928	华夏航空	22,400	186,144.00	0.13

267	603160	汇顶科技	2,600	184,678.00	0.13
268	600757	长江传媒	19,900	184,672.00	0.13
269	002637	赞宇科技	18,500	184,630.00	0.13
270	002728	特一药业	21,900	184,179.00	0.13
271	601330	绿色动力	23,900	182,596.00	0.12
272	603893	瑞芯微	1,200	182,232.00	0.12
273	688079	美迪凯	18,121	181,934.84	0.12
274	000726	鲁泰A	28,600	181,324.00	0.12
275	603020	爱普股份	19,700	180,846.00	0.12
276	688403	汇成股份	17,400	180,786.00	0.12
277	301286	侨源股份	7,200	179,928.00	0.12
278	601236	红塔证券	21,200	179,564.00	0.12
279	301189	奥尼电子	6,800	178,908.00	0.12
280	002056	横店东磁	12,600	178,290.00	0.12
281	600488	津药药业	42,100	175,557.00	0.12
282	002690	美亚光电	10,400	175,448.00	0.12
283	300308	中际旭创	1,200	175,032.00	0.12
284	600036	招商银行	3,800	174,610.00	0.12
285	001965	招商公路	14,500	174,000.00	0.12
286	000538	云南白药	3,100	172,949.00	0.12
287	603916	苏博特	18,900	171,234.00	0.12
288	002399	海普瑞	14,300	170,313.00	0.12
289	601168	西部矿业	10,200	169,626.00	0.12
290	600688	上海石化	59,200	168,720.00	0.12
291	300383	光环新网	11,700	167,310.00	0.11
292	601869	长飞光纤	4,100	166,952.00	0.11
293	600801	华新水泥	14,100	166,944.00	0.11
294	002594	比亚迪	500	165,955.00	0.11
295	300676	华大基因	3,300	164,241.00	0.11
296	300001	特锐德	6,800	162,996.00	0.11
297	000423	东阿阿胶	3,100	162,130.00	0.11

298	600389	江山股份	8,700	161,820.00	0.11
299	002945	华林证券	11,200	160,944.00	0.11
300	600925	苏能股份	30,600	160,038.00	0.11
301	600707	彩虹股份	24,700	159,562.00	0.11
302	002926	华西证券	17,800	159,132.00	0.11
303	300212	易华录	7,300	158,848.00	0.11
304	000411	英特集团	14,800	158,656.00	0.11
305	301408	华人健康	10,400	158,184.00	0.11
306	688249	晶合集成	7,800	158,106.00	0.11
307	300869	康泰医学	11,000	157,740.00	0.11
308	600299	安迪苏	16,200	156,330.00	0.11
309	600352	浙江龙盛	15,300	155,448.00	0.11
310	000636	风华高科	11,300	155,262.00	0.11
311	000708	中信特钢	13,200	155,232.00	0.11
312	600392	盛和资源	11,700	154,089.00	0.11
313	600056	中国医药	14,900	154,066.00	0.11
314	000937	冀中能源	26,700	153,525.00	0.10
315	600909	华安证券	26,300	153,329.00	0.10
316	002608	江苏国信	20,900	153,197.00	0.10
317	601567	三星医疗	6,800	152,456.00	0.10
318	000725	京东方 A	37,900	151,221.00	0.10
319	601577	长沙银行	15,200	151,088.00	0.10
320	002531	天顺风能	21,100	150,654.00	0.10
321	600528	中铁工业	20,200	149,076.00	0.10
322	002215	诺 普 信	14,400	148,752.00	0.10
323	000426	兴业银锡	9,400	148,520.00	0.10
324	300978	东箭科技	13,300	148,428.00	0.10
325	600820	隧道股份	24,200	147,620.00	0.10
326	000898	鞍钢股份	62,700	145,464.00	0.10
327	601696	中银证券	13,600	145,384.00	0.10
328	603345	安井食品	1,800	144,756.00	0.10

329	600995	南网储能	14,800	144,744.00	0.10
330	002516	旷达科技	28,100	144,715.00	0.10
331	600582	天地科技	23,900	143,161.00	0.10
332	600285	羚锐制药	6,300	142,821.00	0.10
333	600900	长江电力	4,700	141,658.00	0.10
334	301129	瑞纳智能	5,200	141,232.00	0.10
335	600519	贵州茅台	100	140,952.00	0.10
336	600398	海澜之家	20,200	140,592.00	0.10
337	600325	华发股份	28,800	140,256.00	0.10
338	603737	三棵树	3,800	140,030.00	0.10
339	002985	北摩高科	4,600	139,150.00	0.09
340	600438	通威股份	8,300	139,025.00	0.09
341	301338	凯格精机	2,900	138,359.00	0.09
342	688586	江航装备	12,200	137,250.00	0.09
343	600595	中孚实业	31,200	136,656.00	0.09
344	688088	虹软科技	2,800	135,100.00	0.09
345	301330	熵基科技	4,980	134,609.40	0.09
346	300606	金太阳	6,800	134,096.00	0.09
347	300239	东宝生物	22,600	134,018.00	0.09
348	603707	健友股份	12,000	133,800.00	0.09
349	688599	天合光能	9,200	133,676.00	0.09
350	301499	维科精密	4,900	133,525.00	0.09
351	688311	盟升电子	3,081	132,637.05	0.09
352	605056	咸亨国际	8,600	132,440.00	0.09
353	605123	派克新材	1,700	132,430.00	0.09
354	600623	华谊集团	17,400	131,718.00	0.09
355	301268	铭利达	7,100	131,705.00	0.09
356	000537	中绿电	15,700	131,252.00	0.09
357	000686	东北证券	17,200	131,236.00	0.09
358	603167	渤海轮渡	11,500	131,100.00	0.09
359	300389	艾比森	11,300	130,854.00	0.09

360	603456	九洲药业	8,600	130,806.00	0.09
361	300105	龙源技术	16,900	130,299.00	0.09
362	000690	宝新能源	28,600	130,130.00	0.09
363	300455	航天智装	9,000	129,600.00	0.09
364	300359	全通教育	21,300	129,291.00	0.09
365	002346	柘中股份	9,500	129,200.00	0.09
366	301165	锐捷网络	2,100	129,066.00	0.09
367	688523	航天环宇	6,000	129,060.00	0.09
368	301215	中汽股份	20,800	128,960.00	0.09
369	002060	广东建工	37,000	128,760.00	0.09
370	600459	贵研铂业	8,300	128,733.00	0.09
371	688025	杰普特	1,800	128,700.00	0.09
372	688721	龙图光罩	2,850	128,535.00	0.09
373	600487	亨通光电	8,400	128,520.00	0.09
374	000983	山西焦煤	20,000	128,000.00	0.09
375	000429	粤高速 A	9,600	127,968.00	0.09
376	600718	东软集团	13,100	127,725.00	0.09
377	300214	日科化学	18,800	127,652.00	0.09
378	603701	德宏股份	7,300	127,604.00	0.09
379	000421	南京公用	19,400	127,458.00	0.09
380	688590	新致软件	6,200	127,348.00	0.09
381	688007	光峰科技	8,800	127,248.00	0.09
382	002722	物产金轮	7,900	127,111.00	0.09
383	600060	海信视像	5,500	126,610.00	0.09
384	603386	骏亚科技	10,000	126,500.00	0.09
385	300187	永清环保	24,800	126,480.00	0.09
386	300468	四方精创	2,500	126,225.00	0.09
387	688351	微电生理	6,400	126,080.00	0.09
388	002676	顺威股份	17,400	125,802.00	0.09
389	603217	元利科技	6,900	125,787.00	0.09
390	601083	锦江航运	11,300	125,543.00	0.09

391	601009	南京银行	10,800	125,496.00	0.09
392	000060	中金岭南	27,400	125,492.00	0.09
393	600176	中国巨石	11,000	125,400.00	0.09
394	603698	航天工程	7,100	125,102.00	0.09
395	002597	金禾实业	5,300	124,815.00	0.09
396	600482	中国动力	5,400	124,578.00	0.09
397	603237	五芳斋	7,400	123,654.00	0.08
398	002646	天佑德酒	13,300	123,424.00	0.08
399	000153	丰原药业	20,000	123,400.00	0.08
400	600613	神奇制药	19,100	123,386.00	0.08
401	000902	新洋丰	8,900	123,087.00	0.08
402	605077	华康股份	7,600	122,968.00	0.08
403	688289	圣湘生物	6,000	122,880.00	0.08
404	000626	远大控股	18,100	122,718.00	0.08
405	601066	中信建投	5,100	122,655.00	0.08
406	688568	中科星图	3,400	122,434.00	0.08
407	603486	科沃斯	2,100	122,283.00	0.08
408	600066	宇通客车	4,900	121,814.00	0.08
409	600486	扬农化工	2,100	121,800.00	0.08
410	603298	杭叉集团	5,800	121,510.00	0.08
411	301262	海看股份	4,600	121,256.00	0.08
412	002223	鱼跃医疗	3,400	121,040.00	0.08
413	601965	中国汽研	6,800	120,700.00	0.08
414	603288	海天味业	3,100	120,621.00	0.08
415	000034	神州数码	3,200	120,448.00	0.08
416	301456	盘古智能	4,900	119,854.00	0.08
417	300636	同和药业	15,600	119,808.00	0.08
418	603708	家家悦	11,600	118,320.00	0.08
418	301265	华新环保	11,600	118,320.00	0.08
419	002185	华天科技	11,700	118,170.00	0.08
420	000729	燕京啤酒	9,100	117,663.00	0.08

421	300143	盈康生命	12,200	117,486.00	0.08
422	688127	蓝特光学	4,520	116,209.20	0.08
423	000603	盛达资源	7,800	116,142.00	0.08
424	300492	华图山鼎	1,700	115,396.00	0.08
425	688278	特宝生物	1,600	115,376.00	0.08
426	601827	三峰环境	13,700	115,080.00	0.08
427	603235	天新药业	4,200	114,618.00	0.08
428	688108	赛诺医疗	10,200	114,444.00	0.08
429	000738	航发控制	5,500	114,125.00	0.08
430	603013	亚普股份	6,600	114,048.00	0.08
431	300442	润泽科技	2,300	113,919.00	0.08
432	601998	中信银行	13,400	113,900.00	0.08
433	300130	新国都	3,200	113,696.00	0.08
434	688578	艾力斯	1,221	113,601.84	0.08
435	002623	亚玛顿	7,000	113,050.00	0.08
436	300737	科顺股份	23,400	112,788.00	0.08
437	300760	迈瑞医疗	500	112,375.00	0.08
438	002352	顺丰控股	2,300	112,148.00	0.08
439	688111	金山办公	400	112,020.00	0.08
440	000878	云南铜业	8,800	111,936.00	0.08
441	301282	金禄电子	4,500	111,555.00	0.08
442	301137	哈焊华通	3,000	111,150.00	0.08
443	000001	平安银行	9,200	111,044.00	0.08
444	002475	立讯精密	3,200	111,008.00	0.08
445	600867	通化东宝	13,500	110,700.00	0.08
446	300358	楚天科技	14,000	109,200.00	0.07
447	601999	出版传媒	15,600	109,044.00	0.07
448	601601	中国太保	2,900	108,779.00	0.07
449	603628	清源股份	8,900	108,669.00	0.07
450	301386	未来电器	5,000	108,650.00	0.07
451	601106	中国一重	38,800	108,640.00	0.07

452	688029	南微医学	1,607	108,552.85	0.07
453	000831	中国稀土	3,000	108,360.00	0.07
454	603115	海星股份	7,500	108,225.00	0.07
455	600989	宝丰能源	6,700	108,138.00	0.07
456	301345	涛涛车业	1,000	108,100.00	0.07
457	688525	佰维存储	1,600	107,840.00	0.07
458	000848	承德露露	11,800	107,734.00	0.07
459	001358	兴欣新材	4,500	107,685.00	0.07
460	688819	天能股份	3,875	107,570.00	0.07
461	601099	太平洋	27,300	107,289.00	0.07
462	688475	萤石网络	3,400	107,168.00	0.07
463	603987	康德莱	13,900	107,030.00	0.07
464	603201	常润股份	5,800	107,010.00	0.07
465	603309	维力医疗	8,400	106,848.00	0.07
466	601231	环旭电子	7,300	106,799.00	0.07
467	002905	金逸影视	11,500	106,720.00	0.07
468	600508	上海能源	9,100	106,470.00	0.07
469	001378	德冠新材	4,800	106,416.00	0.07
470	300059	东方财富	4,600	106,398.00	0.07
471	603680	今创集团	9,300	106,299.00	0.07
472	688172	燕东微	5,400	106,164.00	0.07
473	002333	罗普斯金	19,300	106,150.00	0.07
474	600977	中国电影	9,900	106,128.00	0.07
475	688425	铁建重工	26,000	106,080.00	0.07
476	002381	双箭股份	15,700	105,975.00	0.07
477	603075	热威股份	5,300	105,947.00	0.07
478	002821	凯莱英	1,200	105,900.00	0.07
479	300037	新宙邦	3,000	105,600.00	0.07
480	302132	中航成飞	1,200	105,528.00	0.07
481	301267	华夏眼科	5,500	105,435.00	0.07
482	001229	魅视科技	3,200	105,344.00	0.07

483	603689	皖天然气	12,500	105,250.00	0.07
484	002261	拓维信息	3,400	105,230.00	0.07
485	603883	老百姓	5,000	105,050.00	0.07
486	300608	思特奇	9,000	104,760.00	0.07
487	600057	厦门象屿	14,900	104,747.00	0.07
488	601288	农业银行	17,800	104,664.00	0.07
489	601016	节能风电	36,200	104,618.00	0.07
490	000400	许继电气	4,800	104,496.00	0.07
491	600131	国网信通	5,900	104,430.00	0.07
492	600469	风神股份	18,400	103,960.00	0.07
493	002841	视源股份	3,000	103,800.00	0.07
494	603276	恒兴新材	6,300	103,446.00	0.07
495	600491	龙元建设	28,100	103,408.00	0.07
496	600848	上海临港	11,400	103,398.00	0.07
497	300796	贝斯美	10,000	103,100.00	0.07
498	002368	太极股份	4,400	103,048.00	0.07
499	688377	迪威尔	4,314	102,975.18	0.07
500	601966	玲珑轮胎	7,000	102,690.00	0.07
501	300255	常山药业	2,200	102,542.00	0.07
502	600521	华海药业	5,500	102,465.00	0.07
503	688580	伟思医疗	2,200	102,278.00	0.07
504	002171	楚江新材	10,500	102,165.00	0.07
505	603230	内蒙新华	7,900	101,989.00	0.07
506	688563	航材股份	1,800	101,934.00	0.07
507	601128	常熟银行	13,830	101,927.10	0.07
508	002410	广联达	7,600	101,916.00	0.07
509	300339	润和软件	2,000	101,660.00	0.07
510	300656	民德电子	3,800	101,574.00	0.07
511	688677	海泰新光	2,600	101,426.00	0.07
512	603986	兆易创新	800	101,224.00	0.07
513	000799	酒鬼酒	2,300	101,177.00	0.07

514	600754	锦江酒店	4,500	100,980.00	0.07
515	000513	丽珠集团	2,800	100,912.00	0.07
516	688778	厦钨新能	1,800	100,656.00	0.07
517	002788	鹭燕医药	11,700	100,269.00	0.07
518	002155	湖南黄金	5,600	99,960.00	0.07
519	601665	齐鲁银行	15,800	99,856.00	0.07
520	300802	矩子科技	5,300	99,852.00	0.07
521	601598	中国外运	20,200	99,586.00	0.07
522	603156	养元饮品	4,700	99,452.00	0.07
523	688099	晶晨股份	1,400	99,414.00	0.07
524	603083	剑桥科技	2,100	99,330.00	0.07
525	000750	国海证券	24,100	99,292.00	0.07
526	600369	西南证券	22,700	98,745.00	0.07
527	600535	天士力	6,300	98,595.00	0.07
528	301236	软通动力	1,800	98,352.00	0.07
529	002955	鸿合科技	4,000	98,280.00	0.07
530	000901	航天科技	7,900	98,197.00	0.07
531	688301	奕瑞科技	1,120	98,123.20	0.07
532	600642	申能股份	11,400	98,040.00	0.07
533	688696	极米科技	856	97,892.16	0.07
534	688049	炬芯科技	1,600	96,800.00	0.07
535	002019	亿帆医药	7,400	96,126.00	0.07
536	300770	新媒股份	2,400	95,976.00	0.07
537	300919	中伟股份	2,900	95,352.00	0.07
538	000932	华菱钢铁	21,600	95,040.00	0.06
539	002349	精华制药	13,100	94,189.00	0.06
540	001360	南矿集团	6,700	93,264.00	0.06
541	300443	金雷股份	4,100	92,660.00	0.06
542	600968	海油发展	22,700	92,616.00	0.06
543	688285	高铁电气	11,200	91,840.00	0.06
544	002585	双星新材	16,800	91,728.00	0.06

545	600166	福田汽车	33,800	91,598.00	0.06
546	688799	华纳药厂	2,200	90,860.00	0.06
547	000921	海信家电	3,500	89,950.00	0.06
548	601318	中国平安	1,600	88,768.00	0.06
549	605168	三人行	3,000	88,290.00	0.06
550	002683	广东宏大	2,600	88,244.00	0.06
551	603688	石英股份	2,500	88,050.00	0.06
552	603185	弘元绿能	5,900	87,615.00	0.06
553	601799	星宇股份	700	87,500.00	0.06
554	301606	绿联科技	1,700	87,431.00	0.06
555	300136	信维通信	3,900	87,360.00	0.06
556	300558	贝达药业	1,500	86,925.00	0.06
557	688065	凯赛生物	1,826	86,004.60	0.06
558	300496	中科创达	1,500	85,830.00	0.06
559	600765	中航重机	5,000	84,400.00	0.06
560	603816	顾家家居	3,300	84,216.00	0.06
561	600380	健康元	7,600	83,828.00	0.06
562	001227	兰州银行	33,300	83,250.00	0.06
563	601107	四川成渝	13,800	83,076.00	0.06
564	601600	中国铝业	11,700	82,368.00	0.06
565	600236	桂冠电力	13,100	82,137.00	0.06
566	601898	中煤能源	7,500	82,050.00	0.06
567	300033	同花顺	300	81,903.00	0.06
568	600637	东方明珠	10,800	80,676.00	0.06
569	601127	赛力斯	600	80,592.00	0.06
570	300118	东方日升	8,400	80,472.00	0.05
571	003012	东鹏控股	13,900	79,508.00	0.05
572	001872	招商港口	4,000	79,440.00	0.05
573	003037	三和管桩	11,000	78,980.00	0.05
574	300981	中红医疗	6,590	78,882.30	0.05
575	600378	昊华科技	2,900	78,503.00	0.05

576	603393	新天然气	2,700	78,165.00	0.05
577	600050	中国联通	14,600	77,964.00	0.05
578	002195	岩山科技	13,800	77,694.00	0.05
579	688772	珠海冠宇	5,400	77,166.00	0.05
580	600926	杭州银行	4,500	75,690.00	0.05
581	603095	越剑智能	4,600	75,578.00	0.05
582	300529	健帆生物	3,500	75,495.00	0.05
583	603719	良品铺子	6,200	75,330.00	0.05
584	603699	纽威股份	2,400	74,808.00	0.05
585	688297	中无人机	1,400	74,760.00	0.05
586	600298	安琪酵母	2,100	73,857.00	0.05
587	600038	中直股份	1,900	73,739.00	0.05
588	600153	建发股份	7,100	73,627.00	0.05
589	601179	中国西电	11,900	73,066.00	0.05
590	300474	景嘉微	1,000	73,000.00	0.05
591	603936	博敏电子	7,600	71,668.00	0.05
592	688598	金博股份	2,800	71,176.00	0.05
593	603228	景旺电子	1,700	71,128.00	0.05
594	000988	华工科技	1,500	70,515.00	0.05
595	600999	招商证券	4,000	70,360.00	0.05
596	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.05
597	603899	晨光股份	2,400	69,576.00	0.05
598	601366	利群股份	15,100	69,460.00	0.05
599	300219	鸿利智汇	10,200	68,544.00	0.05
600	688303	大全能源	3,200	68,224.00	0.05
601	301509	金凯生科	1,800	68,022.00	0.05
602	002933	新兴装备	1,900	67,868.00	0.05
603	301328	维峰电子	1,600	67,440.00	0.05
604	601515	东峰集团	17,600	67,232.00	0.05
605	688299	长阳科技	3,400	67,218.00	0.05
606	300288	朗玛信息	4,400	66,484.00	0.05

607	600177	雅戈尔	9,100	66,430.00	0.05
608	688686	奥普特	694	66,360.28	0.05
609	600183	生益科技	2,200	66,330.00	0.05
610	600958	东方证券	6,800	65,824.00	0.04
611	301230	泓博医药	1,900	65,398.00	0.04
612	300113	顺网科技	3,300	65,208.00	0.04
613	300702	天宇股份	2,800	65,128.00	0.04
614	300825	阿尔特	6,000	64,860.00	0.04
615	600755	厦门国贸	10,700	64,735.00	0.04
616	000751	锌业股份	20,600	64,684.00	0.04
617	300433	蓝思科技	2,900	64,670.00	0.04
618	603678	火炬电子	1,700	64,651.00	0.04
619	000338	潍柴动力	4,200	64,596.00	0.04
620	300772	运达股份	5,000	64,400.00	0.04
621	002010	传化智联	11,500	64,170.00	0.04
622	601061	中信金属	8,100	64,071.00	0.04
623	688202	美迪西	1,782	64,027.26	0.04
624	300347	泰格医药	1,200	63,984.00	0.04
625	002948	青岛银行	12,800	63,744.00	0.04
626	002818	富森美	5,100	63,648.00	0.04
627	000709	河钢股份	29,400	63,504.00	0.04
628	688630	芯碁微装	800	63,496.00	0.04
629	300973	立高食品	1,300	63,401.00	0.04
630	601808	中海油服	4,600	63,296.00	0.04
631	601939	建设银行	6,700	63,248.00	0.04
632	000792	盐湖股份	3,700	63,196.00	0.04
633	601162	天风证券	12,800	63,104.00	0.04
634	300982	苏文电能	3,500	62,965.00	0.04
635	002396	星网锐捷	2,800	62,860.00	0.04
636	002454	松芝股份	8,100	62,532.00	0.04
637	002249	大洋电机	9,500	62,510.00	0.04

638	300685	艾德生物	2,900	62,437.00	0.04
639	603659	璞泰来	3,300	61,974.00	0.04
640	300541	先进数通	3,800	61,750.00	0.04
641	601328	交通银行	7,700	61,600.00	0.04
642	300133	华策影视	8,200	61,582.00	0.04
643	688522	纳睿雷达	1,200	61,464.00	0.04
644	601766	中国中车	8,700	61,248.00	0.04
644	600155	华创云信	8,800	61,248.00	0.04
645	600104	上汽集团	3,800	60,990.00	0.04
646	601901	方正证券	7,700	60,907.00	0.04
647	301018	申菱环境	1,600	60,704.00	0.04
648	300047	天源迪科	3,800	60,610.00	0.04
649	600585	海螺水泥	2,800	60,116.00	0.04
650	601995	中金公司	1,700	60,112.00	0.04
651	688562	航天软件	3,200	59,968.00	0.04
652	000408	藏格矿业	1,400	59,738.00	0.04
653	301149	隆华新材	5,200	59,488.00	0.04
654	301151	冠龙节能	3,400	59,330.00	0.04
655	603373	安邦护卫	1,200	59,136.00	0.04
656	300986	志特新材	4,680	58,968.00	0.04
657	300708	聚灿光电	4,900	58,800.00	0.04
658	001223	欧克科技	1,300	58,422.00	0.04
659	603223	恒通股份	5,500	58,355.00	0.04
660	000933	神火股份	3,500	58,240.00	0.04
661	000655	金岭矿业	8,100	57,186.00	0.04
662	605228	神通科技	5,200	57,148.00	0.04
663	600660	福耀玻璃	1,000	57,010.00	0.04
664	600019	宝钢股份	8,600	56,674.00	0.04
665	600917	重庆燃气	9,900	56,628.00	0.04
666	300798	锦鸡股份	5,200	56,524.00	0.04
667	603187	海容冷链	4,800	56,448.00	0.04

668	300395	菲利华	1,100	56,210.00	0.04
669	300394	天孚通信	700	55,888.00	0.04
670	688685	迈信林	1,000	55,850.00	0.04
671	301296	新巨丰	5,800	55,738.00	0.04
672	603979	金诚信	1,200	55,728.00	0.04
673	688661	和林微纳	1,400	55,678.00	0.04
674	300127	银河磁体	1,900	55,081.00	0.04
675	688050	爱博医疗	800	55,080.00	0.04
676	002407	多氟多	4,500	54,855.00	0.04
677	603004	鼎龙科技	2,500	54,725.00	0.04
678	002409	雅克科技	1,000	54,690.00	0.04
679	600563	法拉电子	500	54,545.00	0.04
680	688147	微导纳米	1,800	54,324.00	0.04
681	688063	派能科技	1,200	54,096.00	0.04
682	301100	风光股份	3,100	54,002.00	0.04
683	600067	冠城新材	18,100	53,938.00	0.04
684	300864	南大环境	2,700	53,865.00	0.04
685	002797	第一创业	7,600	53,808.00	0.04
686	688582	芯动联科	800	53,760.00	0.04
686	688519	南亚新材	1,200	53,760.00	0.04
687	301106	骏成科技	1,800	53,640.00	0.04
688	002241	歌尔股份	2,300	53,636.00	0.04
689	300408	三环集团	1,600	53,440.00	0.04
690	301278	快可电子	1,600	53,328.00	0.04
691	600990	四创电子	1,900	53,276.00	0.04
692	000596	古井贡酒	400	53,260.00	0.04
693	300999	金龙鱼	1,800	53,154.00	0.04
694	600229	城市传媒	7,400	52,762.00	0.04
695	002340	格林美	8,300	52,705.00	0.04
696	301115	联检科技	3,400	52,666.00	0.04
697	301270	汉仪股份	1,100	52,426.00	0.04

698	603231	索宝蛋白	3,200	52,416.00	0.04
699	002130	沃尔核材	2,200	52,404.00	0.04
700	601156	东航物流	4,000	52,360.00	0.04
701	688206	概伦电子	1,800	52,344.00	0.04
702	600673	东阳光	4,500	52,335.00	0.04
703	600549	厦门钨业	2,500	52,300.00	0.04
704	603225	新凤鸣	4,900	52,185.00	0.04
705	688390	固德威	1,200	52,140.00	0.04
706	000514	渝开发	11,500	52,095.00	0.04
707	300314	戴维医疗	4,100	52,070.00	0.04
708	301191	菲菱科思	600	52,062.00	0.04
709	301321	翰博高新	3,400	51,986.00	0.04
710	601512	中新集团	7,100	51,972.00	0.04
711	300424	航新科技	3,000	51,960.00	0.04
712	000768	中航西飞	1,900	51,946.00	0.04
713	600008	首创环保	17,200	51,944.00	0.04
714	000598	兴蓉环境	7,200	51,912.00	0.04
715	600004	白云机场	5,700	51,870.00	0.04
716	605500	森林包装	7,000	51,730.00	0.04
717	000755	山西高速	10,600	51,622.00	0.04
718	601398	工商银行	6,800	51,612.00	0.04
719	600406	国电南瑞	2,300	51,543.00	0.04
720	603568	伟明环保	2,700	51,516.00	0.04
721	000800	一汽解放	7,500	51,450.00	0.04
722	300653	正海生物	2,500	51,250.00	0.03
723	300945	曼卡龙	2,300	51,037.00	0.03
724	603556	海兴电力	2,000	50,940.00	0.03
725	002120	韵达股份	7,600	50,920.00	0.03
726	002064	华峰化学	7,700	50,897.00	0.03
727	603833	欧派家居	900	50,805.00	0.03
728	002756	永兴材料	1,600	50,800.00	0.03

729	688005	容百科技	2,266	50,577.12	0.03
730	002958	青农商行	14,000	50,540.00	0.03
731	688361	中科飞测	600	50,514.00	0.03
732	605369	拱东医疗	2,660	50,513.40	0.03
733	600498	烽火通信	2,400	50,472.00	0.03
734	600126	杭钢股份	5,600	50,400.00	0.03
734	000739	普洛药业	3,600	50,400.00	0.03
735	000066	中国长城	3,400	50,320.00	0.03
736	603619	中曼石油	2,500	50,175.00	0.03
737	002050	三花智控	1,900	50,122.00	0.03
738	600594	益佰制药	13,000	50,050.00	0.03
739	688010	福光股份	1,600	49,664.00	0.03
740	600269	赣粤高速	9,800	49,588.00	0.03
741	600511	国药股份	1,700	49,572.00	0.03
742	300604	长川科技	1,100	49,401.00	0.03
743	600419	天润乳业	5,000	49,400.00	0.03
744	603856	东宏股份	4,300	49,235.00	0.03
745	002318	久立特材	2,100	49,119.00	0.03
746	603168	莎普爱思	6,600	48,774.00	0.03
747	603658	安图生物	1,300	48,750.00	0.03
748	600429	三元股份	10,800	48,708.00	0.03
749	300285	国瓷材料	2,800	48,580.00	0.03
750	300009	安科生物	5,800	48,546.00	0.03
751	603885	吉祥航空	3,600	48,492.00	0.03
752	688131	皓元医药	1,000	48,350.00	0.03
753	301486	致尚科技	700	48,349.00	0.03
754	300456	赛微电子	2,800	48,132.00	0.03
755	603097	江苏华辰	2,200	48,070.00	0.03
756	601518	吉林高速	17,500	47,950.00	0.03
757	300232	洲明科技	6,600	47,784.00	0.03
758	688362	甬矽电子	1,600	47,648.00	0.03

759	688153	唯捷创芯	1,514	46,949.14	0.03
760	600268	国电南自	6,000	46,920.00	0.03
761	601669	中国电建	9,600	46,752.00	0.03
762	600908	无锡银行	7,400	46,694.00	0.03
763	300765	新诺威	900	46,521.00	0.03
764	300510	金冠股份	10,100	46,258.00	0.03
765	002273	水晶光电	2,300	45,931.00	0.03
766	603365	水星家纺	2,500	45,900.00	0.03
767	300054	鼎龙股份	1,600	45,888.00	0.03
768	601918	新集能源	7,100	45,866.00	0.03
769	688629	华丰科技	800	45,760.00	0.03
770	600118	中国卫星	1,600	45,712.00	0.03
771	300679	电连技术	1,000	45,380.00	0.03
772	300832	新产业	800	45,376.00	0.03
773	002304	洋河股份	700	45,185.00	0.03
774	300581	晨曦航空	2,200	45,034.00	0.03
775	600188	兖矿能源	3,700	45,029.00	0.03
776	600941	中国移动	400	45,020.00	0.03
777	688777	中控技术	1,000	44,910.00	0.03
778	688595	芯海科技	1,200	44,868.00	0.03
779	002244	滨江集团	4,600	44,850.00	0.03
780	002572	索菲亚	3,200	44,832.00	0.03
781	300795	米奥会展	3,000	44,550.00	0.03
782	002371	北方华创	100	44,221.00	0.03
783	688347	华虹公司	800	43,928.00	0.03
784	300196	长海股份	3,600	43,920.00	0.03
785	300025	华星创业	6,300	43,722.00	0.03
786	600803	新奥股份	2,300	43,470.00	0.03
787	600383	金地集团	11,300	42,827.00	0.03
788	300595	欧普康视	2,800	42,756.00	0.03
789	000425	徐工机械	5,500	42,735.00	0.03

790	600845	宝信软件	1,800	42,516.00	0.03
791	603601	再升科技	10,400	42,224.00	0.03
792	301168	通灵股份	1,200	41,892.00	0.03
793	002330	得利斯	9,100	41,678.00	0.03
794	001387	雪祺电气	3,000	41,220.00	0.03
795	600764	中国海防	1,200	40,800.00	0.03
796	300855	图南股份	1,700	40,426.00	0.03
797	600580	卧龙电驱	2,040	40,330.80	0.03
798	002782	可立克	3,100	40,238.00	0.03
799	600196	复星医药	1,600	40,144.00	0.03
800	603712	七一二	1,900	39,919.00	0.03
801	688295	中复神鹰	1,910	39,728.00	0.03
802	300560	中富通	2,900	39,179.00	0.03
803	001216	华瓷股份	2,900	39,150.00	0.03
804	688114	华大智造	600	38,898.00	0.03
805	605589	圣泉集团	1,400	38,850.00	0.03
806	002054	德美化工	5,500	37,840.00	0.03
807	601825	沪农商行	3,900	37,830.00	0.03
808	301039	中集车辆	4,600	37,398.00	0.03
809	301088	戎美股份	2,700	37,125.00	0.03
810	300888	稳健医疗	900	36,990.00	0.03
811	000963	华东医药	900	36,324.00	0.02
812	603515	欧普照明	2,000	35,980.00	0.02
813	605399	晨光新材	2,800	35,784.00	0.02
814	301312	智立方	900	35,730.00	0.02
815	000717	中南股份	14,600	35,624.00	0.02
816	600809	山西汾酒	200	35,278.00	0.02
817	603267	鸿远电子	700	35,189.00	0.02
818	603535	嘉诚国际	3,300	35,112.00	0.02
819	601877	正泰电器	1,500	34,005.00	0.02
820	603989	艾华集团	2,200	33,880.00	0.02

821	600282	南钢股份	8,000	33,600.00	0.02
822	601108	财通证券	4,100	32,431.00	0.02
823	603153	上海建科	1,800	31,734.00	0.02
824	002412	汉森制药	5,100	31,722.00	0.02
825	300229	拓尔思	1,700	31,348.00	0.02
826	002372	伟星新材	3,000	31,080.00	0.02
827	600681	百川能源	8,800	30,888.00	0.02
828	600018	上港集团	5,400	30,834.00	0.02
829	002270	华明装备	1,800	30,132.00	0.02
830	002893	京能热力	2,800	29,932.00	0.02
831	605186	健麾信息	1,400	29,316.00	0.02
832	601668	中国建筑	5,000	28,850.00	0.02
833	688159	有方科技	400	28,668.00	0.02
834	600497	驰宏锌锗	5,400	28,566.00	0.02
835	603786	科博达	500	27,705.00	0.02
836	688195	腾景科技	600	27,000.00	0.02
837	600729	重庆百货	900	26,847.00	0.02
838	300251	光线传媒	1,300	26,351.00	0.02
839	301020	密封科技	1,200	26,196.00	0.02
840	301162	国能日新	500	25,840.00	0.02
841	688411	海博思创	301	25,130.49	0.02
842	301090	华润材料	3,300	24,849.00	0.02
843	688691	灿芯股份	400	24,744.00	0.02
844	603396	金辰股份	900	22,950.00	0.02
845	002331	皖通科技	2,800	22,540.00	0.02
846	002138	顺络电子	800	22,496.00	0.02
847	300677	英科医疗	900	21,312.00	0.01
848	000027	深圳能源	3,300	21,054.00	0.01
849	601988	中国银行	3,700	20,794.00	0.01
850	601233	桐昆股份	1,900	20,140.00	0.01
851	601198	东兴证券	1,800	20,070.00	0.01

852	002367	康力电梯	2,800	19,684.00	0.01
853	300725	药石科技	500	19,350.00	0.01
854	000887	中鼎股份	1,100	19,349.00	0.01
855	600829	人民同泰	2,500	18,350.00	0.01
856	688239	航宇科技	520	18,189.60	0.01
857	003005	竞业达	900	18,189.00	0.01
858	300475	香农芯创	500	17,815.00	0.01
859	600897	厦门空港	1,200	17,508.00	0.01
860	688429	时创能源	1,200	17,448.00	0.01
861	601881	中国银河	1,000	17,150.00	0.01
862	002918	蒙娜丽莎	2,000	16,600.00	0.01
863	688008	澜起科技	200	16,400.00	0.01
864	601579	会稽山	800	15,928.00	0.01
865	301458	钧崴电子	456	15,554.16	0.01
866	301602	超研股份	611	15,152.80	0.01
867	688583	思看科技	177	14,103.36	0.01
868	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
869	301535	浙江华远	696	13,217.04	0.01
870	688545	兴福电子	477	12,855.15	0.01
871	001388	信通电子	760	12,479.20	0.01
872	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
873	301678	新恒汇	238	10,600.52	0.01
874	301479	弘景光电	116	9,032.92	0.01
875	301275	汉朔科技	127	7,136.13	0.00
876	603072	天和磁材	123	6,697.35	0.00
877	688755	汉邦科技	169	6,646.77	0.00
878	002487	大金重工	200	6,580.00	0.00
879	001356	富岭股份	412	5,949.28	0.00
880	301173	毓恬冠佳	130	5,847.40	0.00
881	001382	新亚电缆	288	5,820.48	0.00
882	301176	逸豪新材	200	5,350.00	0.00

883	301501	恒鑫生活	116	5,245.52	0.00
884	002976	瑞玛精密	200	5,200.00	0.00
885	301595	太力科技	152	4,423.20	0.00
886	300988	津荣天宇	200	4,266.00	0.00
887	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
888	301329	信音电子	200	3,896.00	0.00
889	301636	泽润新能	80	3,796.80	0.00
890	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
891	002915	中欣氟材	200	3,576.00	0.00
892	301529	福赛科技	100	3,133.00	0.00
893	600435	北方导航	200	3,118.00	0.00
894	600216	浙江医药	200	2,958.00	0.00
895	001390	古麒绒材	142	2,573.04	0.00
896	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
897	002810	山东赫达	200	2,390.00	0.00
898	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
899	603630	拉芳家化	100	2,242.00	0.00
900	603271	永杰新材	59	2,069.72	0.00
901	603135	中重科技	200	1,984.00	0.00
902	603257	中国瑞林	51	1,910.97	0.00
903	603409	汇通控股	54	1,799.28	0.00
904	605158	华达新材	200	1,664.00	0.00
905	600489	中金黄金	100	1,463.00	0.00
906	603367	辰欣药业	100	1,402.00	0.00
907	002152	广电运通	100	1,344.00	0.00
908	601886	江河集团	200	1,230.00	0.00
909	000789	万年青	200	1,092.00	0.00
910	603527	众源新材	100	1,087.00	0.00
911	600095	湘财股份	100	1,003.00	0.00
912	002263	大东南	200	826.00	0.00
913	000672	上峰水泥	100	790.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	1,318,254.00	0.90
2	300803	指南针	1,227,727.00	0.84
3	601857	中国石油	1,166,689.00	0.79
4	002414	高德红外	1,091,378.80	0.74
5	000776	广发证券	1,080,587.00	0.74
6	002206	海利得	1,080,061.00	0.74
7	605499	东鹏饮料	1,077,139.00	0.73
8	002648	卫星化学	1,076,215.46	0.73
9	000959	首钢股份	1,049,617.00	0.72
10	300641	正丹股份	1,036,831.00	0.71
11	600988	赤峰黄金	1,030,916.00	0.70
12	601098	中南传媒	1,006,564.00	0.69
13	688183	生益电子	1,005,013.98	0.68
14	603993	洛阳钼业	1,003,047.00	0.68
15	002128	电投能源	990,794.00	0.67
16	300001	特锐德	973,737.00	0.66
17	002311	海大集团	969,312.00	0.66
18	000333	美的集团	965,519.00	0.66
19	600998	九州通	960,809.00	0.65
20	300017	网宿科技	957,042.00	0.65

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比
----	------	------	----------	------------

				例(%)
1	002273	水晶光电	1,196,254.00	0.81
2	300476	胜宏科技	1,165,130.00	0.79
3	601857	中国石油	1,141,532.00	0.78
4	600988	赤峰黄金	1,140,537.00	0.78
5	002926	华西证券	1,129,172.00	0.77
6	603893	瑞芯微	1,128,755.00	0.77
7	603501	豪威集团	1,120,042.00	0.76
8	300641	正丹股份	1,116,834.00	0.76
9	600968	海油发展	1,104,697.00	0.75
10	300433	蓝思科技	1,104,361.00	0.75
11	688772	珠海冠宇	1,099,859.43	0.75
12	000725	京东方 A	1,089,232.00	0.74
13	300502	新易盛	1,079,963.00	0.74
14	002414	高德红外	1,046,620.00	0.71
15	603707	健友股份	1,041,370.00	0.71
16	600729	重庆百货	1,039,169.00	0.71
17	688183	生益电子	1,034,489.31	0.70
18	002128	电投能源	1,033,540.00	0.70
19	000776	广发证券	1,028,658.00	0.70
20	300002	神州泰岳	1,012,843.00	0.69

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	508,494,847.47
卖出股票收入（成交）总额	525,634,347.26

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	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)	22,801.07	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	22,801.07	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113695	华辰转债	120	12,000.58	0.01
2	123257	安克转债	58	5,800.38	0.00
3	118057	甬矽转债	50	5,000.11	0.00

注:本基金本报告期末仅持有三只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,627,632.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,627,632.47

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
泓德 智选 启元 混合A	1,019	103,283.48	33,926,015.89	32.24%	71,319,853.31	67.76%
泓德 智选 启元 混合C	957	24,231.77	314,216.37	1.35%	22,875,587.18	98.65%
合计	1,957	65,628.86	34,240,232.26	26.66%	94,195,440.49	73.34%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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	泓德智选启元混合A	220,339.98	0.21%
	泓德智选启元混合C	6,209.83	0.03%
	合计	226,549.81	0.18%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	泓德智选启元混合A	10~50
	泓德智选启元混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德智选启元混合A	0
	泓德智选启元混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C
基金合同生效日(2023年11月21日)基金份额总额	42,080,923.58	224,380,465.76
本报告期期初基金份额总额	110,664,572.14	33,490,932.59
本报告期基金总申购份额	109,144,524.64	14,786,791.49
减：本报告期基金总赎回份额	114,563,227.58	25,087,920.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	105,245,869.20	23,189,803.55

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 基金管理人的重大人事变动

2025年3月27日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，王德晓担任公司首席信息官（兼），童良发离任公司副总经理兼首席信息官。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,不存在基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司及其高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	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	佣金	占当期佣金总量的比	

	数量		的比例		例	
中银国际证券	3	833,613,583.94	80.67%	363,371.19	80.67%	-
华泰证券	3	100,618,908.16	9.74%	43,859.88	9.74%	-
开源证券	3	99,111,449.83	9.59%	43,203.38	9.59%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择华泰证券、开源证券、中银国际证券作为证券经纪商。

2、本基金采用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位有关问题的通知》中关于交易佣金分仓的规定。

3、基金专用交易单元的选择标准如下：

- （1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；
- （2）财务状况良好，公司经营状况稳定；
- （3）具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。

4、基金专用交易单元的选择程序如下：

- （1）本基金管理人根据上述标准考察后选定证券经营机构；
- （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中银国际证券	68,339.91	74.76%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	12,895.86	14.11%	-	-	-	-	-	-
开源证券	10,177.66	11.13%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-03
2	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
3	泓德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-09
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华西证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-25
6	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-24
7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2025/05/15-2025/06/30	-	28,244,986.	-	28,244,986.	21.99%

				35		35	
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，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德智选启元混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德智选启元混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德智选启元混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日