

泓德泓信灵活配置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:中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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	6
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
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	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
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	77
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	78
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	78
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	78
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	80
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	80
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	85
§11 影响投资者决策的其他重要信息	85
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	85
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§12 备查文件目录	85
12.1 备查文件目录	86
12.2 存放地点	86
12.3 查阅方式	86

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓信混合
基金主代码	002801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月01日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	91,658,707.04份
基金合同存续期	不定期

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，通过股票与债券等资产的合理配置，力争为投资者带来稳健的投资回报。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，从宏观经济环境、国家政策导向、产业转型与变革等多个角度，积极挖掘新经济环境下的投资机遇，精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。对于债券投资策略，本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。同时，本基金将本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
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，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	郭明
	联系电话	010-59850151	010-66105799
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59850195	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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)
本期已实现收益	11,144,459.69
本期利润	16,275,721.15
加权平均基金份额本期利润	0.1651
本期加权平均净值利润率	11.00%
本期基金份额净值增长率	11.05%
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	56,520,543.82
期末可供分配基金份额利润	0.6166
期末基金资产净值	148,179,250.86
期末基金份额净值	1.6166
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	101.19%

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

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	5.85%	0.67%	3.91%	0.71%	1.94%	-0.04%

过去三个月	6.58%	1.45%	1.06%	1.34%	5.52%	0.11%
过去六个月	11.05%	1.24%	3.07%	1.22%	7.98%	0.02%
过去一年	30.56%	1.57%	18.22%	1.55%	12.34%	0.02%
过去三年	-3.42%	1.26%	-1.38%	1.11%	-2.04%	0.15%
自基金合同生效起至今	101.19%	1.18%	35.61%	0.80%	65.58%	0.38%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

根据《泓德基金管理有限公司关于修改泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准的公告》，本基金自2023年12月22日起变更业绩比较基准。原业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%＋中证综合债券指数收益率×50%。变更后的业绩比较基准为：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指数由中证指数有限公司编制并发布。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场中中小市值公司的整体状况。
- （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- 10-26	-	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。

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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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

截至报告期末泓德泓信混合基金份额净值为1.6166元，本报告期内，基金份额净值增长率为11.05%，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56,520,543.82元,其中:未分配利润已实现部分为63,179,580.11元,未分配利润未实现部分为-6,659,036.29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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--泓德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害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

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2025年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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：泓德泓信灵活配置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	11,416,110.23	12,161,440.18
结算备付金		504,549.48	1,850,404.61
存出保证金		26,154.90	68,150.74
交易性金融资产	6.4.7.2	136,584,101.31	154,847,436.15
其中：股票投资		136,571,300.85	144,593,345.28
基金投资		-	-
债券投资		12,800.46	10,254,090.87
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		123,493.33	1,159,716.59
应收股利		-	-
应收申购款		8,150.10	41,452.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		148,662,559.35	170,128,600.52
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		218,191.20	10,590,972.67
应付管理人报酬		94,709.75	122,537.40
应付托管费		17,758.10	22,975.76
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	152,649.44	205,392.04
负债合计		483,308.49	10,941,878.22
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	91,658,707.04	109,344,442.46
未分配利润	6.4.7.8	56,520,543.82	49,842,279.84
净资产合计		148,179,250.86	159,186,722.30

负债和净资产总计		148,662,559.35	170,128,600.52
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额净值1.6166元，基金份额总额91,658,707.04份。

6.2 利润表

会计主体：泓德泓信灵活配置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		17,073,826.85	-36,911,903.88
1.利息收入		18,294.71	80,281.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,294.71	80,281.34
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）		11,869,948.89	-21,420,889.25
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,305,869.46	-25,121,723.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	8,316.11	176,377.21
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	-	-381,897.52
股利收益	6.4.7.13	1,555,763.32	3,906,354.45
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失	6.4.7.14	5,131,261.46	-16,409,169.44

以“-”号填列)			
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	54,321.79	837,873.47
减：二、营业总支出		798,105.70	1,966,578.30
1.管理人报酬		587,851.65	1,560,961.02
2.托管费		110,222.19	292,680.14
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	1.53
8.其他费用	6.4.7.16	100,031.86	112,935.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列)		16,275,721.15	-38,878,482.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列)		16,275,721.15	-38,878,482.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,275,721.15	-38,878,482.18

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德泓信灵活配置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	109,344,442.46	49,842,279.84	159,186,722.30
二、本期期初净资产	109,344,442.46	49,842,279.84	159,186,722.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,685,735.42	6,678,263.98	-11,007,471.44
（一）、综合收益总额	-	16,275,721.15	16,275,721.15
（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）	-17,685,735.42	-9,597,457.17	-27,283,192.59
其中：1.基金申购款	10,435,889.16	5,341,626.59	15,777,515.75
2.基金赎回款	-28,121,624.58	-14,939,083.76	-43,060,708.34
（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	91,658,707.04	56,520,543.82	148,179,250.86
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	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15
二、本期期初净资产	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-61,915,424.31	-52,587,592.12	-114,503,016.43

填列)			
(一)、综合收益总额	-	-38,878,482.18	-38,878,482.18
(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)	-61,915,424.31	-13,709,109.94	-75,624,534.25
其中: 1.基金申购款	168,476,164.06	51,652,380.55	220,128,544.61
2.基金赎回款	-230,391,588.37	-65,361,490.49	-295,753,078.86
(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	242,720,079.44	57,810,144.28	300,530,223.72

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

泓德泓信灵活配置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[2016]967号《关于准予泓德泓信灵活配置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《泓德泓信灵活配置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，自基金合同生效之日起至18个月后对应日的前一个工作日（含该日）止的期间内采用封闭式运作方式，如不存在该对应日的，顺延至下一工作日，封闭期结束后转为开放式运作，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集847,529,845.47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

(2016)第699号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月1日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为847,544,853.76份,其中认购资金利息折合15,008.29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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等权益类品种,国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、中期票据、债券回购和银行存款、同业存单等固定收益类投资工具,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。本基金的投资组合比例为:封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为0%-100%;转为开放式运作后股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%。本基金如果投资股指期货、国债期货,则在封闭期内,每个交易日日终扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于交易保证金一倍的现金;转为开放式运作后,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于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 $\times 90\%$ +中国债券综合全价指数收益率 $\times 10\%$ 。

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》、《泓德泓信灵活配置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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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	11,416,110.23
等于：本金	11,415,172.04
加：应计利息	938.19
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	11,416,110.23

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		131,510,963.99	-	136,571,300.85	5,060,336.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,800.00	0.46	12,800.46	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,800.00	0.46	12,800.46	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		131,523,763.99	0.46	136,584,101.31	5,060,336.86

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	662.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	72,644.19
其中：交易所市场	72,644.19
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	152,649.44

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	109,344,442.46	109,344,442.46
本期申购	10,435,889.16	10,435,889.16
本期赎回（以“-”号填列）	-28,121,624.58	-28,121,624.58
本期末	91,658,707.04	91,658,707.04

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

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,940,219.89	-13,097,940.05	49,842,279.84
本期期初	62,940,219.89	-13,097,940.05	49,842,279.84
本期利润	11,144,459.69	5,131,261.46	16,275,721.15
本期基金份额交易产生的变动数	-10,905,099.47	1,307,642.30	-9,597,457.17
其中：基金申购款	6,592,100.17	-1,250,473.58	5,341,626.59
基金赎回款	-17,497,199.64	2,558,115.88	-14,939,083.76
本期已分配利润	-	-	-

本期末	63,179,580.11	-6,659,036.29	56,520,543.82
-----	---------------	---------------	---------------

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	14,521.32
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,560.79
其他	212.60
合计	18,294.71

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	418,898,761.76
减：卖出股票成本总额	408,180,159.32
减：交易费用	412,732.98
买卖股票差价收入	10,305,869.46

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	47,962.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-39,646.11
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	8,316.11
----	----------

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	10,378,211.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,156,800.00
减：应计利息总额	261,052.65
减：交易费用	4.68
买卖债券差价收入	-39,646.11

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	1,555,763.32
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	1,555,763.32

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	5,131,261.46
——股票投资	5,091,661.46
——债券投资	39,600.00
——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	5,131,261.46

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	27,663.80
基金转换费收入	26,657.99
合计	54,321.79

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	-
汇划手续费	2,088.70
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	100,031.86

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
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
泓德基业(西藏)企业管理有限公司	基金管理人股东

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

无。

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 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	587,851.65	1,560,961.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	25,152.46	14,951.56
应支付基金管理人的净管理费	562,699.19	1,546,009.46

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0.80%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×0.80%/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	110,222.19	292,680.14

注：支付基金托管人中国工商银行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。

6.4.10.3 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

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	-	35,353,087.68
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	8,700,000.00

报告期末持有的基金份额	-	26,653,087.68
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	10.98%

注：1、赎回/卖出总份额含转换（出）份额、强制调减份额。
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

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	356,488.47	0.39%	356,488.47	0.33%
泓德基业(西藏)企业管理有限公司	0.00	0.00%	6,524,368.76	5.97%

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
中国工商银行	11,416,110.23	14,521.32	10,852,824.17	43,430.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，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

无。

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	314	6,085.32	26,215.86	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6个月以上	限售股	10.40	34.11	564	5,865.60	19,238.04	-
688583	思看科技	2025-01-08	6个月以上	限售股	33.46	79.68	204	5,253.22	16,254.72	备注2（1）
301602	超研股份	2025-01-15	6个月以上	限售股	6.70	24.80	643	4,308.10	15,946.40	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6个月以上	限售股	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
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	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6个月以	限售股	11.68	26.95	506	5,910.08	13,636.70	-

			上							
001388	信通电子	2025-06-24	5个交易日	新股未上市	16.42	16.42	730	11,986.60	11,986.60	-
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	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6个月以上	限售股	41.90	77.87	132	3,938.60	10,278.84	备注2 (2)
301662	宏工科技	2025-04-10	6个月以上	限售股	26.60	82.50	120	3,192.00	9,900.00	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6个月以上	限售股	12.80	44.54	218	2,790.40	9,709.72	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月以上	限售股	12.30	54.45	154	1,894.20	8,385.30	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6个月以上	限售股	27.50	56.19	147	4,042.50	8,259.93	-
301658	首航新能	2025-03-26	6个月以上	限售股	11.80	22.98	341	4,023.80	7,836.18	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6个月以上	限售股	10.27	22.39	331	3,399.37	7,411.09	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6个月以上	限售股	22.77	39.33	183	4,166.91	7,197.39	-
001382	新亚电缆	2025-03-1	6个月以	限售股	7.40	20.21	350	2,590.00	7,073.50	-

		3	上							
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6个月以上	限售股	28.33	44.98	147	4,164.51	6,612.06	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6个月以上	限售股	39.92	45.22	141	3,872.24	6,376.02	备注2 (3)
001356	富岭股份	2025-01-16	6个月以上	限售股	5.30	14.44	437	2,316.10	6,310.28	-
301595	太力科技	2025-05-12	6个月以上	限售股	17.05	29.10	166	2,830.30	4,830.60	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6个月以上	限售股	16.50	27.45	159	2,623.50	4,364.55	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6个月以上	限售股	33.06	47.46	87	2,876.22	4,129.02	-
603124	江南新材	2025-03-12	6个月以上	限售股	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
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	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6个月以上	限售股	8.60	15.61	210	1,806.00	3,278.10	-
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	-
603271	永杰新材	2025-03-0	6个月以	限售股	20.60	35.08	69	1,421.40	2,420.52	-

		4	上							
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	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6个月以上	限售股	12.08	18.12	125	1,510.00	2,265.00	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6个月以上	限售股	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6个月以上	限售股	20.52	37.47	58	1,190.16	2,173.26	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6个月以上	限售股	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6个月以上	限售股	24.18	33.32	62	1,499.16	2,065.84	-
603202	天有为	2025-04-16	6个月以上	限售股	93.50	90.66	21	1,963.50	1,903.86	-
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	82	1,346.44	1,346.44	-
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
118057	甬矽转债	2025-06-27	13个交易日	新债未上市	100.00	100.00	70	7,000.00	7,000.15	-

113695	华辰转债	2025-06-23	13个交易日	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.19	-
123257	安克转债	2025-06-16	14个交易日	新债未上市	100.00	100.01	18	1,800.00	1,800.12	-

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	5,800	126,088.24	220,690.00	-

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0.01%(上年度末：0.01%)。

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	11,416,110.23	-	-	-	11,416,110.23
结算备付金	504,549.48	-	-	-	504,549.48
存出保证金	26,154.90	-	-	-	26,154.90
交易性金融资产	-	-	12,800.46	136,571,300.85	136,584,101.31
应收清算款	-	-	-	123,493.33	123,493.33
应收申购款	-	-	-	8,150.10	8,150.10
资产总计	11,946,814.61	-	12,800.46	136,702,944.28	148,662,559.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	218,191.20	218,191.20
应付管理人报酬	-	-	-	94,709.75	94,709.75
应付托管费	-	-	-	17,758.10	17,758.10
其他负债	-	-	-	152,649.44	152,649.44
负债总计	-	-	-	483,308.49	483,308.49
利率敏感度缺口	11,946,814.61	-	12,800.46	136,219,635.79	148,179,250.86
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	12,161,440.18	-	-	-	12,161,440.18
结算备付金	1,850,404.61	-	-	-	1,850,404.61
存出保证金	68,150.74	-	-	-	68,150.74
交易性金融资产	10,239,090.41	-	15,000.46	144,593,345.28	154,847,436.15
应收清算款	-	-	-	1,159,716.59	1,159,716.59
应收申购款	-	-	-	41,452.25	41,452.25

资产总计	24,319,085.94	-	15,000.46	145,794,514.12	170,128,600.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,590,972.67	10,590,972.67
应付管理人报酬	-	-	-	122,537.40	122,537.40
应付托管费	-	-	-	22,975.76	22,975.76
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	205,392.04	205,392.04
负债总计	-	-	-	10,941,878.22	10,941,878.22
利率敏感度缺口	24,319,085.94	-	15,000.46	134,852,635.90	159,186,722.30

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0.01%(上年度末：6.44%)，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	136,571,300.85	92.17	144,593,345.28	90.83
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	136,571,300.85	92.17	144,593,345.28	90.83

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%	7,431,259.25	7,644,505.31
	业绩比较基准下降5%	-7,431,259.25	-7,644,505.31

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	136,066,665.48	144,077,246.51
第二层次	246,823.50	10,371,138.77
第三层次	270,612.33	399,050.87
合计	136,584,101.31	154,847,436.15

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	136,571,300.85	91.87
	其中：股票	136,571,300.85	91.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,800.46	0.01
	其中：债券	12,800.46	0.01
	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	11,920,659.71	8.02
8	其他各项资产	157,798.33	0.11
9	合计	148,662,559.35	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	652,819.00	0.44
B	采矿业	4,882,152.00	3.29
C	制造业	84,695,049.50	57.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,928,665.00	2.65
E	建筑业	743,687.00	0.50
F	批发和零售业	4,568,239.50	3.08
G	交通运输、仓储和邮政业	3,024,815.00	2.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,918,362.20	6.69
J	金融业	14,856,382.30	10.03
K	房地产业	2,011,102.00	1.36
L	租赁和商务服务业	1,082,622.20	0.73
M	科学研究和技术服务业	1,252,440.15	0.85

N	水利、环境和公共设施管理业	1,245,717.00	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	75,503.00	0.05
Q	卫生和社会工作	530,911.00	0.36
R	文化、体育和娱乐业	3,026,076.00	2.04
S	综合	76,758.00	0.05
	合计	136,571,300.85	92.17

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	600030	中信证券	29,000	800,980.00	0.54
2	601319	中国人保	75,100	654,121.00	0.44
3	300803	指南针	7,750	625,115.00	0.42
4	002532	天山铝业	73,600	611,616.00	0.41
5	300502	新易盛	4,720	599,534.40	0.40
6	002414	高德红外	57,882	593,290.50	0.40
7	000050	深天马 A	67,900	578,508.00	0.39
8	002080	中材科技	28,400	553,800.00	0.37
9	002625	光启技术	13,800	551,724.00	0.37
10	600739	辽宁成大	50,100	551,100.00	0.37
11	300476	胜宏科技	4,000	537,520.00	0.36
12	601568	北元集团	127,500	529,125.00	0.36
13	000623	吉林敖东	30,700	520,365.00	0.35
14	600998	九州通	101,168	520,003.52	0.35
15	300140	节能环保	79,900	492,983.00	0.33
16	600956	新天绿能	63,800	492,536.00	0.33
17	000553	安道麦A	67,600	488,072.00	0.33
18	603858	步长制药	29,900	485,576.00	0.33

19	603993	洛阳钼业	56,100	472,362.00	0.32
20	601688	华泰证券	26,500	471,965.00	0.32
21	000783	长江证券	67,900	470,547.00	0.32
22	300447	全信股份	28,900	452,863.00	0.31
23	002463	沪电股份	10,600	451,348.00	0.30
24	600350	山东高速	42,300	450,918.00	0.30
25	000893	亚钾国际	14,800	446,072.00	0.30
26	600685	中船防务	16,300	443,197.00	0.30
27	601919	中远海控	28,800	433,152.00	0.29
28	300017	网宿科技	40,300	432,016.00	0.29
29	600517	国网英大	84,100	428,910.00	0.29
30	601098	中南传媒	32,600	427,712.00	0.29
31	600663	陆家嘴	47,100	417,306.00	0.28
32	601555	东吴证券	46,900	410,375.00	0.28
33	688055	龙腾光电	108,758	402,404.60	0.27
34	601928	凤凰传媒	35,900	401,003.00	0.27
35	002624	完美世界	26,400	400,488.00	0.27
36	600096	云天化	18,100	397,657.00	0.27
37	300972	万辰集团	2,200	396,528.00	0.27
38	600760	中航沈飞	6,700	392,754.00	0.27
39	603379	三美股份	8,100	389,772.00	0.26
40	605058	澳弘电子	12,700	388,112.00	0.26
41	600295	鄂尔多斯	44,500	387,595.00	0.26
42	601336	新华保险	6,600	386,100.00	0.26
43	300777	中简科技	10,600	384,250.00	0.26
44	603676	卫信康	37,900	383,927.00	0.26
45	600925	苏能股份	73,200	382,836.00	0.26
46	688208	道通科技	12,484	382,010.40	0.26
47	600219	南山铝业	99,100	379,553.00	0.26
48	600655	豫园股份	68,300	379,065.00	0.26
49	605499	东鹏饮料	1,200	376,860.00	0.25

50	601788	光大证券	20,800	373,984.00	0.25
51	601717	中创智领	22,500	373,950.00	0.25
52	002203	海亮股份	35,900	370,488.00	0.25
53	600909	华安证券	63,300	369,039.00	0.25
54	603087	甘李药业	6,700	367,026.00	0.25
55	600873	梅花生物	34,300	366,667.00	0.25
56	603132	金徽股份	27,400	363,598.00	0.25
57	688668	鼎通科技	5,800	362,268.00	0.24
58	601963	重庆银行	33,300	361,638.00	0.24
59	600007	中国国贸	17,500	360,150.00	0.24
60	300274	阳光电源	5,300	359,181.00	0.24
61	688188	柏楚电子	2,722	358,378.52	0.24
62	603259	药明康德	5,100	354,705.00	0.24
63	600271	航天信息	37,800	349,272.00	0.24
64	300373	扬杰科技	6,700	347,730.00	0.23
65	002500	山西证券	59,500	347,480.00	0.23
66	600299	安迪苏	35,900	346,435.00	0.23
67	601377	兴业证券	55,400	342,926.00	0.23
68	000651	格力电器	7,500	336,900.00	0.23
69	002563	森马服饰	63,700	335,062.00	0.23
70	603444	吉比特	1,100	332,145.00	0.22
71	603228	景旺电子	7,900	330,536.00	0.22
72	603633	徕木股份	38,000	330,220.00	0.22
73	300559	佳发教育	27,700	326,860.00	0.22
74	603113	金能科技	47,100	326,403.00	0.22
75	688588	凌志软件	22,400	326,368.00	0.22
76	600578	京能电力	72,600	325,974.00	0.22
77	600801	华新水泥	27,500	325,600.00	0.22
78	002926	华西证券	36,200	323,628.00	0.22
79	600867	通化东宝	38,600	316,520.00	0.21
80	002266	浙富控股	102,400	315,392.00	0.21

81	002945	华林证券	21,700	311,829.00	0.21
82	601991	大唐发电	98,100	310,977.00	0.21
83	601318	中国平安	5,600	310,688.00	0.21
84	001203	大中矿业	32,800	309,960.00	0.21
85	600961	株冶集团	27,700	309,686.00	0.21
86	600418	江淮汽车	7,700	308,693.00	0.21
87	688183	生益电子	6,000	307,200.00	0.21
88	002373	千方科技	32,700	304,110.00	0.21
89	603799	华友钴业	8,200	303,564.00	0.20
90	002202	金风科技	29,600	303,400.00	0.20
91	300750	宁德时代	1,200	302,664.00	0.20
92	601677	明泰铝业	24,200	300,564.00	0.20
93	605218	伟时电子	13,400	299,892.00	0.20
94	601456	国联民生	28,900	299,115.00	0.20
95	601678	滨化股份	72,200	298,908.00	0.20
96	601899	紫金矿业	15,300	298,350.00	0.20
97	000733	振华科技	5,900	295,295.00	0.20
98	301318	维海德	8,700	294,408.00	0.20
99	601158	重庆水务	63,300	293,712.00	0.20
100	600062	华润双鹤	15,700	292,962.00	0.20
101	000100	TCL科技	67,300	291,409.00	0.20
102	600887	伊利股份	10,400	289,952.00	0.20
103	002673	西部证券	36,500	287,620.00	0.19
104	601665	齐鲁银行	45,500	287,560.00	0.19
105	002690	美亚光电	17,000	286,790.00	0.19
106	002384	东山精密	7,559	285,503.43	0.19
107	003022	联泓新科	17,600	278,608.00	0.19
108	600039	四川路桥	28,100	278,190.00	0.19
109	600499	科达制造	28,200	276,360.00	0.19
110	601995	中金公司	7,800	275,808.00	0.19
111	600061	国投资本	36,500	274,480.00	0.19

112	600329	达仁堂	8,200	273,552.00	0.18
113	002983	芯瑞达	12,900	273,351.00	0.18
114	002714	牧原股份	6,500	273,065.00	0.18
115	600906	财达证券	39,600	270,072.00	0.18
116	002648	卫星化学	15,500	268,615.00	0.18
117	001965	招商公路	22,300	267,600.00	0.18
118	300533	冰川网络	8,000	267,280.00	0.18
119	300369	绿盟科技	34,300	266,511.00	0.18
120	300270	中威电子	33,900	266,454.00	0.18
121	601686	友发集团	46,900	266,392.00	0.18
122	603529	爱玛科技	7,700	264,880.00	0.18
123	600675	中华企业	91,700	264,096.00	0.18
124	601857	中国石油	30,700	262,485.00	0.18
125	603565	中谷物流	27,400	261,670.00	0.18
126	000915	华特达因	7,400	261,590.00	0.18
127	300212	易华录	12,000	261,120.00	0.18
128	002925	盈趣科技	14,500	260,710.00	0.18
129	000166	申万宏源	51,700	259,534.00	0.18
130	601811	新华文轩	17,800	259,346.00	0.18
131	601958	金钼股份	23,700	259,278.00	0.17
132	002128	电投能源	13,100	259,118.00	0.17
133	600928	西安银行	65,900	258,328.00	0.17
134	688425	铁建重工	63,000	257,040.00	0.17
135	600583	海油工程	47,000	256,620.00	0.17
136	002873	新天药业	27,400	255,916.00	0.17
137	000807	云铝股份	16,000	255,680.00	0.17
138	600989	宝丰能源	15,800	255,012.00	0.17
139	601218	吉鑫科技	61,800	253,998.00	0.17
140	600132	重庆啤酒	4,600	253,460.00	0.17
141	000333	美的集团	3,500	252,700.00	0.17
142	000825	太钢不锈	70,300	252,377.00	0.17

143	301180	万祥科技	17,100	251,883.00	0.17
144	688636	智明达	7,450	251,735.50	0.17
145	300573	兴齐眼药	4,860	251,699.40	0.17
146	603380	易德龙	9,400	250,040.00	0.17
147	002056	横店东磁	17,600	249,040.00	0.17
148	600704	物产中大	47,200	248,744.00	0.17
149	002315	焦点科技	5,400	246,726.00	0.17
150	002572	索菲亚	17,500	245,175.00	0.17
151	000598	兴蓉环境	34,000	245,140.00	0.17
152	300990	同飞股份	4,900	244,510.00	0.17
153	301196	唯科科技	3,600	243,612.00	0.16
154	603040	新坐标	6,000	241,020.00	0.16
155	301362	民爆光电	5,900	240,779.00	0.16
156	002001	新 和 成	11,300	240,351.00	0.16
157	600109	国金证券	27,400	240,298.00	0.16
158	002311	海大集团	4,100	240,219.00	0.16
159	601106	中国一重	85,700	239,960.00	0.16
160	002299	圣农发展	16,700	238,643.00	0.16
161	688093	世华科技	7,677	238,370.85	0.16
162	002977	火箭科技	5,600	237,832.00	0.16
163	000636	风华高科	17,300	237,702.00	0.16
164	603173	福斯达	6,600	234,630.00	0.16
165	300383	光环新网	16,400	234,520.00	0.16
166	688800	瑞可达	4,760	234,192.00	0.16
167	603466	风语筑	23,200	234,088.00	0.16
168	000959	首钢股份	68,800	233,920.00	0.16
169	301221	光庭信息	4,500	233,865.00	0.16
170	688018	乐鑫科技	1,600	233,760.00	0.16
171	600131	国网信通	13,200	233,640.00	0.16
172	600918	中泰证券	36,200	232,766.00	0.16
173	603658	安图生物	6,200	232,500.00	0.16

174	688552	航天南湖	5,800	231,478.00	0.16
175	002461	珠江啤酒	20,500	231,445.00	0.16
176	300812	易天股份	10,000	231,100.00	0.16
177	688112	鼎阳科技	6,250	231,062.50	0.16
178	600707	彩虹股份	35,700	230,622.00	0.16
179	600977	中国电影	21,500	230,480.00	0.16
180	600983	惠而浦	22,200	230,436.00	0.16
181	300484	蓝海华腾	10,300	230,411.00	0.16
182	600496	精工钢构	72,000	230,400.00	0.16
183	688128	中国电研	9,400	230,300.00	0.16
184	301267	华夏眼科	12,000	230,040.00	0.16
185	002206	海利得	44,900	229,439.00	0.15
186	000977	浪潮信息	4,500	228,960.00	0.15
187	688508	芯朋微	4,098	228,750.36	0.15
188	600460	士兰微	9,200	228,344.00	0.15
189	300830	金现代	25,000	228,250.00	0.15
190	601965	中国汽研	12,800	227,200.00	0.15
191	002939	长城证券	27,100	227,098.00	0.15
192	300548	长芯博创	3,400	227,018.00	0.15
193	600688	上海石化	79,600	226,860.00	0.15
194	301396	宏景科技	3,640	226,080.40	0.15
195	688041	海光信息	1,600	226,064.00	0.15
196	601019	山东出版	23,800	225,386.00	0.15
197	301031	中熔电气	2,828	225,250.20	0.15
198	002996	顺博合金	30,500	224,480.00	0.15
199	300360	炬华科技	14,200	223,650.00	0.15
200	002736	国信证券	19,400	223,488.00	0.15
201	600744	华银电力	49,500	223,245.00	0.15
202	002314	南山控股	84,800	223,024.00	0.15
203	603766	隆鑫通用	17,400	222,024.00	0.15
204	600757	长江传媒	23,900	221,792.00	0.15

205	301526	国际复材	60,900	221,676.00	0.15
206	002958	青农商行	61,400	221,654.00	0.15
207	600507	方大特钢	51,000	221,340.00	0.15
208	601126	四方股份	13,600	221,272.00	0.15
209	002661	克明食品	22,100	221,221.00	0.15
210	000885	城发环境	16,600	221,112.00	0.15
211	600031	三一重工	12,300	220,785.00	0.15
212	688313	仕佳光子	5,800	220,690.00	0.15
213	601900	南方传媒	14,100	220,524.00	0.15
214	300690	双一科技	9,100	220,311.00	0.15
215	002479	富春环保	43,900	219,939.00	0.15
216	002852	道道全	23,000	219,880.00	0.15
217	600638	新黄浦	37,500	219,750.00	0.15
218	002170	芭田股份	21,400	219,350.00	0.15
219	600179	安通控股	79,400	219,144.00	0.15
220	002595	豪迈科技	3,700	219,114.00	0.15
221	600535	天士力	14,000	219,100.00	0.15
222	605599	菜百股份	13,400	219,090.00	0.15
223	300308	中际旭创	1,500	218,790.00	0.15
224	002293	罗莱生活	25,000	218,500.00	0.15
225	300033	同花顺	800	218,408.00	0.15
226	300595	欧普康视	14,300	218,361.00	0.15
227	300162	雷曼光电	28,700	218,120.00	0.15
228	301109	军信股份	14,600	217,248.00	0.15
229	002728	特一药业	25,700	216,137.00	0.15
230	300879	大叶股份	5,500	216,040.00	0.15
231	300824	北鼎股份	18,100	215,933.00	0.15
232	600369	西南证券	49,300	214,455.00	0.14
233	300255	常山药业	4,600	214,406.00	0.14
234	002346	柘中股份	15,700	213,520.00	0.14
235	600866	星湖科技	30,900	213,519.00	0.14

236	002588	史丹利	24,200	213,202.00	0.14
237	300768	迪普科技	12,400	212,660.00	0.14
238	301056	森赫股份	20,100	212,256.00	0.14
239	300770	新媒股份	5,300	211,947.00	0.14
240	601600	中国铝业	30,100	211,904.00	0.14
241	002215	诺普信	20,500	211,765.00	0.14
242	600036	招商银行	4,600	211,370.00	0.14
243	603235	天新药业	7,700	210,133.00	0.14
244	601139	深圳燃气	32,800	208,608.00	0.14
245	603327	福蓉科技	22,520	208,310.00	0.14
246	603786	科博达	3,700	205,017.00	0.14
247	688172	燕东微	10,400	204,464.00	0.14
248	002099	海翔药业	36,700	201,850.00	0.14
249	600528	中铁工业	27,300	201,474.00	0.14
250	301132	满坤科技	5,700	201,096.00	0.14
251	000937	冀中能源	34,800	200,100.00	0.14
252	600118	中国卫星	7,000	199,990.00	0.13
253	002594	比亚迪	600	199,146.00	0.13
254	300001	特锐德	8,300	198,951.00	0.13
255	600497	驰宏锌锗	37,500	198,375.00	0.13
256	300512	中亚股份	23,100	198,198.00	0.13
257	002841	视源股份	5,700	197,220.00	0.13
258	600362	江西铜业	8,400	196,812.00	0.13
259	000725	京东方A	49,100	195,909.00	0.13
260	600488	津药药业	46,800	195,156.00	0.13
261	603129	春风动力	900	194,850.00	0.13
262	000301	东方盛虹	23,300	194,089.00	0.13
263	300852	四会富仕	6,000	193,620.00	0.13
264	301212	联盛化学	7,300	193,231.00	0.13
265	002558	巨人网络	8,200	193,110.00	0.13
266	002249	大洋电机	29,300	192,794.00	0.13

267	600997	开滦股份	32,600	192,014.00	0.13
268	301408	华人健康	12,600	191,646.00	0.13
269	002637	赞宇科技	19,200	191,616.00	0.13
270	002142	宁波银行	7,000	191,520.00	0.13
271	300492	华图山鼎	2,820	191,421.60	0.13
272	300206	理邦仪器	15,900	191,118.00	0.13
273	603707	健友股份	17,100	190,665.00	0.13
274	600662	外服控股	37,300	190,603.00	0.13
275	002608	江苏国信	26,000	190,580.00	0.13
276	603520	司太立	19,400	190,120.00	0.13
277	300850	新强联	5,300	189,846.00	0.13
278	000738	航发控制	9,100	188,825.00	0.13
279	600862	中航高科	7,200	187,776.00	0.13
280	002831	裕同科技	8,000	187,360.00	0.13
281	000729	燕京啤酒	14,300	184,899.00	0.12
282	002911	佛燃能源	17,900	183,654.00	0.12
283	601898	中煤能源	16,700	182,698.00	0.12
284	002933	新兴装备	5,100	182,172.00	0.12
285	002155	湖南黄金	10,200	182,070.00	0.12
286	603156	养元饮品	8,600	181,976.00	0.12
287	000401	冀东水泥	41,500	181,770.00	0.12
288	000426	兴业银锡	11,500	181,700.00	0.12
289	002950	奥美医疗	21,100	181,460.00	0.12
290	000001	平安银行	15,000	181,050.00	0.12
291	000060	中金岭南	39,500	180,910.00	0.12
292	601918	新集能源	27,900	180,234.00	0.12
293	688148	芳源股份	33,200	179,612.00	0.12
294	600282	南钢股份	42,700	179,340.00	0.12
295	600988	赤峰黄金	7,200	179,136.00	0.12
296	000538	云南白药	3,200	178,528.00	0.12
297	600285	羚锐制药	7,800	176,826.00	0.12

298	002587	奥拓电子	27,400	176,730.00	0.12
299	300789	唐源电气	6,600	175,758.00	0.12
300	003031	中瓷电子	3,300	175,593.00	0.12
301	601083	锦江航运	15,800	175,538.00	0.12
302	600582	天地科技	29,200	174,908.00	0.12
303	688299	长阳科技	8,800	173,976.00	0.12
304	000429	粤高速 A	12,900	171,957.00	0.12
305	300468	四方精创	3,400	171,666.00	0.12
306	300389	艾比森	14,700	170,226.00	0.11
307	605138	盛泰集团	25,400	170,180.00	0.11
308	601598	中国外运	34,500	170,085.00	0.11
309	600508	上海能源	14,500	169,650.00	0.11
310	300752	隆利科技	7,500	168,600.00	0.11
311	600060	海信视像	7,300	168,046.00	0.11
312	002019	亿帆医药	12,800	166,272.00	0.11
313	000672	上峰水泥	20,900	165,110.00	0.11
314	601601	中国太保	4,400	165,044.00	0.11
315	002867	周大生	12,500	164,750.00	0.11
316	688088	虹软科技	3,400	164,050.00	0.11
317	002273	水晶光电	8,200	163,754.00	0.11
318	002701	奥瑞金	27,400	163,030.00	0.11
319	603826	坤彩科技	8,300	162,431.00	0.11
320	601231	环旭电子	11,100	162,393.00	0.11
321	600056	中国医药	15,600	161,304.00	0.11
322	601211	国泰海通	8,400	160,944.00	0.11
323	600848	上海临港	17,700	160,539.00	0.11
324	688772	珠海冠宇	11,222	160,362.38	0.11
325	300406	九强生物	11,300	159,895.00	0.11
326	688599	天合光能	11,000	159,830.00	0.11
327	300529	健帆生物	7,400	159,618.00	0.11
328	000686	东北证券	20,900	159,467.00	0.11

329	301137	哈焊华通	4,300	159,315.00	0.11
330	000831	中国稀土	4,400	158,928.00	0.11
331	601966	玲珑轮胎	10,800	158,436.00	0.11
332	302132	中航成飞	1,800	158,292.00	0.11
333	002545	东方铁塔	17,800	158,242.00	0.11
334	600459	贵研铂业	10,200	158,202.00	0.11
335	600919	江苏银行	13,200	157,608.00	0.11
336	002534	西子洁能	14,000	157,360.00	0.11
337	300279	和晶科技	22,700	157,311.00	0.11
338	000423	东阿阿胶	3,000	156,900.00	0.11
339	601628	中国人寿	3,800	156,522.00	0.11
340	002294	信立泰	3,300	156,189.00	0.11
341	002261	拓维信息	5,000	154,750.00	0.10
342	601168	西部矿业	9,300	154,659.00	0.10
343	300496	中科创达	2,700	154,494.00	0.10
344	300498	温氏股份	9,000	153,720.00	0.10
345	603883	老百姓	7,300	153,373.00	0.10
346	603933	睿能科技	8,900	153,258.00	0.10
347	300796	贝斯美	14,800	152,588.00	0.10
348	600995	南网储能	15,600	152,568.00	0.10
349	600482	中国动力	6,600	152,262.00	0.10
350	601330	绿色动力	19,900	152,036.00	0.10
351	601288	农业银行	25,700	151,116.00	0.10
352	600398	海澜之家	21,700	151,032.00	0.10
353	603619	中曼石油	7,500	150,525.00	0.10
354	600361	创新新材	37,700	150,423.00	0.10
355	300800	力合科技	13,500	149,715.00	0.10
356	603699	纽威股份	4,800	149,616.00	0.10
357	600521	华海药业	8,000	149,040.00	0.10
358	002138	顺络电子	5,300	149,036.00	0.10
359	600392	盛和资源	11,300	148,821.00	0.10

360	688029	南微医学	2,200	148,610.00	0.10
361	603882	金域医学	5,200	148,512.00	0.10
362	603185	弘元绿能	10,000	148,500.00	0.10
363	600153	建发股份	14,300	148,291.00	0.10
364	600926	杭州银行	8,800	148,016.00	0.10
365	301236	软通动力	2,700	147,528.00	0.10
366	300821	东岳硅材	18,700	146,982.00	0.10
367	688278	特宝生物	2,028	146,239.08	0.10
368	600458	时代新材	10,600	145,432.00	0.10
369	600642	申能股份	16,900	145,340.00	0.10
370	601099	太平洋	36,700	144,231.00	0.10
371	000739	普洛药业	10,300	144,200.00	0.10
372	000789	万年青	26,300	143,598.00	0.10
373	300009	安科生物	17,100	143,127.00	0.10
374	002508	老板电器	7,500	142,575.00	0.10
375	300685	艾德生物	6,600	142,098.00	0.10
376	603898	好莱客	12,900	141,771.00	0.10
377	600066	宇通客车	5,700	141,702.00	0.10
378	688686	奥普特	1,480	141,517.60	0.10
379	300978	东箭科技	12,600	140,616.00	0.09
380	300101	振芯科技	6,200	140,306.00	0.09
381	600796	钱江生化	23,900	140,293.00	0.09
382	688213	思特威	1,366	139,632.52	0.09
383	603698	航天工程	7,900	139,198.00	0.09
384	603986	兆易创新	1,100	139,183.00	0.09
385	002475	立讯精密	4,000	138,760.00	0.09
386	603713	密尔克卫	2,600	138,632.00	0.09
387	688509	正元地信	32,203	138,150.87	0.09
388	688696	极米科技	1,200	137,232.00	0.09
389	688403	汇成股份	13,200	137,148.00	0.09
390	603893	瑞芯微	900	136,674.00	0.09

391	002399	海普瑞	11,400	135,774.00	0.09
392	600536	中国软件	2,900	135,633.00	0.09
392	600435	北方导航	8,700	135,633.00	0.09
393	603160	汇顶科技	1,900	134,957.00	0.09
394	300760	迈瑞医疗	600	134,850.00	0.09
395	601999	出版传媒	19,200	134,208.00	0.09
396	688127	蓝特光学	5,200	133,692.00	0.09
397	300599	雄塑科技	15,500	133,300.00	0.09
398	000898	鞍钢股份	57,400	133,168.00	0.09
398	000877	天山股份	28,700	133,168.00	0.09
399	688007	光峰科技	9,200	133,032.00	0.09
400	300146	汤臣倍健	11,800	132,632.00	0.09
401	002322	理工能科	10,900	131,890.00	0.09
402	600566	济川药业	5,000	131,650.00	0.09
403	002531	天顺风能	18,400	131,376.00	0.09
404	600660	福耀玻璃	2,300	131,123.00	0.09
405	603816	顾家家居	5,000	127,600.00	0.09
405	600486	扬农化工	2,200	127,600.00	0.09
406	601799	星宇股份	1,000	125,000.00	0.08
407	300059	东方财富	5,400	124,902.00	0.08
408	000776	广发证券	7,400	124,394.00	0.08
409	002025	航天电器	2,400	123,384.00	0.08
410	000921	海信家电	4,800	123,360.00	0.08
411	601609	金田股份	17,500	122,675.00	0.08
412	002353	杰瑞股份	3,500	122,500.00	0.08
413	301106	骏成科技	4,100	122,180.00	0.08
414	601869	长飞光纤	3,000	122,160.00	0.08
415	301539	宏鑫科技	6,561	121,509.72	0.08
416	600469	风神股份	21,500	121,475.00	0.08
417	600999	招商证券	6,900	121,371.00	0.08
418	600681	百川能源	34,500	121,095.00	0.08

419	603201	常润股份	6,500	119,925.00	0.08
420	605118	力鼎光电	4,800	119,184.00	0.08
421	688779	五矿新能	21,800	118,592.00	0.08
422	002111	威海广泰	11,000	118,030.00	0.08
423	603737	三棵树	3,200	117,920.00	0.08
424	002517	恺英网络	6,100	117,791.00	0.08
425	600968	海油发展	28,800	117,504.00	0.08
426	603486	科沃斯	2,000	116,460.00	0.08
427	688523	航天环宇	5,400	116,154.00	0.08
428	000513	丽珠集团	3,200	115,328.00	0.08
429	002905	金逸影视	12,400	115,072.00	0.08
430	600885	宏发股份	5,120	114,227.20	0.08
431	300442	润泽科技	2,300	113,919.00	0.08
432	301102	兆讯传媒	10,400	113,568.00	0.08
433	601988	中国银行	20,200	113,524.00	0.08
434	601236	红塔证券	13,400	113,498.00	0.08
435	002096	易普力	9,100	112,931.00	0.08
436	688111	金山办公	400	112,020.00	0.08
437	600580	卧龙电驱	5,640	111,502.80	0.08
438	601577	长沙银行	11,200	111,328.00	0.08
439	688279	峰昭科技	600	111,300.00	0.08
440	603868	飞科电器	3,100	111,197.00	0.08
441	300105	龙源技术	14,300	110,253.00	0.07
442	300130	新国都	3,100	110,143.00	0.07
443	002368	太极股份	4,700	110,074.00	0.07
444	600126	杭钢股份	12,200	109,800.00	0.07
445	300474	景嘉微	1,500	109,500.00	0.07
446	600380	健康元	9,900	109,197.00	0.07
447	002064	华峰化学	16,500	109,065.00	0.07
448	600764	中国海防	3,200	108,800.00	0.07
449	601825	沪农商行	11,200	108,640.00	0.07

450	301321	翰博高新	7,100	108,559.00	0.07
451	300795	米奥会展	7,300	108,405.00	0.07
452	300080	易成新能	25,900	108,262.00	0.07
453	603075	热威股份	5,400	107,946.00	0.07
454	688525	佰维存储	1,600	107,840.00	0.07
455	600713	南京医药	21,300	107,778.00	0.07
456	001358	兴欣新材	4,500	107,685.00	0.07
457	300196	长海股份	8,800	107,360.00	0.07
458	300866	安克创新	940	106,784.00	0.07
459	300339	润和软件	2,100	106,743.00	0.07
460	000719	中原传媒	8,600	106,726.00	0.07
461	600598	北大荒	7,400	106,708.00	0.07
461	000750	国海证券	25,900	106,708.00	0.07
462	600820	隧道股份	17,400	106,140.00	0.07
463	300285	国瓷材料	6,100	105,835.00	0.07
464	688819	天能股份	3,800	105,488.00	0.07
465	000034	神州数码	2,800	105,392.00	0.07
466	002797	第一创业	14,600	103,368.00	0.07
467	600737	中粮糖业	10,800	102,060.00	0.07
468	603708	家家悦	10,000	102,000.00	0.07
469	000901	航天科技	8,200	101,926.00	0.07
470	600993	马应龙	3,600	101,808.00	0.07
471	002818	富森美	8,100	101,088.00	0.07
472	605399	晨光新材	7,900	100,962.00	0.07
473	600237	铜峰电子	13,900	100,775.00	0.07
474	688017	绿的谐波	800	99,912.00	0.07
475	300679	电连技术	2,200	99,836.00	0.07
476	600900	长江电力	3,300	99,462.00	0.07
477	600416	湘电股份	7,400	99,456.00	0.07
478	300604	长川科技	2,200	98,802.00	0.07
479	601567	三星医疗	4,400	98,648.00	0.07

480	301257	普蕊斯	3,200	98,560.00	0.07
481	002340	格林美	15,500	98,425.00	0.07
482	600595	中孚实业	22,400	98,112.00	0.07
483	002436	兴森科技	7,400	97,976.00	0.07
484	002942	新农股份	5,600	97,328.00	0.07
485	300239	东宝生物	16,400	97,252.00	0.07
486	603885	吉祥航空	7,200	96,984.00	0.07
487	301265	华新环保	9,500	96,900.00	0.07
488	603230	内蒙新华	7,500	96,825.00	0.07
489	301330	熵基科技	3,580	96,767.40	0.07
490	688586	江航装备	8,600	96,750.00	0.07
491	000153	丰原药业	15,600	96,252.00	0.06
492	001266	宏英智能	3,600	95,220.00	0.06
493	600776	东方通信	8,500	94,690.00	0.06
494	600718	东软集团	9,700	94,575.00	0.06
495	688079	美迪凯	9,400	94,376.00	0.06
496	603048	浙江黎明	4,800	94,368.00	0.06
497	300813	泰林生物	4,400	94,204.00	0.06
498	300636	同和药业	12,200	93,696.00	0.06
499	002060	广东建工	26,900	93,612.00	0.06
500	601608	中信重工	21,300	93,081.00	0.06
501	301195	北路智控	2,600	93,080.00	0.06
502	301376	致欧科技	5,100	93,075.00	0.06
503	688580	伟思医疗	2,000	92,980.00	0.06
504	603311	金海高科	8,400	92,904.00	0.06
505	300187	永清环保	18,200	92,820.00	0.06
506	002646	天佑德酒	10,000	92,800.00	0.06
507	603213	镇洋发展	8,300	92,711.00	0.06
508	603701	德宏股份	5,300	92,644.00	0.06
509	301017	漱玉平民	7,200	92,376.00	0.06
510	603936	博敏电子	9,700	91,471.00	0.06

511	000603	盛达资源	6,100	90,829.00	0.06
512	301251	威尔高	2,300	90,183.00	0.06
513	002372	伟星新材	8,700	90,132.00	0.06
514	300743	天地数码	4,500	90,090.00	0.06
515	301235	华康洁净	3,800	89,832.00	0.06
516	300414	中光防雷	5,800	89,784.00	0.06
517	603916	苏博特	9,900	89,694.00	0.06
518	002623	亚玛顿	5,500	88,825.00	0.06
519	603688	石英股份	2,500	88,050.00	0.06
520	603115	海星股份	6,100	88,023.00	0.06
521	300037	新宙邦	2,500	88,000.00	0.06
522	688223	晶科能源	16,800	87,192.00	0.06
523	000708	中信特钢	7,400	87,024.00	0.06
524	688010	福光股份	2,800	86,912.00	0.06
524	300214	日科化学	12,800	86,912.00	0.06
525	600098	广州发展	13,900	86,875.00	0.06
526	000728	国元证券	11,000	86,790.00	0.06
527	603628	清源股份	7,100	86,691.00	0.06
528	688598	金博股份	3,400	86,428.00	0.06
529	301291	明阳电气	2,100	86,415.00	0.06
530	301042	安联锐视	2,100	86,394.00	0.06
531	300662	科锐国际	2,900	86,159.00	0.06
532	601107	四川成渝	14,300	86,086.00	0.06
533	688311	盟升电子	1,988	85,583.40	0.06
534	603987	康德莱	11,100	85,470.00	0.06
535	300251	光线传媒	4,200	85,134.00	0.06
536	000800	一汽解放	12,400	85,064.00	0.06
537	301060	兰卫医学	8,800	84,920.00	0.06
538	001360	南矿集团	6,100	84,912.00	0.06
539	000887	中鼎股份	4,800	84,432.00	0.06
540	605186	健麾信息	4,000	83,760.00	0.06

541	600438	通威股份	5,000	83,750.00	0.06
542	001322	箭牌家居	9,900	83,655.00	0.06
543	601138	工业富联	3,900	83,382.00	0.06
544	000818	航锦科技	3,700	83,250.00	0.06
545	600155	华创云信	11,900	82,824.00	0.06
546	601169	北京银行	12,100	82,643.00	0.06
547	301386	未来电器	3,800	82,574.00	0.06
548	603689	皖天然气	9,800	82,516.00	0.06
548	300400	劲拓股份	4,900	82,516.00	0.06
549	301029	怡合达	3,600	82,296.00	0.06
550	603095	越剑智能	5,000	82,150.00	0.06
551	600498	烽火通信	3,900	82,017.00	0.06
552	002493	荣盛石化	9,900	81,972.00	0.06
553	603288	海天味业	2,100	81,711.00	0.06
554	002985	北摩高科	2,700	81,675.00	0.06
555	600057	厦门象屿	11,600	81,548.00	0.06
556	300118	东方日升	8,500	81,430.00	0.05
557	000755	山西高速	16,700	81,329.00	0.05
558	603899	晨光股份	2,800	81,172.00	0.05
559	688249	晶合集成	4,000	81,080.00	0.05
560	688608	恒玄科技	233	81,079.34	0.05
561	601860	紫金银行	27,000	81,000.00	0.05
562	688123	聚辰股份	1,000	80,990.00	0.05
563	002916	深南电路	750	80,857.50	0.05
564	601669	中国电建	16,600	80,842.00	0.05
565	688117	圣诺生物	2,400	80,760.00	0.05
566	688472	阿特斯	8,800	80,520.00	0.05
567	688629	华丰科技	1,400	80,080.00	0.05
568	300394	天孚通信	1,000	79,840.00	0.05
569	601579	会稽山	4,000	79,640.00	0.05
570	000799	酒鬼酒	1,800	79,182.00	0.05

571	300699	光威复材	2,500	79,175.00	0.05
572	601228	广州港	24,500	79,135.00	0.05
573	600391	航发科技	2,700	78,840.00	0.05
574	000983	山西焦煤	12,300	78,720.00	0.05
575	002030	达安基因	13,000	78,650.00	0.05
576	301153	中科江南	3,000	78,600.00	0.05
577	000848	承德露露	8,600	78,518.00	0.05
578	300602	飞荣达	3,700	78,477.00	0.05
579	601162	天风证券	15,900	78,387.00	0.05
580	603393	新天然气	2,700	78,165.00	0.05
581	301191	菲菱科思	900	78,093.00	0.05
582	688498	源杰科技	400	78,000.00	0.05
583	002705	新宝股份	5,300	77,910.00	0.05
584	603309	维力医疗	6,100	77,592.00	0.05
585	688348	昱能科技	1,800	77,346.00	0.05
586	002221	东华能源	8,000	77,280.00	0.05
587	300894	火星人	6,000	76,980.00	0.05
588	600637	东方明珠	10,300	76,941.00	0.05
589	688362	甬矽电子	2,581	76,862.18	0.05
590	600673	东阳光	6,600	76,758.00	0.05
591	600015	华夏银行	9,700	76,727.00	0.05
592	002050	三花智控	2,900	76,502.00	0.05
593	002913	奥士康	2,600	76,466.00	0.05
594	001223	欧克科技	1,700	76,398.00	0.05
595	603020	爱普股份	8,300	76,194.00	0.05
596	603601	再升科技	18,700	75,922.00	0.05
597	301018	申菱环境	2,000	75,880.00	0.05
598	301088	戎美股份	5,500	75,625.00	0.05
599	300229	拓尔思	4,100	75,604.00	0.05
600	600325	华发股份	15,500	75,485.00	0.05
601	300303	聚飞光电	11,900	75,446.00	0.05

602	000960	锡业股份	4,900	74,970.00	0.05
603	000021	深科技	4,000	74,960.00	0.05
604	300475	香农芯创	2,100	74,823.00	0.05
605	002241	歌尔股份	3,200	74,624.00	0.05
606	301218	华是科技	3,500	74,620.00	0.05
607	301067	显盈科技	2,200	74,426.00	0.05
608	688153	唯捷创芯	2,400	74,424.00	0.05
609	601009	南京银行	6,400	74,368.00	0.05
610	301020	密封科技	3,400	74,222.00	0.05
611	002948	青岛银行	14,900	74,202.00	0.05
612	601595	上海电影	2,500	74,100.00	0.05
613	600202	哈空调	13,200	74,052.00	0.05
614	002063	远光软件	12,400	73,780.00	0.05
615	002027	分众传媒	10,100	73,730.00	0.05
616	300581	晨曦航空	3,600	73,692.00	0.05
617	603237	五芳斋	4,400	73,524.00	0.05
618	688116	天奈科技	1,600	73,232.00	0.05
619	002429	兆驰股份	16,700	73,146.00	0.05
620	603456	九洲药业	4,800	73,008.00	0.05
621	600176	中国巨石	6,400	72,960.00	0.05
621	300241	瑞丰光电	12,800	72,960.00	0.05
622	600959	江苏有线	21,200	72,928.00	0.05
622	002295	精艺股份	8,600	72,928.00	0.05
623	000726	鲁泰A	11,500	72,910.00	0.05
624	600511	国药股份	2,500	72,900.00	0.05
624	000727	冠捷科技	30,000	72,900.00	0.05
625	000963	华东医药	1,800	72,648.00	0.05
626	002679	福建金森	7,600	72,580.00	0.05
627	002655	共达电声	5,600	72,576.00	0.05
628	000778	新兴铸管	19,500	72,540.00	0.05
629	300011	鼎汉技术	9,700	72,459.00	0.05

630	000629	钒钛股份	28,300	72,448.00	0.05
631	001229	魅视科技	2,200	72,424.00	0.05
632	603225	新凤鸣	6,800	72,420.00	0.05
633	600272	开开实业	5,300	72,292.00	0.05
634	601990	南京证券	8,900	71,912.00	0.05
635	002430	杭氧股份	3,700	71,854.00	0.05
636	300054	鼎龙股份	2,500	71,700.00	0.05
637	300590	移为通信	5,500	71,555.00	0.05
638	300049	福瑞股份	2,200	71,346.00	0.05
639	603298	杭叉集团	3,400	71,230.00	0.05
640	002410	广联达	5,300	71,073.00	0.05
641	603939	益丰药房	2,900	70,963.00	0.05
642	688203	海正生材	5,600	70,896.00	0.05
643	600529	山东药玻	3,200	70,848.00	0.05
644	688590	新致软件	3,400	69,836.00	0.05
645	601000	唐山港	17,200	69,832.00	0.05
646	688052	纳芯微	400	69,796.00	0.05
647	688289	圣湘生物	3,400	69,632.00	0.05
648	002706	良信股份	7,800	69,498.00	0.05
649	600725	云维股份	21,500	69,445.00	0.05
650	600050	中国联通	13,000	69,420.00	0.05
651	605056	咸亨国际	4,500	69,300.00	0.05
652	688048	长光华芯	1,200	69,288.00	0.05
653	002244	滨江集团	7,100	69,225.00	0.05
654	300219	鸿利智汇	10,300	69,216.00	0.05
655	300223	北京君正	1,000	69,200.00	0.05
656	300748	金力永磁	2,900	69,136.00	0.05
657	002281	光迅科技	1,400	69,048.00	0.05
658	603728	鸣志电器	1,200	68,964.00	0.05
659	000404	长虹华意	9,700	68,870.00	0.05
660	002333	罗普斯金	12,500	68,750.00	0.05

661	300973	立高食品	1,400	68,278.00	0.05
662	300739	明阳电路	4,600	68,264.00	0.05
663	002195	岩山科技	12,100	68,123.00	0.05
664	601668	中国建筑	11,800	68,086.00	0.05
665	600352	浙江龙盛	6,700	68,072.00	0.05
666	300058	蓝色光标	10,320	67,699.20	0.05
667	002774	快意电梯	7,700	67,683.00	0.05
668	301165	锐捷网络	1,100	67,606.00	0.05
669	000559	万向钱潮	8,800	67,320.00	0.05
670	603088	宁波精达	7,400	67,266.00	0.05
671	300408	三环集团	2,000	66,800.00	0.05
672	001914	招商积余	5,400	66,798.00	0.05
673	300143	盈康生命	6,900	66,447.00	0.04
674	601108	财通证券	8,400	66,444.00	0.04
675	603605	珀莱雅	800	66,232.00	0.04
676	301498	乖宝宠物	600	65,622.00	0.04
677	002745	木林森	8,300	65,404.00	0.04
678	301286	侨源股份	2,600	64,974.00	0.04
679	601100	恒立液压	900	64,800.00	0.04
680	001289	龙源电力	4,000	64,720.00	0.04
681	000978	桂林旅游	10,500	64,365.00	0.04
682	000411	英特集团	6,000	64,320.00	0.04
683	600561	江西长运	9,800	64,190.00	0.04
684	601061	中信金属	8,100	64,071.00	0.04
685	300979	华利集团	1,200	63,084.00	0.04
686	300018	中元股份	7,900	62,805.00	0.04
687	600487	亨通光电	4,100	62,730.00	0.04
688	300628	亿联网络	1,800	62,568.00	0.04
689	300670	大烨智能	9,300	61,194.00	0.04
690	002330	得利斯	13,200	60,456.00	0.04
691	002516	旷达科技	11,700	60,255.00	0.04

692	688303	大全能源	2,800	59,696.00	0.04
693	600378	昊华科技	2,200	59,554.00	0.04
694	000703	恒逸石化	10,000	58,800.00	0.04
695	603323	苏农银行	10,390	58,287.90	0.04
696	688019	安集科技	383	58,139.40	0.04
697	300560	中富通	4,300	58,093.00	0.04
698	601366	利群股份	12,600	57,960.00	0.04
699	688200	华峰测控	400	57,680.00	0.04
700	001378	德冠新材	2,600	57,642.00	0.04
701	601808	中海油服	4,100	56,416.00	0.04
702	000988	华工科技	1,200	56,412.00	0.04
703	688301	奕瑞科技	640	56,070.40	0.04
704	600699	均胜电子	3,200	55,808.00	0.04
705	688238	和元生物	9,000	55,800.00	0.04
706	601200	上海环境	7,000	55,580.00	0.04
707	688536	思瑞浦	400	55,488.00	0.04
708	300062	中能电气	10,300	55,414.00	0.04
709	601128	常熟银行	7,420	54,685.40	0.04
710	300002	神州泰岳	4,600	54,280.00	0.04
711	688083	中望软件	840	54,104.40	0.04
712	688777	中控技术	1,200	53,892.00	0.04
713	688326	经纬恒润	600	53,544.00	0.04
714	300888	稳健医疗	1,300	53,430.00	0.04
715	600500	中化国际	13,800	52,854.00	0.04
716	688595	芯海科技	1,400	52,346.00	0.04
717	300864	南大环境	2,600	51,870.00	0.04
718	300151	昌红科技	4,200	51,702.00	0.03
719	301239	普瑞眼科	1,300	50,960.00	0.03
720	603636	南威软件	4,000	50,560.00	0.03
721	301215	中汽股份	8,100	50,220.00	0.03
722	002788	鹭燕医药	5,814	49,825.98	0.03

723	300443	金雷股份	2,200	49,720.00	0.03
724	300986	志特新材	3,940	49,644.00	0.03
725	301282	金禄电子	2,000	49,580.00	0.03
726	301222	浙江恒威	1,700	49,487.00	0.03
727	688571	杭华股份	6,400	49,344.00	0.03
728	603511	爱慕股份	3,200	49,248.00	0.03
729	301129	瑞纳智能	1,800	48,888.00	0.03
730	000932	华菱钢铁	11,100	48,840.00	0.03
731	603170	宝立食品	3,900	48,633.00	0.03
732	301055	张小泉	2,300	48,484.00	0.03
733	601949	中国出版	7,200	47,808.00	0.03
734	002543	万和电气	4,300	47,773.00	0.03
735	688119	中钢洛耐	11,400	47,652.00	0.03
736	600742	富维股份	5,000	47,550.00	0.03
737	301419	阿莱德	1,720	47,472.00	0.03
738	300981	中红医疗	3,960	47,401.20	0.03
739	600373	中文传媒	4,600	47,242.00	0.03
740	002796	世嘉科技	4,000	47,200.00	0.03
741	601827	三峰环境	5,600	47,040.00	0.03
742	000798	中水渔业	6,300	46,746.00	0.03
743	300359	全通教育	7,700	46,739.00	0.03
744	000931	中关村	8,600	46,698.00	0.03
745	601229	上海银行	4,400	46,684.00	0.03
746	603979	金诚信	1,000	46,440.00	0.03
747	300257	开山股份	4,600	46,322.00	0.03
748	002349	精华制药	6,400	46,016.00	0.03
749	002676	顺威股份	6,300	45,549.00	0.03
750	001222	源飞宠物	2,300	45,356.00	0.03
751	688505	复旦张江	5,200	45,032.00	0.03
752	603013	亚普股份	2,600	44,928.00	0.03
753	301039	中集车辆	5,500	44,715.00	0.03

754	002179	中航光电	1,100	44,396.00	0.03
755	603373	安邦护卫	900	44,352.00	0.03
756	002371	北方华创	100	44,221.00	0.03
757	601998	中信银行	5,200	44,200.00	0.03
758	002782	可立克	3,400	44,132.00	0.03
759	603568	伟明环保	2,300	43,884.00	0.03
760	603408	建霖家居	4,000	43,880.00	0.03
761	002507	涪陵榨菜	3,426	43,818.54	0.03
762	600177	雅戈尔	6,000	43,800.00	0.03
763	002409	雅克科技	800	43,752.00	0.03
764	002290	禾盛新材	1,400	43,750.00	0.03
765	000768	中航西飞	1,600	43,744.00	0.03
766	300127	银河磁体	1,500	43,485.00	0.03
767	300606	金太阳	2,200	43,384.00	0.03
768	301115	联检科技	2,800	43,372.00	0.03
769	002928	华夏航空	5,200	43,212.00	0.03
770	002130	沃尔核材	1,800	42,876.00	0.03
771	603210	泰鸿万立	2,099	42,777.09	0.03
772	300919	中伟股份	1,300	42,744.00	0.03
773	301268	铭利达	2,300	42,665.00	0.03
774	603231	索宝蛋白	2,600	42,588.00	0.03
775	603301	振德医疗	2,000	42,220.00	0.03
776	301285	鸿日达	1,300	42,185.00	0.03
777	301100	风光股份	2,400	41,808.00	0.03
778	603386	骏亚科技	3,300	41,745.00	0.03
779	002893	京能热力	3,900	41,691.00	0.03
780	300869	康泰医学	2,900	41,586.00	0.03
781	600229	城市传媒	5,800	41,354.00	0.03
782	300358	楚天科技	5,300	41,340.00	0.03
783	001387	雪祺电气	3,000	41,220.00	0.03
784	300395	菲利华	800	40,880.00	0.03

785	605500	森林包装	5,500	40,645.00	0.03
786	603290	斯达半导	500	40,635.00	0.03
787	300558	贝达药业	700	40,565.00	0.03
788	300100	双林股份	860	40,488.80	0.03
789	000514	渝开发	8,900	40,317.00	0.03
790	601127	赛力斯	300	40,296.00	0.03
791	000534	万泽股份	2,700	40,284.00	0.03
792	601512	中新集团	5,500	40,260.00	0.03
793	688556	高测股份	5,600	40,208.00	0.03
794	603217	元利科技	2,200	40,106.00	0.03
795	300945	曼卡龙	1,800	39,942.00	0.03
796	603168	莎普爱思	5,400	39,906.00	0.03
797	605369	拱东医疗	2,100	39,879.00	0.03
798	002318	久立特材	1,700	39,763.00	0.03
799	300832	新产业	700	39,704.00	0.03
800	600690	海尔智家	1,600	39,648.00	0.03
801	300463	迈克生物	3,300	39,270.00	0.03
802	603886	元祖股份	3,000	39,210.00	0.03
803	688726	拉普拉斯	904	38,962.40	0.03
804	600018	上港集团	6,800	38,828.00	0.03
805	000919	金陵药业	5,700	38,817.00	0.03
806	601519	大智慧	3,800	38,722.00	0.03
807	603365	水星家纺	2,100	38,556.00	0.03
808	600779	水井坊	900	38,376.00	0.03
809	603328	依顿电子	3,900	38,259.00	0.03
810	603083	剑桥科技	800	37,840.00	0.03
811	300320	海达股份	3,800	37,772.00	0.03
812	002445	中南文化	14,800	37,740.00	0.03
813	300665	飞鹿股份	4,500	37,620.00	0.03
814	603938	三孚股份	2,600	37,388.00	0.03
815	603703	盛洋科技	3,600	37,332.00	0.03

816	000011	深物业A	4,400	37,180.00	0.03
817	600874	创业环保	6,200	37,014.00	0.02
818	000042	中洲控股	5,200	36,972.00	0.02
819	600312	平高电气	2,400	36,936.00	0.02
820	301262	海看股份	1,400	36,904.00	0.02
821	002966	苏州银行	4,200	36,876.00	0.02
822	002578	闽发铝业	11,000	36,850.00	0.02
823	002472	双环传动	1,100	36,839.00	0.02
824	300706	阿石创	1,600	36,800.00	0.02
825	603927	中科软	1,900	36,746.00	0.02
826	300701	森霸传感	3,500	36,610.00	0.02
827	002739	万达电影	3,200	36,576.00	0.02
828	600623	华谊集团	4,800	36,336.00	0.02
829	600276	恒瑞医药	700	36,330.00	0.02
830	603199	九华旅游	1,000	36,240.00	0.02
831	300839	博汇股份	3,400	36,142.00	0.02
832	601066	中信建投	1,500	36,075.00	0.02
833	300107	建新股份	4,500	36,045.00	0.02
834	601328	交通银行	4,500	36,000.00	0.02
835	002662	峰璟股份	10,500	35,910.00	0.02
836	300277	海联讯	2,800	35,896.00	0.02
837	300141	和顺电气	3,900	35,763.00	0.02
838	002660	茂硕电源	3,800	35,720.00	0.02
839	600838	上海九百	4,400	35,596.00	0.02
840	300434	金石亚药	3,700	35,594.00	0.02
841	600863	内蒙华电	8,600	35,346.00	0.02
842	600809	山西汾酒	200	35,278.00	0.02
842	301059	金三江	3,100	35,278.00	0.02
843	601696	中银证券	3,300	35,277.00	0.02
844	688981	中芯国际	400	35,268.00	0.02
845	002851	麦格米特	700	35,098.00	0.02

846	002044	美年健康	6,800	34,952.00	0.02
847	605358	立昂微	1,500	34,950.00	0.02
848	688349	三一重能	1,400	34,916.00	0.02
849	600141	兴发集团	1,700	34,901.00	0.02
850	300667	必创科技	2,200	34,738.00	0.02
851	301486	致尚科技	500	34,535.00	0.02
852	002488	金固股份	2,500	34,500.00	0.02
853	300960	通业科技	1,400	34,496.00	0.02
854	300763	锦浪科技	600	34,434.00	0.02
855	002352	顺丰控股	700	34,132.00	0.02
856	000975	山金国际	1,800	34,092.00	0.02
857	000030	富奥股份	5,700	33,573.00	0.02
858	301338	凯格精机	700	33,397.00	0.02
859	603009	北特科技	800	33,360.00	0.02
860	002262	恩华药业	1,600	33,248.00	0.02
861	603556	海兴电力	1,300	33,111.00	0.02
862	688799	华纳药厂	800	33,040.00	0.02
863	600241	时代万恒	3,100	33,015.00	0.02
864	600143	金发科技	3,200	32,992.00	0.02
865	002597	金禾实业	1,400	32,970.00	0.02
866	002407	多氟多	2,700	32,913.00	0.02
867	600563	法拉电子	300	32,727.00	0.02
868	300999	金龙鱼	1,100	32,483.00	0.02
869	300007	汉威科技	800	32,480.00	0.02
870	600839	四川长虹	3,300	32,076.00	0.02
871	603680	今创集团	2,800	32,004.00	0.02
872	688372	伟测科技	520	31,408.00	0.02
873	688169	石头科技	200	31,310.00	0.02
874	688122	西部超导	600	31,128.00	0.02
875	600483	福能股份	3,200	30,848.00	0.02
876	002156	通富微电	1,200	30,744.00	0.02

877	000967	盈峰环境	4,400	30,580.00	0.02
878	001227	兰州银行	12,200	30,500.00	0.02
879	688678	福立旺	1,600	30,464.00	0.02
880	600166	福田汽车	11,200	30,352.00	0.02
881	002535	林州重机	7,600	30,324.00	0.02
882	000425	徐工机械	3,900	30,303.00	0.02
883	688295	中复神鹰	1,423	29,598.40	0.02
884	000690	宝新能源	6,500	29,575.00	0.02
885	301328	维峰电子	700	29,505.00	0.02
886	002074	国轩高科	900	29,214.00	0.02
887	301337	亚华电子	1,000	29,210.00	0.02
888	603180	金牌家居	1,500	29,205.00	0.02
889	600000	浦发银行	2,100	29,148.00	0.02
890	600724	宁波富达	6,400	29,120.00	0.02
891	300110	华仁药业	9,000	29,070.00	0.02
892	600008	首创环保	9,600	28,992.00	0.02
893	002607	中公教育	9,400	28,764.00	0.02
894	603056	德邦股份	1,800	28,656.00	0.02
895	600990	四创电子	1,000	28,040.00	0.02
896	300982	苏文电能	1,500	26,985.00	0.02
897	002078	太阳纸业	2,000	26,920.00	0.02
898	688578	艾力斯	285	26,516.40	0.02
899	603609	禾丰股份	3,200	26,432.00	0.02
900	688411	海博思创	314	26,215.86	0.02
901	300765	新诺威	500	25,845.00	0.02
902	600422	昆药集团	1,800	25,758.00	0.02
903	002722	物产金轮	1,600	25,744.00	0.02
904	300996	普联软件	1,700	25,551.00	0.02
905	000911	广农糖业	3,500	25,445.00	0.02
906	603167	渤海轮渡	2,200	25,080.00	0.02
907	300074	华平股份	5,100	24,888.00	0.02

908	002408	齐翔腾达	5,500	24,640.00	0.02
909	000027	深圳能源	3,800	24,244.00	0.02
910	003018	金富科技	2,100	23,667.00	0.02
911	603877	太平鸟	1,600	23,200.00	0.02
912	000997	新大陆	700	22,666.00	0.02
913	002850	科达利	200	22,634.00	0.02
914	300319	麦捷科技	2,100	22,554.00	0.02
915	300732	设研院	3,100	22,382.00	0.02
916	688685	迈信林	400	22,340.00	0.02
917	300025	华星创业	3,200	22,208.00	0.01
918	000066	中国长城	1,500	22,200.00	0.01
919	600216	浙江医药	1,500	22,185.00	0.01
920	301355	南王科技	1,800	21,492.00	0.01
921	301057	汇隆新材	1,300	21,372.00	0.01
922	002412	汉森制药	3,400	21,148.00	0.01
923	603596	伯特利	400	21,076.00	0.01
924	301168	通灵股份	600	20,946.00	0.01
925	001288	运机集团	1,000	20,830.00	0.01
926	600052	东望时代	4,500	20,700.00	0.01
927	688132	邦彦技术	1,000	20,300.00	0.01
928	300615	欣天科技	1,500	20,055.00	0.01
929	603992	松霖科技	900	19,674.00	0.01
930	002190	成飞集成	500	19,530.00	0.01
931	600537	亿晶光电	6,600	19,404.00	0.01
932	301458	钧崴电子	564	19,238.04	0.01
933	301000	肇民科技	400	19,056.00	0.01
934	600316	洪都航空	500	18,850.00	0.01
935	300737	科顺股份	3,900	18,798.00	0.01
936	002585	双星新材	3,400	18,564.00	0.01
937	600167	联美控股	3,300	18,546.00	0.01
938	002734	利民股份	1,000	18,300.00	0.01

939	300298	三诺生物	800	18,072.00	0.01
940	601866	中远海发	7,300	18,031.00	0.01
941	600897	厦门空港	1,200	17,508.00	0.01
942	600803	新奥股份	900	17,010.00	0.01
943	688583	思看科技	204	16,254.72	0.01
944	301602	超研股份	643	15,946.40	0.01
945	600819	耀皮玻璃	2,700	15,714.00	0.01
946	600406	国电南瑞	700	15,687.00	0.01
947	600613	神奇制药	2,400	15,504.00	0.01
948	301606	绿联科技	300	15,429.00	0.01
949	301296	新巨丰	1,600	15,376.00	0.01
950	600377	宁沪高速	1,000	15,340.00	0.01
951	603682	锦和商管	2,700	15,309.00	0.01
952	688563	航材股份	269	15,233.47	0.01
953	300639	凯普生物	2,600	15,080.00	0.01
954	688507	索辰科技	200	14,666.00	0.01
955	002915	中欣氟材	800	14,304.00	0.01
956	600298	安琪酵母	400	14,068.00	0.01
957	600829	人民同泰	1,900	13,946.00	0.01
958	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.01
959	600058	五矿发展	1,800	13,914.00	0.01
960	688757	胜科纳米	536	13,903.84	0.01
961	002790	瑞尔特	1,900	13,813.00	0.01
962	301555	惠柏新材	500	13,765.00	0.01
963	603856	东宏股份	1,200	13,740.00	0.01
964	688545	兴福电子	506	13,636.70	0.01
965	688108	赛诺医疗	1,200	13,464.00	0.01
966	001388	信通电子	812	13,333.04	0.01
967	601518	吉林高速	4,800	13,152.00	0.01
968	600547	山东黄金	400	12,772.00	0.01
969	600429	三元股份	2,800	12,628.00	0.01

970	600548	深高速	1,200	12,564.00	0.01
971	002120	韵达股份	1,800	12,060.00	0.01
972	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.01
973	688710	益诺思	332	11,566.88	0.01
974	600941	中国移动	100	11,255.00	0.01
975	301479	弘景光电	132	10,278.84	0.01
976	688522	纳睿雷达	200	10,244.00	0.01
977	301662	宏工科技	120	9,900.00	0.01
978	301678	新恒汇	218	9,709.72	0.01
979	603072	天和磁材	154	8,385.30	0.01
980	301275	汉朔科技	147	8,259.93	0.01
981	301658	首航新能	341	7,836.18	0.01
982	301665	泰禾股份	331	7,411.09	0.01
983	688755	汉邦科技	183	7,197.39	0.00
984	301578	辰奕智能	200	7,158.00	0.00
985	001382	新亚电缆	350	7,073.50	0.00
986	301173	毓恬冠佳	147	6,612.06	0.00
987	301501	恒鑫生活	141	6,376.02	0.00
988	001356	富岭股份	437	6,310.28	0.00
989	301595	太力科技	166	4,830.60	0.00
990	301560	众捷汽车	159	4,364.55	0.00
991	603004	鼎龙科技	195	4,268.55	0.00
992	301636	泽润新能	87	4,129.02	0.00
993	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
994	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
995	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
996	603271	永杰新材	69	2,420.52	0.00
997	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
998	001390	古麒绒材	125	2,265.00	0.00
999	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
100	603257	中国瑞林	58	2,173.26	0.00

0					
100 1	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
100 2	603409	汇通控股	62	2,065.84	0.00
100 3	603202	天有为	21	1,903.86	0.00
100 4	400237	天通5	118,400	-	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	601098	中南传媒	1,238,523.00	0.78
2	300476	胜宏科技	1,002,226.00	0.63
3	600663	陆家嘴	892,727.00	0.56
4	002414	高德红外	867,148.00	0.54
5	002926	华西证券	858,808.00	0.54
6	603228	景旺电子	837,388.00	0.53
7	603501	豪威集团	829,866.00	0.52
8	002463	沪电股份	828,082.00	0.52
9	601555	东吴证券	816,373.00	0.51
10	300803	指南针	808,059.00	0.51
11	603993	洛阳钼业	796,560.00	0.50
12	300001	特锐德	791,765.00	0.50
13	000807	云铝股份	777,354.00	0.49
14	600685	中船防务	769,458.00	0.48
15	688772	珠海冠宇	768,898.62	0.48
16	600299	安迪苏	765,235.00	0.48
17	002056	横店东磁	763,523.00	0.48

18	002648	卫星化学	757,928.00	0.48
19	002714	牧原股份	754,766.00	0.47
20	601918	新集能源	740,074.00	0.46

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	300476	胜宏科技	1,004,798.00	0.63
2	000725	京东方 A	983,106.00	0.62
3	300433	蓝思科技	956,143.00	0.60
4	603501	豪威集团	940,259.00	0.59
5	601098	中南传媒	904,489.00	0.57
6	600435	北方导航	902,695.00	0.57
7	002881	美格智能	897,083.00	0.56
8	002926	华西证券	892,911.00	0.56
9	688772	珠海冠宇	888,337.88	0.56
10	000039	中集集团	876,113.00	0.55
11	688183	生益电子	875,685.24	0.55
12	002128	电投能源	870,470.00	0.55
13	603893	瑞芯微	863,203.00	0.54
14	600968	海油发展	854,357.00	0.54
15	002414	高德红外	851,532.00	0.53
16	603228	景旺电子	834,960.00	0.52
17	000807	云铝股份	827,751.00	0.52
18	300866	安克创新	824,749.00	0.52
19	300002	神州泰岳	821,598.00	0.52
20	002273	水晶光电	820,773.00	0.52

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	395,066,453.43
卖出股票收入（成交）总额	418,898,761.76

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)	12,800.46	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,800.46	0.01

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	118057	甬矽转债	70	7,000.15	0.00
2	113695	华辰转债	40	4,000.19	0.00
3	123257	安克转债	18	1,800.12	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 报告期内本基金投资的前十名证券除中信证券（证券代码：600030）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2025年05月14日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因再融资项目申请过程中出具的核查意见与实际不符被上海证券交易所予以监管警示。

2024年12月20日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因经纪业务管理存在不足、客户开户信息采集登记不规范、部分账户的可疑交易预警核查及实名制核查不充分等被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2024年08月23日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的安达科技在上市当年即发生亏损被北京证券交易所出具警示函。

2024年08月05日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的贵州安达科技能源股份有限公司上市当年即亏损被中国证券监督管理委员会贵州监管局出具警示函并记入证券期货市场诚信档案。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和他析，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未发生改变。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

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	26,154.90
2	应收清算款	123,493.33
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,150.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	157,798.33

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

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

12,715	7,208.71	69,158,933.66	75.45%	22,499,773.38	24.55%
--------	----------	---------------	--------	---------------	--------

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,271,113.50	1.39%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年06月01日)基金份额总额	847,544,853.76
本报告期期初基金份额总额	109,344,442.46
本报告期基金总申购份额	10,435,889.16
减：本报告期基金总赎回份额	28,121,624.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	91,658,707.04

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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
恒泰证券	2	484,795,170.55	59.64%	90,122.16	59.63%	-
东莞证券	2	306,831,378.23	37.74%	57,042.02	37.75%	-
华金	2	21,298,481.57	2.62%	3,958.78	2.62%	-

证券						
渤海 证券	1	-	-	-	-	-
长江 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 海通 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-
信达 证券	1	-	-	-	-	-
长城 证券	2	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国投 证券	2	-	-	-	-	-
国信	2	-	-	-	-	-

证券						
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
甬兴 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、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。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：东莞证券。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：开源证券。

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
恒泰证券	115,550.42	98.58%	-	-	-	-	-	-
东莞证券	1,660.80	1.42%	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-31
2	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-09
3	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、上海证券报、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	2025/01/01-2025/02/20,2025/03/21-2025/06/30	25,890,564.55	-	6,800,000.00	19,090,564.55	20.83%
	2	2025/02/21-2025/06/30	21,267,015.44	-	-	21,267,015.44	23.20%
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泓信灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德泓信灵活配置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