

# 泓德智选领航混合型证券投资基金

## 2026 年中期报告

2026 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:中信证券股份有限公司

送出日期:2026 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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026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2026年1月1日起至2026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 .....              | 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） .....                      | 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 .....                               | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 41 |
| 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 .....                     | 59 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 61 |
| 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 .....      | 62 |
| 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 .....   | 62 |
| 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 .....   | 62 |
| 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 .....      | 62 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                     | 62 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....               | 62 |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                           | 63 |
| §8 基金份额持有人信息 .....                            | 63 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                   | 63 |

|                                          |    |
|------------------------------------------|----|
| 8.2 盈利投资者数量占比 .....                      | 64 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 64 |
| 8.4 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 .....   | 65 |
| §9 开放式基金份额变动 .....                       | 65 |
| §10 重大事件揭示 .....                         | 65 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 65 |
| 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 .....   | 66 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 66 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 66 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 66 |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 66 |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 66 |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 68 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 .....                 | 69 |
| 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 ..... | 69 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 69 |
| §12 备查文件目录 .....                         | 69 |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 69 |
| 12.2 存放地点 .....                          | 69 |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 69 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                 |                 |                |
|-----------------|-----------------|----------------|
| 基金名称            | 泓德智选领航混合型证券投资基金 |                |
| 基金简称            | 泓德智选领航混合        |                |
| 基金主代码           | 022224          |                |
| 基金运作方式          | 契约型开放式          |                |
| 基金合同生效日         | 2024年10月24日     |                |
| 基金管理人           | 泓德基金管理有限公司      |                |
| 基金托管人           | 中信证券股份有限公司      |                |
| 报告期末基金份额总额      | 48,773,094.48份  |                |
| 基金合同存续期         | 不定期             |                |
| 下属分级基金的基金简称     | 泓德智选领航混合A       | 泓德智选领航混合C      |
| 下属分级基金的交易代码     | 022224          | 022225         |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 31,247,380.61份  | 17,525,713.87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，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                                                                                                                    |
| 投资策略   | 本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，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配置策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、可交换债券配置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 | 沪深300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                             | 中信证券股份有限公司                          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 李娇                                     | 杨军智                                 |
|         | 联系电话 | 010-59850151                           | 010-60834299                        |
|         | 电子邮箱 | lijiao@hongdefund.com                  | yjz@citics.com                      |
| 客户服务电话  |      | 4009-100-888                           | 010-60836588                        |
| 传真      |      | 010-59850195                           | 010-60834004                        |
| 注册地址    |      | 西藏自治区拉萨市柳梧新区<br>北京大道柳梧城投大厦A-120<br>6-1 | 广东省深圳市福田区中心三<br>路8号卓越时代广场（二期）<br>北座 |
| 办公地址    |      | 北京市西城区德胜门外大街1<br>25号                   | 北京市朝阳区亮马桥路48号<br>中信证券大厦5层           |
| 邮政编码    |      | 100088                                 | 100125                              |
| 法定代表人   |      | 王德晓                                    | 张佑君                                 |

## 2.4 信息披露方式

|                   |                    |
|-------------------|--------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称    | 《证券日报》             |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.hongdefund.com |
| 基金中期报告置备地点        | 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<br>(2026年01月01日-2026年06月30日) |               |
|---------------|----------------------------------|---------------|
|               | 泓德智选领航混合<br>A                    | 泓德智选领航混合<br>C |
|               |                                  |               |
| 本期已实现收益       | 3,728,930.42                     | 2,155,449.33  |
| 本期利润          | 4,166,770.11                     | 2,550,301.64  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1134                           | 0.1207        |
| 本期加权平均净值利润率   | 8.97%                            | 9.60%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 9.47%                            | 9.25%         |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末<br>(2026年06月30日)            |               |
|               |                                  |               |
| 期末可供分配利润      | 9,984,929.20                     | 5,443,258.39  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.3195                           | 0.3106        |
| 期末基金资产净值      | 41,933,423.62                    | 23,360,011.50 |
| 期末基金份额净值      | 1.3420                           | 1.3329        |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末<br>(2026年06月30日)            |               |
|               |                                  |               |
| 基金份额累计净值增长率   | 34.20%                           | 33.29%        |

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

泓德智选领航混合A

| 阶段 | 份额净值 | 份额净值 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

|            | 增长率①   | 增长率标准差② | 基准收益率③ | 基准收益率标准差④ |        |        |
|------------|--------|---------|--------|-----------|--------|--------|
| 过去三个月      | 11.83% | 1.21%   | 10.76% | 1.13%     | 1.07%  | 0.08%  |
| 过去六个月      | 9.47%  | 1.09%   | 6.94%  | 1.02%     | 2.53%  | 0.07%  |
| 过去一年       | 26.75% | 0.94%   | 23.64% | 0.92%     | 3.11%  | 0.02%  |
| 自基金合同生效起至今 | 34.20% | 0.85%   | 22.96% | 0.93%     | 11.24% | -0.08% |

泓德智选领航混合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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 11.72%   | 1.21%       | 10.76%     | 1.13%         | 0.96%  | 0.08%  |
| 过去六个月      | 9.25%    | 1.09%       | 6.94%      | 1.02%         | 2.31%  | 0.07%  |
| 过去一年       | 26.23%   | 0.94%       | 23.64%     | 0.92%         | 2.59%  | 0.02%  |
| 自基金合同生效起至今 | 33.29%   | 0.85%       | 22.96%     | 0.93%         | 10.33% | -0.08% |

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：沪深300指数收益率×90%＋中国债券综合全价指数收益率×10%

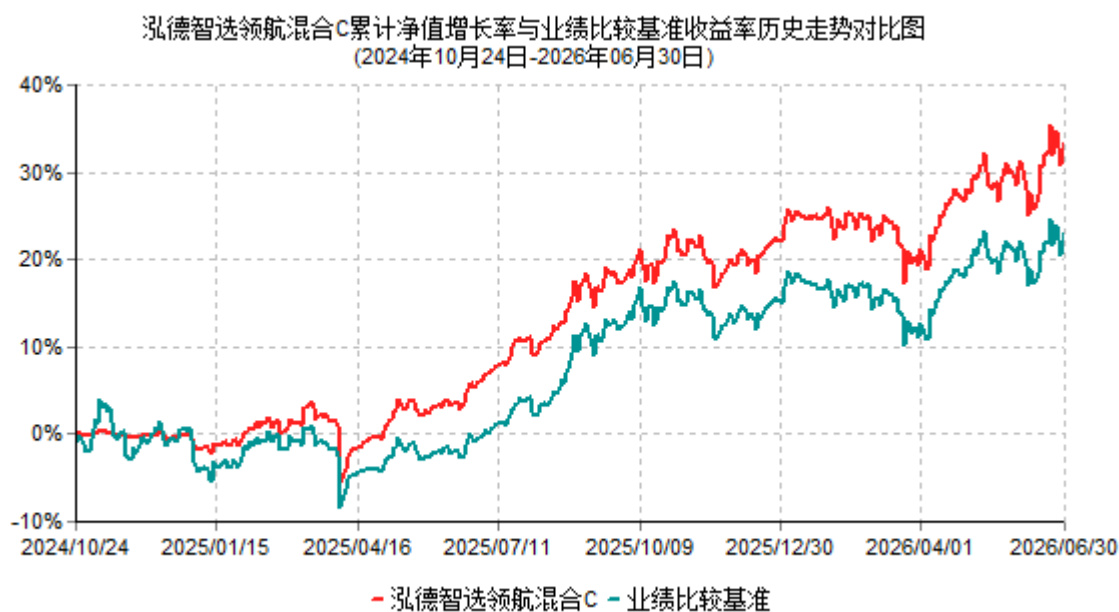
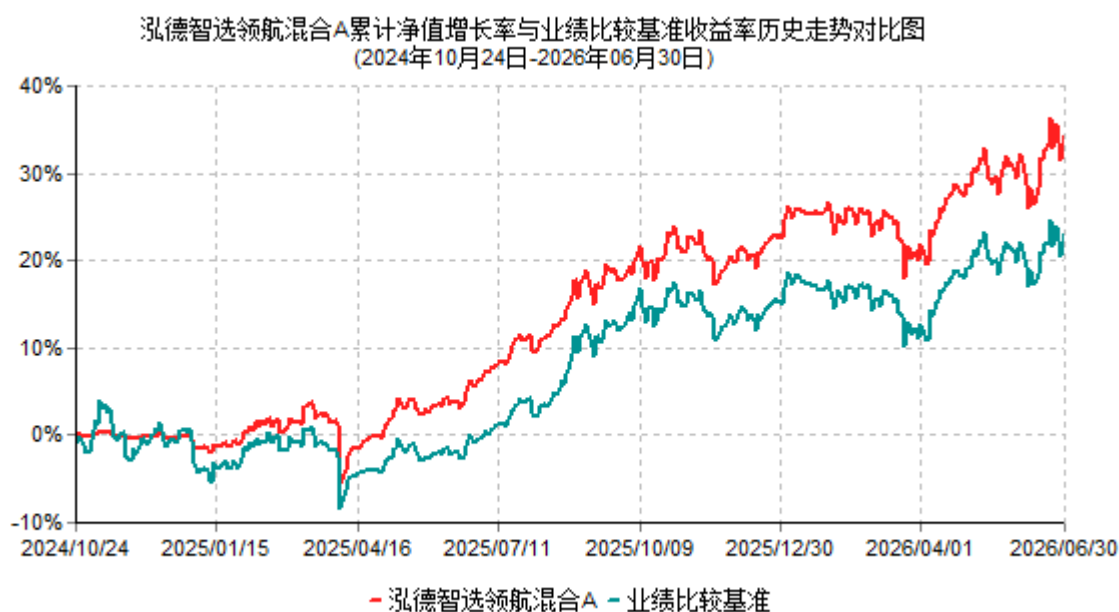
基准指数的构建原则如下：

（1）沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A 股市场总体发展趋势。

（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<br>经理（助理）<br>期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                  |
|-----|-----------------------|-------------------------|----------|----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                       | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |                                                                                                     |
| 李子昂 | 本基金的基金经理、<br>智能投资部副总监 | 2024-<br>10-24          | -        | 12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              | 2026-<br>03-05          | -        | 7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股主要指数呈现出上涨趋势，但个股出现较大分化，第二季度的科技行情带动了成长股的大幅上涨，同时红利、价值、现金流等风格被持续压制，成长价值的剪刀差被进一步放大。上半年，量化产品的整体超额波动较大，快速的风格切换和极致的一九行情给量化策略带来了较多困难，我们在策略上相对均衡，超额收益虽有波动，但整体中规中矩。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德智选领航混合A基金份额净值为1.3420元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.47%，同期业绩比较基准收益率为6.94%；截至报告期末泓德智选领航混合C基金份额净值为1.3329元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.25%，同期业绩比较基准收益率为6.94%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月以来，市场再次出现大幅反转，受Meta出售算力消息刺激和韩国市场大跌影响，电子、通信等热门板块出现显著回调，红利类资产触底反弹，同时也引发了市场对于AI泡沫和科技股牛市终结的讨论。从已实现的AI编程到未来的具身智能，AI技术依然在快速发展，当然技术的进步也不是一蹴而就的，二级市场受资金面和流动性影响总会产生或大或小的波动并呈现出一定的周期性，我们应该理性去看待这种波动。宏观方面，上半年GDP同比增长4.7%，符合全年GDP增长目标区间，但内需压力较大，二季度，投资大幅下滑，地产投资依旧拖累较大，消费明显回落，只有出口依旧保持韧性。与宏观经济总体平稳形成对比的是微观体感的差异，大家感受到的是居民就业的压力、收入的压力，企业订单的压力，但背后反映的是我国经济新旧动能的转换，以高端制造、数字经济、现代服务为代表的新动能对经济增长的贡献率超过了4成。聚焦在产品上，我们希望持续开发多元化的Alpha策略，努力适应较为多变的市场环境，力争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2026年06月30日，期末可供分配利润为15,428,187.59元，其中：泓德智选领航混合A期末可供分配利润为9,984,929.20元（泓德智选领航混合A的未分配利润已实现部分为9,984,929.20元，未分配利润未实现部分为701,113.81元），泓德智选领航混合C期末可供分配利润为5,443,258.39元（泓德智选领航混合C的未分配利润已实现部分为5,443,258.39元，未分配利润未实现部分为391,039.24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，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泓德智选领航混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 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

本报告期，由泓德基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关泓德智选领航混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：泓德智选领航混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

| 资 产          | 附注号     | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|--------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资 产：         |         |                    |                     |
| 货币资金         | 6.4.7.1 | 5,109,108.20       | 7,294,778.43        |
| 结算备付金        |         | -                  | -                   |
| 存出保证金        |         | -                  | -                   |
| 交易性金融资产      | 6.4.7.2 | 60,542,599.21      | 86,023,068.65       |
| 其中：股票投资      |         | 60,542,299.19      | 86,006,733.40       |
| 基金投资         |         | -                  | -                   |
| 债券投资         |         | 300.02             | 16,335.25           |
| 资产支持证券<br>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        |         | 676.87             | 487,619.62          |
| 递延所得税资产      |         | -                  | -                   |
| 其他资产         | 6.4.7.5 | -                  | -                   |
| 资产总计         |         | 65,652,384.28      | 93,805,466.70       |
| 负债和净资产       | 附注号     | 本期末<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025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     |         | 219,697.54    | 622,268.56    |
| 应付管理人报酬   |         | 63,752.89     | 113,278.64    |
| 应付托管费     |         | 7,969.13      | 14,159.83     |
| 应付销售服务费   |         | 7,653.11      | 13,744.85     |
| 应付投资顾问费   |         | -             | -             |
| 应交税费      |         | -             | -             |
| 应付利润      |         | -             | -             |
| 递延所得税负债   |         | -             | -             |
| 其他负债      | 6.4.7.6 | 59,876.49     | 172,680.59    |
| 负债合计      |         | 358,949.16    | 936,132.47    |
| 净资产：      |         |               |               |
| 实收基金      | 6.4.7.7 | 48,773,094.48 | 75,912,415.67 |
| 未分配利润     | 6.4.7.8 | 16,520,340.64 | 16,956,918.56 |
| 净资产合计     |         | 65,293,435.12 | 92,869,334.23 |
| 负债和净资产总计  |         | 65,652,384.28 | 93,805,466.70 |

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额48,773,094.48份，其中A类基金份额总额为31,247,380.61份，基金份额净值为1.3420元；C类基金份额总额为17,525,713.87份，基金份额净值为1.3329元。

6.2 利润表

会计主体：泓德智选领航混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026年01月01日至<br>2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至202<br>5年06月30日 |
|-----|-----|-----------------------------------|----------------------------------------|
|-----|-----|-----------------------------------|----------------------------------------|

|                       |          |              |               |
|-----------------------|----------|--------------|---------------|
| 一、营业总收入               |          | 7,323,069.82 | 19,743,708.65 |
| 1.利息收入                |          | 30,837.46    | 209,616.85    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.9  | 30,837.46    | 209,616.85    |
| 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）      |          | 6,417,358.87 | 12,017,550.46 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.10 | 5,780,359.01 | 9,245,105.90  |
| 基金投资收益                |          | -            | -             |
| 债券投资收益                | 6.4.7.11 | 8,678.49     | -             |
| 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 | 628,321.37   | 2,772,444.56  |
| 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 | 832,692.00   | 7,217,544.02  |
| 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 | 42,181.49    | 298,997.32    |
| 减：二、营业总支出             |          | 605,998.07   | 2,509,455.43  |
| 1.管理人报酬               |          | 435,925.58   | 1,809,021.28  |
| 2.托管费                 |          | 54,490.75    | 226,127.69    |
| 3.销售服务费               |          | 53,025.65    | 377,062.55    |
| 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             |          | -            | -             |
| 8.其他费用              | 6.4.7.16 | 62,556.09    | 97,243.91     |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 6,717,071.75 | 17,234,253.22 |
| 减：所得税费用             |          | -            | -             |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 6,717,071.75 | 17,234,253.22 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -            | -             |
| 六、综合收益总额            |          | 6,717,071.75 | 17,234,253.22 |

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选领航混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

| 项 目                  | 本期                      |               |                |
|----------------------|-------------------------|---------------|----------------|
|                      | 2026年01月01日至2026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            | 75,912,415.67           | 16,956,918.56 | 92,869,334.23  |
| 二、本期期初净资产            | 75,912,415.67           | 16,956,918.56 | 92,869,334.23  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -27,139,321.19          | -436,577.92   | -27,575,899.11 |
| （一）、综合收益总额           | -                       | 6,717,071.75  | 6,717,071.75   |
| （二）、本期基金             | -27,139,321.19          | -7,153,649.67 | -34,292,970.86 |

|                                          |                                    |               |                 |
|------------------------------------------|------------------------------------|---------------|-----------------|
| 份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）              |                                    |               |                 |
| 其中：1.基金申购款                               | 8,557,739.99                       | 2,156,077.73  | 10,713,817.72   |
| 2.基金赎回款                                  | -35,697,061.18                     | -9,309,727.40 | -45,006,788.58  |
| （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                                | 48,773,094.48                      | 16,520,340.64 | 65,293,435.12   |
| 项 目                                      | 上年度可比期间<br>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                                | 572,717,030.74                     | -2,214,837.82 | 570,502,192.92  |
| 二、本期期初净资产                                | 572,717,030.74                     | -2,214,837.82 | 570,502,192.92  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -409,138,172.35                    | 11,628,937.87 | -397,509,234.48 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                  | 17,234,253.22 | 17,234,253.22   |
| （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）      | -409,138,172.35                    | -5,605,315.35 | -414,743,487.70 |
| 其中：1.基金申购款                               | 72,340,530.54                      | 944,668.26    | 73,285,198.80   |
| 2.基金赎回                                   | -481,478,702.89                    | -6,549,983.61 | -488,028,686.50 |

|                                          |                |              |                |
|------------------------------------------|----------------|--------------|----------------|
| 款                                        |                |              |                |
| （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                                | 163,578,858.39 | 9,414,100.05 | 172,992,958.44 |

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

泓德智选领航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[2024]1254号《关于准予泓德智选领航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《泓德智选领航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572,560,608.11元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2024）验字第80014975\_A01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德智选领航混合型证券投资基金基金合同》于2024年10月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为572,717,030.74份，其中认购资金利息折合156,422.63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，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《泓德智选领航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、销售服务费等收取方式的不同，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《泓德智选领航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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资于其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。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：沪深300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”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集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>》《证券投资基金会计核算业务指引》《泓德智选领航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2026年1月1日至2026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2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026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[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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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<br>2026年06月30日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 3,639,736.57       |
| 等于：本金        | 3,638,289.12       |
| 加：应计利息       | 1,447.45           |
| 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         | 1,469,371.63       |
| 等于：本金        | 1,469,223.56       |
| 加：应计利息       | 148.07             |
| 减：坏账准备       | -                  |
| 合计           | 5,109,108.20       |

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<br>2026年06月30日 |      |               |              |
|---------------|--------------------|------|---------------|--------------|
|               | 成本                 | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动       |
| 股票            | 53,635,063.75      | -    | 60,542,299.19 | 6,907,235.44 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -    | -             | -            |

|        |       |               |      |               |              |
|--------|-------|---------------|------|---------------|--------------|
| 债券     | 交易所市场 | 300.00        | 0.02 | 300.02        | -            |
|        | 银行间市场 | -             | -    | -             | -            |
|        | 合计    | 300.00        | 0.02 | 300.02        | -            |
| 资产支持证券 |       | -             | -    | -             | -            |
| 基金     |       | -             | -    | -             | -            |
| 其他     |       | -             | -    | -             | -            |
| 合计     |       | 53,635,363.75 | 0.02 | 60,542,599.21 | 6,907,235.44 |

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<br>2026年06月30日 |
|-------------|--------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  |
| 应付赎回费       | 25.60              |
| 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  | 58,056.09 |
| 其他应付款 | 1,794.80  |
| 合计    | 59,876.49 |

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德智选领航混合A

金额单位：人民币元

| 项目<br>(泓德智选领航混合A) | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                |
|-------------------|-------------------------------|----------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末              | 42,891,293.49                 | 42,891,293.49  |
| 本期申购              | 6,083,339.65                  | 6,083,339.65   |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -17,727,252.53                | -17,727,252.53 |
| 本期末               | 31,247,380.61                 | 31,247,380.61  |

6.4.7.7.2 泓德智选领航混合C

金额单位：人民币元

| 项目<br>(泓德智选领航混合C) | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |                |
|-------------------|-------------------------------|----------------|
|                   | 基金份额（份）                       | 账面金额           |
| 上年度末              | 33,021,122.18                 | 33,021,122.18  |
| 本期申购              | 2,474,400.34                  | 2,474,400.34   |
| 本期赎回（以“-”号填列）     | -17,969,808.65                | -17,969,808.65 |
| 本期末               | 17,525,713.87                 | 17,525,713.87  |

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 泓德智选领航混合A

单位：人民币元

| 项目<br>(泓德智选领航混合A) | 已实现部分        | 未实现部分      | 未分配利润合计      |
|-------------------|--------------|------------|--------------|
| 上年度末              | 9,473,769.71 | 216,488.20 | 9,690,257.91 |

|                |               |            |               |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 本期期初           | 9,473,769.71  | 216,488.20 | 9,690,257.91  |
| 本期利润           | 3,728,930.42  | 437,839.69 | 4,166,770.11  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,217,770.93 | 46,785.92  | -3,170,985.01 |
| 其中：基金申购款       | 1,628,190.03  | -98,064.94 | 1,530,125.09  |
| 基金赎回款          | -4,845,960.96 | 144,850.86 | -4,701,110.10 |
| 本期已分配利润        | -             | -          | -             |
| 本期末            | 9,984,929.20  | 701,113.81 | 10,686,043.01 |

6.4.7.8.2 泓德智选领航混合C

单位：人民币元

| 项目<br>(泓德智选领航混合C) | 已实现部分         | 未实现部分       | 未分配利润合计       |
|-------------------|---------------|-------------|---------------|
| 上年度末              | 7,098,687.92  | 167,972.73  | 7,266,660.65  |
| 本期期初              | 7,098,687.92  | 167,972.73  | 7,266,660.65  |
| 本期利润              | 2,155,449.33  | 394,852.31  | 2,550,301.64  |
| 本期基金份额交易产生的变动数    | -3,810,878.86 | -171,785.80 | -3,982,664.66 |
| 其中：基金申购款          | 664,537.84    | -38,585.20  | 625,952.64    |
| 基金赎回款             | -4,475,416.70 | -133,200.60 | -4,608,617.30 |
| 本期已分配利润           | -             | -           | -             |
| 本期末               | 5,443,258.39  | 391,039.24  | 5,834,297.63  |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 27,763.00                     |
| 定期存款利息收入  | -                             |
| 其他存款利息收入  | 3,074.46                      |
| 结算备付金利息收入 | -                             |
| 其他        | -                             |

|    |           |
|----|-----------|
| 合计 | 30,837.46 |
|----|-----------|

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 172,852,950.34                |
| 减：卖出股票成本总额 | 166,829,476.52                |
| 减：交易费用     | 243,114.81                    |
| 买卖股票差价收入   | 5,780,359.01                  |

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------------------------|-------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 5.90                          |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 8,672.59                      |
| 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                           | 8,678.49                      |

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|----------------------|-------------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 24,081.05                     |

|                        |           |
|------------------------|-----------|
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 15,400.00 |
| 减：应计利息总额               | 7.51      |
| 减：交易费用                 | 0.95      |
| 买卖债券差价收入               | 8,672.59  |

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---------------|-------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 628,321.37                    |
| 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            | 628,321.37                    |

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 1.交易性金融资产  | 832,692.00                    |
| ——股票投资     | 833,625.62                    |
| ——债券投资     | -933.62                       |
| ——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                     | 832,692.00 |

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 42,177.53                     |
| 基金转换费收入 | 3.96                          |
| 合计      | 42,181.49                     |

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |
|---------|-------------------------------|
| 审计费用    | 13,884.51                     |
| 信息披露费   | 39,671.58                     |
| 证券出借违约金 | -                             |
| 账户维护费   | 9,000.00                      |
| 合计      | 62,556.09                     |

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、关联关系

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 |
| 中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”） | 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                      |              | 上年度可比期间                 |              |
|-------|-------------------------|--------------|-------------------------|--------------|
|       | 2026年01月01日至2026年06月30日 |              | 2025年01月01日至2025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 |
| 中信证券  | -                       | -            | 1,207,490.00            | 0.10%        |

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

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 | 本期 |
|------|----|
|------|----|

| 称     | 2026年01月01日至2026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 |
| 中信证券  | -                                  | -          | -        | -            |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>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 |
| 中信证券  | 526.32                             | 0.10%      | -        | -            |

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 435,925.58                    | 1,809,021.28                       |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 118,505.80                    | 795,754.51                         |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 317,419.78                    | 1,013,266.77                       |

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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                | 2026年01月01日至2026年06月30日 | 2025年01月01日至2025年06月30日 |
|----------------|-------------------------|-------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 54,490.75               | 226,127.69              |

注：支付基金托管人中信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                      |           |           |
|----------------|-------------------------|-----------|-----------|
|                | 2026年01月01日至2026年06月30日 |           |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费        |           |           |
|                | 泓德智选领航混合A               | 泓德智选领航混合C | 合计        |
| 泓德基金           | 0.00                    | 1,001.11  | 1,001.11  |
| 中信证券           | 0.00                    | 3,597.35  | 3,597.35  |
| 合计             | 0.00                    | 4,598.46  | 4,598.46  |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                 |           |           |
|                | 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        |           |           |
|                | 泓德智选领航混合A               | 泓德智选领航混合C | 合计        |
| 泓德基金           | 0.00                    | 9,671.67  | 9,671.67  |
| 中信证券           | 0.00                    | 21,327.95 | 21,327.95 |
| 合计             | 0.00                    | 30,999.62 | 30,999.62 |

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

无。

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

无。

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<br>2026年01月01日至2026年06月30日 |           | 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025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     |
| 中信证券-托管户 | 3,639,736.57                  | 27,763.00 | 8,818,699.98                       | 130,514.11 |
| 中信证券-证券户 | 15,595.11                     | 23.35     | 1,115,443.89                       | 4,439.86   |

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人中信证券存放在兴业银行北京分行营业部，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中信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

金额单位：人民币元

| 本期<br>2026年01月01日至2026年06月30日      |        |      |         |            |           |
|------------------------------------|--------|------|---------|------------|-----------|
| 关联方名称                              | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式    | 基金在承销期内买入  |           |
|                                    |        |      |         | 数量（单位：张/股） | 总金额       |
| 中信证券股份有限公司                         | 123273 | 三江转债 | 原股东优先配售 | 3          | 300.00    |
| 中信证券股份有限公司                         | 688785 | 恒运昌  | 公开发行    | 231        | 21,293.58 |
| 上年度可比期间<br>2025年01月01日至2025年06月30日 |        |      |         |            |           |

| 关联方名称      | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入  |           |
|------------|--------|------|------|------------|-----------|
|            |        |      |      | 数量（单位：张/股） | 总金额       |
| 中信证券股份有限公司 | 603124 | 江南新材 | 公开发行 | 879        | 9,264.66  |
| 中信证券股份有限公司 | 603257 | 中国瑞林 | 公开发行 | 780        | 16,005.60 |
| 中信证券股份有限公司 | 301662 | 宏工科技 | 公开发行 | 1,429      | 38,011.40 |
| 中信证券股份有限公司 | 688755 | 汉邦科技 | 公开发行 | 2,023      | 46,063.71 |

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期内，本基金无其他关联交易事项。（上年度可比期间，本基金参与了中信建投证券股份有限公司（基金托管人中信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）承销期内承销的黑龙江天有为电子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（2026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 |
| 688785               | 恒运   | 2026-01-20 | 6个  | 限售     | 92.18 | 463.15 | 24       | 2,212.32 | 11,115.60 | -  |

|                      |      |            |        |        |        |        |          |        |          |    |
|----------------------|------|------------|--------|--------|--------|--------|----------|--------|----------|----|
|                      | 昌    |            | 月以上    | 股      |        |        |          |        |          |    |
| 601112               | 振石股份 | 2026-01-21 | 6个月以上  | 限售股    | 11.18  | 17.59  | 88       | 983.84 | 1,547.92 | -  |
| 603352               | 至信股份 | 2026-01-08 | 6个月以上  | 限售股    | 21.88  | 25.52  | 34       | 743.92 | 867.68   | -  |
| 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 |
| 123273               | 三江转债 | 2026-06-17 | 11个交易日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.01 | 3        | 300.00 | 300.02   | -  |

注：基金可使用以基金名义开设的股票/债券账户，选择网上或者网下一种方式进行新股/新债申购。基金参与申购获配的新股/新债，从新股/新债获配日至新股/新债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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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0.00%(上年度末：0.02%)。

#### 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<br>2026年<br>06月30 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|------|------|------|-----|----|

|                     |              |      |        |               |               |
|---------------------|--------------|------|--------|---------------|---------------|
| 日                   |              |      |        |               |               |
| 资产                  |              |      |        |               |               |
| 货币资金                | 5,109,108.20 | -    | -      | -             | 5,109,108.20  |
| 交易性金融资产             | -            | -    | 300.02 | 60,542,299.19 | 60,542,599.21 |
| 应收申购款               | -            | -    | -      | 676.87        | 676.87        |
| 资产总计                | 5,109,108.20 | -    | 300.02 | 60,542,976.06 | 65,652,384.28 |
| 负债                  |              |      |        |               |               |
| 应付赎回款               | -            | -    | -      | 219,697.54    | 219,697.54    |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -      | 63,752.89     | 63,752.89     |
| 应付托管费               | -            | -    | -      | 7,969.13      | 7,969.13      |
| 应付销售服务费             | -            | -    | -      | 7,653.11      | 7,653.11      |
| 其他负债                | -            | -    | -      | 59,876.49     | 59,876.49     |
| 负债总计                | -            | -    | -      | 358,949.16    | 358,949.16    |
| 利率敏感度缺口             | 5,109,108.20 | -    | 300.02 | 60,184,026.90 | 65,293,435.12 |
| 上年度末<br>2025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                 | 7,294,778.43 | -    | -      | -             | 7,294,778.43  |

|         |              |   |           |               |               |
|---------|--------------|---|-----------|---------------|---------------|
| 金       |              |   |           |               |               |
| 交易性金融资产 | -            | - | 16,335.25 | 86,006,733.40 | 86,023,068.65 |
| 应收申购款   | -            | - | -         | 487,619.62    | 487,619.62    |
| 资产总计    | 7,294,778.43 | - | 16,335.25 | 86,494,353.02 | 93,805,466.70 |
| 负债      |              |   |           |               |               |
| 应付赎回款   | -            | - | -         | 622,268.56    | 622,268.56    |
| 应付管理人报酬 | -            | - | -         | 113,278.64    | 113,278.64    |
| 应付托管费   | -            | - | -         | 14,159.83     | 14,159.83     |
| 应付销售服务费 | -            | - | -         | 13,744.85     | 13,744.85     |
| 其他负债    | -            | - | -         | 172,680.59    | 172,680.59    |
| 负债总计    | -            | - | -         | 936,132.47    | 936,132.47    |
| 利率敏感度缺口 | 7,294,778.43 | - | 16,335.25 | 85,558,220.55 | 92,869,334.23 |

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（不包括可转债和可交换债）公允价值占基金资产净值的比例为0%(上年度末：0%)，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<br>2026年06月30日 |                          | 上年度末<br>2025年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 60,542,299.19      | 92.72                    | 86,006,733.40       | 92.61                    |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                  | -                        | -                   | -                        |
| 交易性金融资产—债券投资  | 300.02             | -                        | 16,335.25           | 0.02                     |
| 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            | 60,542,599.21      | 92.72                    | 86,023,068.65       | 92.63                    |

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<br>(单位：人民币元) |                     |
|----|------------|---------------------------------|---------------------|
|    |            | 本期末<br>2026年06月30日              | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升5% | 3,463,655.07                    | 4,196,478.86        |
|    | 业绩比较基准下降5% | -3,463,655.07                   | -4,196,478.86       |

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<br>2026年06月30日 | 上年度末<br>2025年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| 第一层次          | 60,528,767.99      | 85,696,965.90       |
| 第二层次          | 300.02             | 178,256.29          |
| 第三层次          | 13,531.20          | 147,846.46          |
| 合计            | 60,542,599.21      | 86,023,068.65       |

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              | 60,542,299.19 | 92.22        |
|    | 其中：股票             | 60,542,299.19 | 92.22        |
| 2  | 基金投资              | -             | -            |
| 3  | 固定收益投资            | 300.02        | 0.00         |
|    | 其中：债券             | 300.02        | 0.00         |
|    | 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      | 5,109,108.20  | 7.78         |
| 8  | 其他各项资产            | 676.87        | 0.00         |
| 9  | 合计                | 65,652,384.28 | 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         | 180,153.00    | 0.28  |
| B | 采矿业              | 2,955,388.00  | 4.53  |
| C | 制造业              | 39,736,018.99 | 60.86 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,145,900.00  | 1.76  |
| E | 建筑业              | 298,982.00    | 0.46  |
| F | 批发和零售业           | 636,722.00    | 0.98  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,255,510.00  | 1.92  |
| H | 住宿和餐饮业           | 23,387.00     | 0.04  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 2,945,423.20  | 4.51  |
| J | 金融业              | 9,368,990.80  | 14.35 |
| K | 房地产业             | 103,191.00    | 0.16  |
| L | 租赁和商务服务业         | 402,412.00    | 0.62  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 1,368,693.00  | 2.10  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 53,721.20     | 0.08  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | -             | -     |
| Q | 卫生和社会工作          | 35,618.00     | 0.05  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 28,831.00     | 0.04  |
| S | 综合               | 3,358.00      | 0.01  |
|   | 合计               | 60,542,299.19 | 92.72 |

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  | 300308 | 中际旭创 | 3,000 | 3,810,000.00 | 5.84         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 5,300 | 2,082,953.00 | 3.19         |
| 3  | 300502 | 新易盛  | 3,304 | 2,005,528.00 | 3.07         |
| 4  | 603986 | 兆易创新 | 2,000 | 1,630,000.00 | 2.50         |
| 5  | 688256 | 寒武纪  | 996   | 1,589,167.80 | 2.43         |

|    |        |       |        |              |      |
|----|--------|-------|--------|--------------|------|
| 6  | 601899 | 紫金矿业  | 51,000 | 1,282,140.00 | 1.96 |
| 7  | 600519 | 贵州茅台  | 1,000  | 1,185,490.00 | 1.82 |
| 8  | 603259 | 药明康德  | 8,400  | 1,045,884.00 | 1.60 |
| 9  | 688012 | 中微公司  | 1,988  | 931,378.00   | 1.43 |
| 10 | 601318 | 中国平安  | 19,300 | 921,382.00   | 1.41 |
| 11 | 002384 | 东山精密  | 3,400  | 891,990.00   | 1.37 |
| 12 | 002475 | 立讯精密  | 11,200 | 788,480.00   | 1.21 |
| 13 | 600036 | 招商银行  | 22,100 | 784,550.00   | 1.20 |
| 14 | 601138 | 工业富联  | 10,800 | 779,220.00   | 1.19 |
| 15 | 688041 | 海光信息  | 2,000  | 740,600.00   | 1.13 |
| 16 | 600183 | 生益科技  | 4,100  | 710,940.00   | 1.09 |
| 17 | 300408 | 三环集团  | 4,200  | 700,980.00   | 1.07 |
| 18 | 002371 | 北方华创  | 725    | 641,306.00   | 0.98 |
| 19 | 300059 | 东方财富  | 31,400 | 639,932.00   | 0.98 |
| 20 | 000333 | 美的集团  | 7,800  | 589,134.00   | 0.90 |
| 21 | 601398 | 工商银行  | 82,000 | 579,740.00   | 0.89 |
| 22 | 600150 | 中国船舶  | 17,000 | 574,430.00   | 0.88 |
| 23 | 600900 | 长江电力  | 21,300 | 563,811.00   | 0.86 |
| 24 | 002463 | 沪电股份  | 3,600  | 550,080.00   | 0.84 |
| 25 | 600176 | 中国巨石  | 7,400  | 539,312.00   | 0.83 |
| 26 | 688008 | 澜起科技  | 1,707  | 528,999.30   | 0.81 |
| 27 | 688981 | 中芯国际  | 3,052  | 484,718.64   | 0.74 |
| 28 | 600919 | 江苏银行  | 44,100 | 475,398.00   | 0.73 |
| 29 | 600522 | 中天科技  | 7,800  | 473,304.00   | 0.72 |
| 30 | 002415 | 海康威视  | 13,800 | 471,960.00   | 0.72 |
| 31 | 601166 | 兴业银行  | 27,500 | 455,400.00   | 0.70 |
| 32 | 300476 | 胜宏科技  | 1,300  | 450,359.00   | 0.69 |
| 33 | 000725 | 京东方 A | 49,100 | 426,188.00   | 0.65 |
| 34 | 000338 | 潍柴动力  | 15,400 | 419,650.00   | 0.64 |
| 35 | 600887 | 伊利股份  | 17,400 | 416,904.00   | 0.64 |
| 36 | 600999 | 招商证券  | 19,300 | 407,230.00   | 0.62 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 37 | 000792 | 盐湖股份 | 13,200 | 398,508.00 | 0.61 |
| 38 | 601688 | 华泰证券 | 18,400 | 379,408.00 | 0.58 |
| 39 | 000776 | 广发证券 | 16,200 | 379,080.00 | 0.58 |
| 40 | 601288 | 农业银行 | 60,000 | 364,200.00 | 0.56 |
| 41 | 000001 | 平安银行 | 35,700 | 358,785.00 | 0.55 |
| 42 | 601211 | 国泰海通 | 19,414 | 353,334.80 | 0.54 |
| 43 | 301308 | 江波龙  | 500    | 351,900.00 | 0.54 |
| 44 | 600276 | 恒瑞医药 | 6,700  | 348,668.00 | 0.53 |
| 45 | 300274 | 阳光电源 | 2,100  | 333,942.00 | 0.51 |
| 46 | 002142 | 宁波银行 | 10,900 | 323,621.00 | 0.50 |
| 47 | 300014 | 亿纬锂能 | 4,700  | 305,641.00 | 0.47 |
| 48 | 000408 | 藏格矿业 | 4,400  | 305,008.00 | 0.47 |
| 49 | 601601 | 中国太保 | 10,500 | 299,460.00 | 0.46 |
| 50 | 300394 | 天孚通信 | 980    | 296,626.40 | 0.45 |
| 51 | 603993 | 洛阳钼业 | 15,600 | 273,780.00 | 0.42 |
| 52 | 000807 | 云铝股份 | 11,800 | 261,252.00 | 0.40 |
| 53 | 601328 | 交通银行 | 40,100 | 257,843.00 | 0.39 |
| 54 | 605117 | 德业股份 | 2,420  | 256,955.60 | 0.39 |
| 55 | 601995 | 中金公司 | 7,100  | 256,665.00 | 0.39 |
| 56 | 601872 | 招商轮船 | 14,600 | 256,522.00 | 0.39 |
| 57 | 600233 | 圆通速递 | 16,100 | 253,575.00 | 0.39 |
| 58 | 601939 | 建设银行 | 26,100 | 251,343.00 | 0.38 |
| 59 | 000651 | 格力电器 | 6,700  | 251,250.00 | 0.38 |
| 60 | 000938 | 紫光股份 | 8,100  | 233,766.00 | 0.36 |
| 61 | 600309 | 万华化学 | 3,400  | 232,594.00 | 0.36 |
| 62 | 002709 | 天赐材料 | 4,400  | 226,292.00 | 0.35 |
| 63 | 601009 | 南京银行 | 22,300 | 220,547.00 | 0.34 |
| 64 | 002493 | 荣盛石化 | 20,500 | 220,375.00 | 0.34 |
| 65 | 600026 | 中远海能 | 12,200 | 218,868.00 | 0.34 |
| 66 | 688111 | 金山办公 | 1,000  | 213,050.00 | 0.33 |
| 67 | 601988 | 中国银行 | 36,300 | 207,636.00 | 0.32 |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 68 | 603799 | 华友钴业  | 4,200  | 202,692.00 | 0.31 |
| 69 | 002466 | 天齐锂业  | 3,300  | 202,356.00 | 0.31 |
| 70 | 600346 | 恒力石化  | 11,300 | 200,123.00 | 0.31 |
| 71 | 688396 | 华润微   | 2,000  | 195,100.00 | 0.30 |
| 72 | 000100 | TCL科技 | 33,100 | 192,642.00 | 0.30 |
| 73 | 601066 | 中信建投  | 6,600  | 191,862.00 | 0.29 |
| 74 | 601857 | 中国石油  | 21,900 | 190,092.00 | 0.29 |
| 75 | 002027 | 分众传媒  | 38,900 | 188,276.00 | 0.29 |
| 76 | 000858 | 五 粮 液 | 2,500  | 185,000.00 | 0.28 |
| 77 | 600028 | 中国石化  | 40,200 | 179,292.00 | 0.27 |
| 78 | 300124 | 汇川技术  | 2,700  | 179,091.00 | 0.27 |
| 79 | 300857 | 协创数据  | 520    | 176,748.00 | 0.27 |
| 80 | 600489 | 中金黄金  | 9,600  | 173,280.00 | 0.27 |
| 81 | 002558 | 巨人网络  | 6,200  | 170,872.00 | 0.26 |
| 82 | 002594 | 比亚迪   | 2,100  | 167,370.00 | 0.26 |
| 83 | 600584 | 长电科技  | 1,600  | 165,680.00 | 0.25 |
| 84 | 600989 | 宝丰能源  | 8,100  | 164,673.00 | 0.25 |
| 85 | 002532 | 天山铝业  | 14,800 | 158,804.00 | 0.24 |
| 86 | 000975 | 山金国际  | 9,300  | 158,100.00 | 0.24 |
| 87 | 688002 | 睿创微纳  | 1,000  | 154,690.00 | 0.24 |
| 88 | 600031 | 三一重工  | 8,900  | 153,792.00 | 0.24 |
| 89 | 300475 | 香农芯创  | 500    | 150,000.00 | 0.23 |
| 90 | 688521 | 芯原股份  | 400    | 148,456.00 | 0.23 |
| 91 | 600000 | 浦发银行  | 16,700 | 143,787.00 | 0.22 |
| 92 | 300033 | 同花顺   | 580    | 139,780.00 | 0.21 |
| 93 | 603600 | 永艺股份  | 15,600 | 138,372.00 | 0.21 |
| 94 | 002916 | 深南电路  | 300    | 137,370.00 | 0.21 |
| 95 | 601600 | 中国铝业  | 16,500 | 135,630.00 | 0.21 |
| 96 | 601061 | 中信金属  | 12,400 | 133,548.00 | 0.20 |
| 97 | 688183 | 生益电子  | 1,000  | 132,400.00 | 0.20 |
| 98 | 600482 | 中国动力  | 4,000  | 131,200.00 | 0.20 |

|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 99  | 600938 | 中国海油 | 4,800  | 130,320.00 | 0.20 |
| 100 | 600547 | 山东黄金 | 5,600  | 129,304.00 | 0.20 |
| 101 | 603019 | 中科曙光 | 1,200  | 128,676.00 | 0.20 |
| 102 | 601127 | 赛力斯  | 2,100  | 128,625.00 | 0.20 |
| 103 | 002028 | 思源电气 | 700    | 121,100.00 | 0.19 |
| 104 | 605138 | 盛泰集团 | 21,500 | 118,680.00 | 0.18 |
| 105 | 000538 | 云南白药 | 2,400  | 113,688.00 | 0.17 |
| 106 | 600019 | 宝钢股份 | 20,400 | 110,772.00 | 0.17 |
| 107 | 000988 | 华工科技 | 600    | 110,766.00 | 0.17 |
| 108 | 603706 | 东方环宇 | 6,400  | 110,656.00 | 0.17 |
| 109 | 601088 | 中国神华 | 2,800  | 109,312.00 | 0.17 |
| 110 | 603288 | 海天味业 | 3,200  | 106,112.00 | 0.16 |
| 111 | 000657 | 中钨高新 | 1,100  | 105,292.00 | 0.16 |
| 112 | 300590 | 移为通信 | 7,200  | 103,320.00 | 0.16 |
| 113 | 301536 | 星宸科技 | 800    | 102,968.00 | 0.16 |
| 114 | 301329 | 信音电子 | 4,100  | 99,589.00  | 0.15 |
| 115 | 300789 | 唐源电气 | 5,600  | 99,512.00  | 0.15 |
| 116 | 688525 | 佰维存储 | 200    | 98,946.00  | 0.15 |
| 117 | 603390 | 通达电气 | 9,400  | 98,136.00  | 0.15 |
| 118 | 603317 | 天味食品 | 7,500  | 97,575.00  | 0.15 |
| 119 | 601985 | 中国核电 | 10,800 | 97,524.00  | 0.15 |
| 120 | 300511 | 雪榕生物 | 19,200 | 96,576.00  | 0.15 |
| 121 | 688633 | 星球石墨 | 3,243  | 96,414.39  | 0.15 |
| 122 | 600506 | 统一股份 | 6,920  | 96,118.80  | 0.15 |
| 123 | 600111 | 北方稀土 | 2,000  | 96,100.00  | 0.15 |
| 124 | 002938 | 鹏鼎控股 | 900    | 94,842.00  | 0.15 |
| 125 | 600941 | 中国移动 | 1,100  | 94,743.00  | 0.15 |
| 126 | 603296 | 华勤技术 | 1,260  | 93,580.20  | 0.14 |
| 127 | 600875 | 东方电气 | 3,200  | 92,064.00  | 0.14 |
| 128 | 002648 | 卫星化学 | 3,900  | 91,611.00  | 0.14 |
| 129 | 000301 | 东方盛虹 | 8,000  | 91,600.00  | 0.14 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 130 | 002379 | 宏桥控股 | 6,200  | 91,574.00 | 0.14 |
| 131 | 601888 | 中国中免 | 1,700  | 91,307.00 | 0.14 |
| 132 | 000933 | 神火股份 | 4,300  | 91,160.00 | 0.14 |
| 133 | 600066 | 宇通客车 | 3,400  | 91,154.00 | 0.14 |
| 134 | 000421 | 南京公用 | 18,100 | 89,776.00 | 0.14 |
| 135 | 601225 | 陕西煤业 | 4,300  | 87,505.00 | 0.13 |
| 136 | 300681 | 英搏尔  | 3,000  | 85,860.00 | 0.13 |
| 137 | 000703 | 恒逸石化 | 6,300  | 85,491.00 | 0.13 |
| 138 | 300760 | 迈瑞医疗 | 600    | 81,498.00 | 0.12 |
| 139 | 300628 | 亿联网络 | 2,400  | 81,168.00 | 0.12 |
| 140 | 600104 | 上汽集团 | 8,300  | 81,008.00 | 0.12 |
| 141 | 600089 | 特变电工 | 3,600  | 81,000.00 | 0.12 |
| 142 | 688059 | 华锐精密 | 400    | 79,884.00 | 0.12 |
| 143 | 601916 | 浙商银行 | 30,300 | 79,689.00 | 0.12 |
| 144 | 300824 | 北鼎股份 | 10,800 | 77,544.00 | 0.12 |
| 145 | 600893 | 航发动力 | 2,000  | 76,680.00 | 0.12 |
| 146 | 000425 | 徐工机械 | 9,300  | 75,237.00 | 0.12 |
| 147 | 300223 | 北京君正 | 300    | 74,670.00 | 0.11 |
| 148 | 300404 | 博济医药 | 8,500  | 74,460.00 | 0.11 |
| 149 | 600251 | 冠农股份 | 8,600  | 74,304.00 | 0.11 |
| 150 | 600115 | 中国东航 | 19,000 | 72,390.00 | 0.11 |
| 151 | 603719 | 良品铺子 | 8,300  | 71,795.00 | 0.11 |
| 152 | 688472 | 阿特斯  | 6,600  | 71,412.00 | 0.11 |
| 153 | 601077 | 渝农商行 | 11,600 | 70,876.00 | 0.11 |
| 154 | 600741 | 华域汽车 | 4,500  | 69,840.00 | 0.11 |
| 155 | 003816 | 中国广核 | 17,700 | 69,207.00 | 0.11 |
| 156 | 000783 | 长江证券 | 6,900  | 67,275.00 | 0.10 |
| 157 | 600460 | 士兰微  | 1,200  | 65,592.00 | 0.10 |
| 158 | 688578 | 艾力斯  | 600    | 65,520.00 | 0.10 |
| 159 | 688223 | 晶科能源 | 13,600 | 64,600.00 | 0.10 |
| 160 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,700  | 64,584.00 | 0.10 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 161 | 000625 | 长安汽车 | 9,000  | 64,530.00 | 0.10 |
| 162 | 600009 | 上海机场 | 2,700  | 62,370.00 | 0.10 |
| 163 | 002049 | 紫光国微 | 700    | 62,125.00 | 0.10 |
| 164 | 300434 | 金石亚药 | 5,500  | 61,765.00 | 0.09 |
| 165 | 688620 | 安凯微  | 3,800  | 61,560.00 | 0.09 |
| 166 | 688188 | 柏楚电子 | 560    | 59,752.00 | 0.09 |
| 167 | 002653 | 海思科  | 900    | 59,706.00 | 0.09 |
| 168 | 000983 | 山西焦煤 | 10,200 | 59,160.00 | 0.09 |
| 169 | 688249 | 晶合集成 | 1,000  | 59,030.00 | 0.09 |
| 170 | 002460 | 赣锋锂业 | 900    | 58,860.00 | 0.09 |
| 171 | 600219 | 南山铝业 | 14,700 | 58,653.00 | 0.09 |
| 172 | 600160 | 巨化股份 | 1,100  | 58,311.00 | 0.09 |
| 173 | 002772 | 众兴菌业 | 5,100  | 57,936.00 | 0.09 |
| 174 | 600926 | 杭州银行 | 4,000  | 57,800.00 | 0.09 |
| 175 | 601800 | 中国交建 | 10,000 | 57,100.00 | 0.09 |
| 176 | 688257 | 新锐股份 | 560    | 57,064.00 | 0.09 |
| 177 | 601881 | 中国银河 | 4,500  | 56,565.00 | 0.09 |
| 178 | 000977 | 浪潮信息 | 800    | 56,000.00 | 0.09 |
| 179 | 301377 | 鼎泰高科 | 100    | 55,090.00 | 0.08 |
| 180 | 601898 | 中煤能源 | 4,500  | 54,810.00 | 0.08 |
| 181 | 600487 | 亨通光电 | 500    | 54,670.00 | 0.08 |
| 182 | 601117 | 中国化学 | 7,400  | 54,390.00 | 0.08 |
| 183 | 600015 | 华夏银行 | 8,500  | 54,315.00 | 0.08 |
| 184 | 603156 | 养元饮品 | 1,100  | 53,977.00 | 0.08 |
| 185 | 301358 | 湖南裕能 | 700    | 53,109.00 | 0.08 |
| 186 | 601919 | 中远海控 | 4,000  | 53,040.00 | 0.08 |
| 187 | 601360 | 三六零  | 6,100  | 53,009.00 | 0.08 |
| 188 | 000708 | 中信特钢 | 4,200  | 53,004.00 | 0.08 |
| 189 | 601633 | 长城汽车 | 3,500  | 52,815.00 | 0.08 |
| 190 | 301520 | 万邦医药 | 1,620  | 52,650.00 | 0.08 |
| 191 | 688665 | 四方光电 | 800    | 52,560.00 | 0.08 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 192 | 600027 | 华电国际 | 11,800 | 52,510.00 | 0.08 |
| 193 | 300972 | 万辰集团 | 300    | 52,023.00 | 0.08 |
| 194 | 002281 | 光迅科技 | 200    | 51,388.00 | 0.08 |
| 195 | 601665 | 齐鲁银行 | 8,900  | 51,353.00 | 0.08 |
| 196 | 301328 | 维峰电子 | 715    | 50,908.00 | 0.08 |
| 197 | 601018 | 宁波港  | 16,100 | 50,715.00 | 0.08 |
| 198 | 000906 | 浙商中拓 | 10,000 | 50,400.00 | 0.08 |
| 199 | 002414 | 高德红外 | 3,800  | 50,388.00 | 0.08 |
| 200 | 601825 | 沪农商行 | 6,700  | 50,183.00 | 0.08 |
| 201 | 300442 | 润泽科技 | 600    | 49,842.00 | 0.08 |
| 202 | 688061 | 灿瑞科技 | 1,000  | 49,670.00 | 0.08 |
| 203 | 000895 | 双汇发展 | 2,200  | 49,280.00 | 0.08 |
| 204 | 300826 | 测绘股份 | 3,500  | 49,000.00 | 0.08 |
| 205 | 603519 | 立霸股份 | 3,200  | 48,960.00 | 0.07 |
| 206 | 300504 | 天邑股份 | 3,000  | 48,390.00 | 0.07 |
| 207 | 002923 | 润都股份 | 5,000  | 47,300.00 | 0.07 |
| 208 | 301201 | 诚达药业 | 1,300  | 47,268.00 | 0.07 |
| 209 | 002600 | 领益智造 | 2,700  | 46,818.00 | 0.07 |
| 210 | 002803 | 吉宏股份 | 1,800  | 46,512.00 | 0.07 |
| 211 | 688719 | 爱科赛博 | 600    | 46,200.00 | 0.07 |
| 211 | 601607 | 上海医药 | 3,000  | 46,200.00 | 0.07 |
| 212 | 601668 | 中国建筑 | 10,600 | 46,004.00 | 0.07 |
| 213 | 601233 | 桐昆股份 | 2,100  | 45,465.00 | 0.07 |
| 214 | 301116 | 益客食品 | 5,300  | 45,368.00 | 0.07 |
| 215 | 601231 | 环旭电子 | 1,400  | 45,360.00 | 0.07 |
| 216 | 300154 | 瑞凌股份 | 6,000  | 45,120.00 | 0.07 |
| 217 | 002956 | 西麦食品 | 2,140  | 44,426.40 | 0.07 |
| 218 | 301106 | 骏成科技 | 2,140  | 44,383.60 | 0.07 |
| 219 | 002397 | 梦洁股份 | 11,600 | 44,312.00 | 0.07 |
| 220 | 688683 | 莱尔科技 | 1,167  | 44,252.64 | 0.07 |
| 221 | 002736 | 国信证券 | 4,400  | 43,956.00 | 0.07 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 222 | 002517 | 恺英网络 | 2,700  | 43,875.00 | 0.07 |
| 223 | 601766 | 中国中车 | 8,300  | 43,160.00 | 0.07 |
| 224 | 603195 | 公牛集团 | 1,100  | 43,065.00 | 0.07 |
| 225 | 300661 | 圣邦股份 | 300    | 43,044.00 | 0.07 |
| 226 | 601100 | 恒立液压 | 400    | 43,024.00 | 0.07 |
| 227 | 000039 | 中集集团 | 5,300  | 42,983.00 | 0.07 |
| 228 | 600018 | 上港集团 | 9,100  | 42,952.00 | 0.07 |
| 229 | 300585 | 奥联电子 | 2,600  | 42,458.00 | 0.07 |
| 230 | 001979 | 招商蛇口 | 6,500  | 41,795.00 | 0.06 |
| 231 | 300438 | 鹏辉能源 | 500    | 41,425.00 | 0.06 |
| 232 | 688768 | 容知日新 | 800    | 41,232.00 | 0.06 |
| 233 | 002120 | 韵达股份 | 6,400  | 40,704.00 | 0.06 |
| 233 | 000630 | 铜陵有色 | 6,400  | 40,704.00 | 0.06 |
| 234 | 688271 | 联影医疗 | 400    | 40,492.00 | 0.06 |
| 235 | 300012 | 华测检测 | 2,900  | 40,194.00 | 0.06 |
| 236 | 000166 | 申万宏源 | 9,100  | 40,040.00 | 0.06 |
| 237 | 002625 | 光启技术 | 1,300  | 39,416.00 | 0.06 |
| 238 | 001289 | 龙源电力 | 2,500  | 39,075.00 | 0.06 |
| 239 | 600362 | 江西铜业 | 900    | 38,970.00 | 0.06 |
| 240 | 601658 | 邮储银行 | 7,900  | 38,947.00 | 0.06 |
| 241 | 600535 | 天士力  | 2,900  | 38,367.00 | 0.06 |
| 242 | 002271 | 东方雨虹 | 3,200  | 37,984.00 | 0.06 |
| 243 | 603893 | 瑞芯微  | 200    | 37,672.00 | 0.06 |
| 244 | 301212 | 联盛化学 | 1,600  | 37,360.00 | 0.06 |
| 245 | 002154 | 报喜鸟  | 10,400 | 37,024.00 | 0.06 |
| 246 | 002001 | 新和成  | 1,300  | 36,946.00 | 0.06 |
| 247 | 603970 | 中农立华 | 3,800  | 36,594.00 | 0.06 |
| 248 | 301550 | 斯菱智驱 | 400    | 36,572.00 | 0.06 |
| 249 | 301631 | 壹连科技 | 500    | 35,930.00 | 0.06 |
| 250 | 603444 | 吉比特  | 100    | 35,842.00 | 0.05 |
| 251 | 601336 | 新华保险 | 600    | 35,796.00 | 0.05 |

|     |        |       |       |           |      |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 252 | 300136 | 信维通信  | 300   | 35,775.00 | 0.05 |
| 253 | 601838 | 成都银行  | 2,000 | 35,400.00 | 0.05 |
| 254 | 688036 | 传音控股  | 600   | 35,370.00 | 0.05 |
| 255 | 000029 | 深深房 A | 1,600 | 35,280.00 | 0.05 |
| 256 | 603659 | 璞泰来   | 1,200 | 34,716.00 | 0.05 |
| 257 | 002422 | 科伦药业  | 900   | 34,668.00 | 0.05 |
| 258 | 603233 | 大参林   | 2,300 | 34,569.00 | 0.05 |
| 259 | 600801 | 华新建材  | 2,200 | 34,320.00 | 0.05 |
| 260 | 000589 | 贵州轮胎  | 8,400 | 34,104.00 | 0.05 |
| 261 | 300977 | 深圳瑞捷  | 2,200 | 33,924.00 | 0.05 |
| 262 | 600418 | 江淮汽车  | 1,300 | 33,579.00 | 0.05 |
| 263 | 300743 | 天地数码  | 2,300 | 33,557.00 | 0.05 |
| 264 | 601058 | 赛轮轮胎  | 2,900 | 33,437.00 | 0.05 |
| 265 | 301396 | 宏景科技  | 100   | 33,160.00 | 0.05 |
| 266 | 601728 | 中国电信  | 6,300 | 32,697.00 | 0.05 |
| 267 | 601816 | 京沪高铁  | 7,200 | 32,616.00 | 0.05 |
| 268 | 000729 | 燕京啤酒  | 3,200 | 32,416.00 | 0.05 |
| 269 | 300433 | 蓝思科技  | 600   | 32,196.00 | 0.05 |
| 270 | 603345 | 安井食品  | 400   | 32,076.00 | 0.05 |
| 271 | 601021 | 春秋航空  | 700   | 31,906.00 | 0.05 |
| 272 | 300015 | 爱尔眼科  | 3,800 | 31,388.00 | 0.05 |
| 273 | 300752 | 隆利科技  | 2,300 | 30,981.00 | 0.05 |
| 274 | 301321 | 翰博高新  | 700   | 30,905.00 | 0.05 |
| 275 | 600138 | 中青旅   | 4,500 | 29,385.00 | 0.05 |
| 276 | 002941 | 新疆交建  | 3,100 | 29,264.00 | 0.04 |
| 277 | 601059 | 信达证券  | 1,800 | 29,142.00 | 0.04 |
| 278 | 605289 | 罗曼股份  | 200   | 29,000.00 | 0.04 |
| 279 | 603920 | 世运电路  | 600   | 28,824.00 | 0.04 |
| 280 | 603801 | 志邦家居  | 5,300 | 28,779.00 | 0.04 |
| 281 | 300913 | 兆龙互连  | 600   | 28,746.00 | 0.04 |
| 282 | 600714 | 金瑞矿业  | 1,400 | 28,742.00 | 0.04 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 283 | 688009 | 中国通号 | 6,000 | 28,560.00 | 0.04 |
| 284 | 601319 | 中国人保 | 4,200 | 28,392.00 | 0.04 |
| 285 | 600577 | 精达股份 | 2,900 | 28,362.00 | 0.04 |
| 286 | 603020 | 爱普股份 | 2,000 | 28,200.00 | 0.04 |
| 286 | 300342 | 天银机电 | 600   | 28,200.00 | 0.04 |
| 287 | 603995 | 甬金股份 | 1,200 | 27,852.00 | 0.04 |
| 288 | 300876 | 蒙泰高新 | 1,920 | 27,513.60 | 0.04 |
| 289 | 688187 | 时代电气 | 400   | 27,464.00 | 0.04 |
| 290 | 300982 | 苏文电能 | 1,800 | 27,198.00 | 0.04 |
| 291 | 002080 | 中材科技 | 300   | 27,000.00 | 0.04 |
| 292 | 600724 | 宁波富达 | 5,300 | 26,871.00 | 0.04 |
| 293 | 300550 | 和仁科技 | 2,000 | 26,660.00 | 0.04 |
| 294 | 300921 | 南凌科技 | 1,300 | 26,403.00 | 0.04 |
| 295 | 600988 | 赤峰黄金 | 1,000 | 26,320.00 | 0.04 |
| 296 | 601000 | 唐山港  | 6,300 | 26,145.00 | 0.04 |
| 297 | 002111 | 威海广泰 | 2,900 | 26,100.00 | 0.04 |
| 298 | 002746 | 仙坛股份 | 5,100 | 26,010.00 | 0.04 |
| 299 | 688729 | 屹唐股份 | 600   | 25,800.00 | 0.04 |
| 300 | 002930 | 宏川智慧 | 2,800 | 25,760.00 | 0.04 |
| 301 | 301187 | 欧圣电气 | 1,800 | 25,758.00 | 0.04 |
| 302 | 600262 | 北方股份 | 1,300 | 25,727.00 | 0.04 |
| 303 | 603689 | 皖天然气 | 3,700 | 25,641.00 | 0.04 |
| 303 | 002458 | 益生股份 | 3,300 | 25,641.00 | 0.04 |
| 304 | 603508 | 思维列控 | 1,200 | 25,632.00 | 0.04 |
| 305 | 300933 | 中辰股份 | 4,200 | 25,536.00 | 0.04 |
| 306 | 002128 | 电投能源 | 1,100 | 25,432.00 | 0.04 |
| 307 | 300867 | 圣元环保 | 1,400 | 25,368.00 | 0.04 |
| 308 | 603998 | 方盛制药 | 2,800 | 25,284.00 | 0.04 |
| 309 | 002557 | 洽洽食品 | 1,400 | 25,144.00 | 0.04 |
| 310 | 300406 | 九强生物 | 2,300 | 25,139.00 | 0.04 |
| 311 | 603681 | 永冠新材 | 1,100 | 25,135.00 | 0.04 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 312 | 601877 | 正泰电器 | 1,000 | 25,070.00 | 0.04 |
| 313 | 002955 | 鸿合科技 | 700   | 25,025.00 | 0.04 |
| 314 | 300616 | 尚品宅配 | 2,400 | 25,008.00 | 0.04 |
| 315 | 002791 | 坚朗五金 | 1,900 | 24,890.00 | 0.04 |
| 316 | 688568 | 中科星图 | 600   | 24,882.00 | 0.04 |
| 317 | 600188 | 兖矿能源 | 1,400 | 24,878.00 | 0.04 |
| 318 | 300515 | 三德科技 | 1,900 | 24,795.00 | 0.04 |
| 319 | 300351 | 永贵电器 | 1,500 | 24,750.00 | 0.04 |
| 320 | 601628 | 中国人寿 | 700   | 24,745.00 | 0.04 |
| 321 | 601878 | 浙商证券 | 2,600 | 24,700.00 | 0.04 |
| 322 | 603126 | 中材节能 | 3,900 | 24,570.00 | 0.04 |
| 323 | 603711 | 香飘飘  | 2,200 | 24,442.00 | 0.04 |
| 324 | 002752 | 昇兴股份 | 4,400 | 24,288.00 | 0.04 |
| 325 | 603886 | 元祖股份 | 1,900 | 24,282.00 | 0.04 |
| 326 | 601111 | 中国国航 | 4,000 | 24,200.00 | 0.04 |
| 327 | 001395 | 亚联机械 | 1,030 | 23,999.00 | 0.04 |
| 328 | 603967 | 中创物流 | 2,300 | 23,805.00 | 0.04 |
| 329 | 605258 | 协和电子 | 700   | 23,716.00 | 0.04 |
| 330 | 301316 | 慧博云通 | 600   | 23,628.00 | 0.04 |
| 331 | 600050 | 中国联通 | 5,900 | 23,600.00 | 0.04 |
| 332 | 002738 | 中矿资源 | 400   | 23,596.00 | 0.04 |
| 333 | 600011 | 华能国际 | 3,100 | 23,529.00 | 0.04 |
| 334 | 603289 | 泰瑞机器 | 2,900 | 23,403.00 | 0.04 |
| 335 | 600754 | 锦江酒店 | 1,300 | 23,387.00 | 0.04 |
| 336 | 301202 | 朗威股份 | 700   | 23,331.00 | 0.04 |
| 337 | 688209 | 英集芯  | 800   | 23,264.00 | 0.04 |
| 338 | 300999 | 金龙鱼  | 1,000 | 23,260.00 | 0.04 |
| 339 | 603025 | 大豪科技 | 1,700 | 23,188.00 | 0.04 |
| 340 | 001316 | 润贝航科 | 700   | 23,086.00 | 0.04 |
| 341 | 300508 | 维宏股份 | 400   | 22,972.00 | 0.04 |
| 342 | 601162 | 天风证券 | 6,800 | 22,916.00 | 0.04 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 343 | 002391 | 长青股份 | 4,700 | 22,889.00 | 0.04 |
| 344 | 603166 | 福达股份 | 1,700 | 22,729.00 | 0.03 |
| 345 | 603897 | 长城科技 | 700   | 22,722.00 | 0.03 |
| 346 | 301448 | 开创电气 | 500   | 22,690.00 | 0.03 |
| 347 | 601818 | 光大银行 | 7,800 | 22,542.00 | 0.03 |
| 348 | 603262 | 技源集团 | 900   | 22,158.00 | 0.03 |
| 349 | 300782 | 卓胜微  | 200   | 21,916.00 | 0.03 |
| 350 | 600436 | 片仔癀  | 200   | 21,856.00 | 0.03 |
| 351 | 300765 | 石药创新 | 800   | 21,784.00 | 0.03 |
| 352 | 600415 | 小商品城 | 2,100 | 21,336.00 | 0.03 |
| 353 | 002273 | 水晶光电 | 600   | 21,288.00 | 0.03 |
| 354 | 601456 | 国联民生 | 2,400 | 21,216.00 | 0.03 |
| 355 | 688375 | 国博电子 | 200   | 20,860.00 | 0.03 |
| 356 | 601390 | 中国中铁 | 5,000 | 20,850.00 | 0.03 |
| 357 | 300381 | 溢多利  | 3,700 | 20,794.00 | 0.03 |
| 358 | 600629 | 华建集团 | 1,700 | 20,587.00 | 0.03 |
| 359 | 688099 | 晶晨股份 | 200   | 20,580.00 | 0.03 |
| 360 | 300450 | 先导智能 | 500   | 20,360.00 | 0.03 |
| 361 | 002381 | 双箭股份 | 3,900 | 20,202.00 | 0.03 |
| 362 | 603806 | 福斯特  | 1,200 | 20,148.00 | 0.03 |
| 363 | 601108 | 财通证券 | 2,300 | 19,895.00 | 0.03 |
| 364 | 002236 | 大华股份 | 1,200 | 19,788.00 | 0.03 |
| 365 | 000958 | 电投产融 | 3,500 | 19,740.00 | 0.03 |
| 366 | 600517 | 国网英大 | 4,200 | 19,656.00 | 0.03 |
| 367 | 300910 | 瑞丰新材 | 700   | 19,628.00 | 0.03 |
| 368 | 603201 | 常润股份 | 1,400 | 19,544.00 | 0.03 |
| 369 | 003019 | 宸展光电 | 600   | 19,530.00 | 0.03 |
| 370 | 001360 | 南矿集团 | 1,100 | 19,459.00 | 0.03 |
| 371 | 300426 | 华智数媒 | 3,800 | 19,228.00 | 0.03 |
| 372 | 300347 | 泰格医药 | 400   | 19,200.00 | 0.03 |
| 373 | 601963 | 重庆银行 | 1,900 | 19,152.00 | 0.03 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 374 | 688169 | 石头科技 | 200   | 18,994.00 | 0.03 |
| 375 | 301195 | 北路智控 | 700   | 18,970.00 | 0.03 |
| 376 | 002301 | 齐心集团 | 2,600 | 18,798.00 | 0.03 |
| 377 | 001230 | 劲旅环境 | 1,220 | 18,739.20 | 0.03 |
| 378 | 600016 | 民生银行 | 5,800 | 18,676.00 | 0.03 |
| 379 | 600029 | 南方航空 | 3,600 | 18,648.00 | 0.03 |
| 380 | 001368 | 通达创智 | 900   | 18,513.00 | 0.03 |
| 381 | 600967 | 内蒙一机 | 1,700 | 18,445.00 | 0.03 |
| 382 | 300164 | 通源石油 | 2,300 | 18,400.00 | 0.03 |
| 383 | 600690 | 海尔智家 | 900   | 18,369.00 | 0.03 |
| 384 | 301446 | 福事特  | 500   | 18,350.00 | 0.03 |
| 385 | 601966 | 玲珑轮胎 | 1,800 | 18,342.00 | 0.03 |
| 386 | 600061 | 国投资本 | 2,800 | 18,340.00 | 0.03 |
| 387 | 603819 | 神力股份 | 1,600 | 18,320.00 | 0.03 |
| 388 | 002769 | 普路通  | 2,800 | 18,284.00 | 0.03 |
| 389 | 603336 | 宏辉果蔬 | 2,300 | 18,216.00 | 0.03 |
| 390 | 002064 | 华峰化学 | 1,900 | 18,031.00 | 0.03 |
| 391 | 001203 | 大中矿业 | 600   | 17,970.00 | 0.03 |
| 392 | 603629 | 利通电子 | 100   | 17,881.00 | 0.03 |
| 393 | 600549 | 厦门钨业 | 200   | 17,040.00 | 0.03 |
| 394 | 601618 | 中国中冶 | 6,900 | 16,836.00 | 0.03 |
| 395 | 603896 | 寿仙谷  | 1,300 | 16,835.00 | 0.03 |
| 396 | 301068 | 大地海洋 | 700   | 16,660.00 | 0.03 |
| 397 | 002429 | 兆驰股份 | 1,600 | 16,624.00 | 0.03 |
| 398 | 688657 | 浩辰软件 | 460   | 16,454.20 | 0.03 |
| 399 | 300916 | 朗特智能 | 700   | 16,359.00 | 0.03 |
| 400 | 300248 | 新开普  | 2,100 | 16,191.00 | 0.02 |
| 401 | 301560 | 众捷汽车 | 600   | 16,038.00 | 0.02 |
| 402 | 605319 | 无锡振华 | 700   | 15,883.00 | 0.02 |
| 403 | 301356 | 天振股份 | 600   | 15,762.00 | 0.02 |
| 404 | 688398 | 赛特新材 | 600   | 15,546.00 | 0.02 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 405 | 002849 | 威星智能 | 900   | 15,228.00 | 0.02 |
| 406 | 600398 | 海澜之家 | 2,900 | 15,167.00 | 0.02 |
| 407 | 600660 | 福耀玻璃 | 300   | 15,132.00 | 0.02 |
| 408 | 301602 | 超研股份 | 1,100 | 15,114.00 | 0.02 |
| 409 | 600025 | 华能水电 | 1,700 | 15,113.00 | 0.02 |
| 410 | 301608 | 博实结  | 300   | 15,078.00 | 0.02 |
| 411 | 002008 | 大族激光 | 100   | 15,011.00 | 0.02 |
| 412 | 605028 | 世茂能源 | 700   | 14,910.00 | 0.02 |
| 413 | 600918 | 中泰证券 | 2,800 | 14,896.00 | 0.02 |
| 414 | 001378 | 德冠新材 | 830   | 14,865.30 | 0.02 |
| 415 | 688468 | 科美诊断 | 2,600 | 14,794.00 | 0.02 |
| 416 | 301056 | 森赫股份 | 1,300 | 14,560.00 | 0.02 |
| 417 | 000063 | 中兴通讯 | 400   | 14,476.00 | 0.02 |
| 418 | 601012 | 隆基绿能 | 1,100 | 14,432.00 | 0.02 |
| 419 | 600674 | 川投能源 | 1,000 | 14,170.00 | 0.02 |
| 420 | 000404 | 长虹华意 | 1,800 | 14,148.00 | 0.02 |
| 421 | 300150 | 世纪瑞尔 | 3,500 | 13,895.00 | 0.02 |
| 422 | 301380 | 挖金客  | 500   | 13,795.00 | 0.02 |
| 423 | 002671 | 龙泉股份 | 3,700 | 13,727.00 | 0.02 |
| 424 | 603909 | 建发合诚 | 1,600 | 13,648.00 | 0.02 |
| 425 | 605001 | 威奥股份 | 2,500 | 13,625.00 | 0.02 |
| 426 | 301041 | 金百泽  | 400   | 13,500.00 | 0.02 |
| 427 | 301185 | 鸥玛软件 | 900   | 13,374.00 | 0.02 |
| 428 | 000810 | 创维数字 | 1,000 | 13,250.00 | 0.02 |
| 429 | 600515 | 海南机场 | 4,800 | 13,152.00 | 0.02 |
| 430 | 600048 | 保利发展 | 2,800 | 12,964.00 | 0.02 |
| 431 | 300822 | 贝仕达克 | 1,100 | 12,870.00 | 0.02 |
| 432 | 603839 | 安正时尚 | 2,200 | 12,694.00 | 0.02 |
| 433 | 300758 | 七彩化学 | 1,000 | 12,550.00 | 0.02 |
| 434 | 002441 | 众业达  | 1,600 | 12,480.00 | 0.02 |
| 435 | 601599 | 浙文影业 | 4,400 | 12,276.00 | 0.02 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 436 | 603579 | 荣泰健康 | 700   | 11,879.00 | 0.02 |
| 437 | 600585 | 海螺水泥 | 700   | 11,865.00 | 0.02 |
| 438 | 002014 | 永新股份 | 1,100 | 11,616.00 | 0.02 |
| 439 | 601788 | 光大证券 | 800   | 11,544.00 | 0.02 |
| 440 | 688516 | 奥特维  | 200   | 11,478.00 | 0.02 |
| 441 | 601298 | 青岛港  | 1,400 | 11,270.00 | 0.02 |
| 442 | 000963 | 华东医药 | 400   | 11,248.00 | 0.02 |
| 443 | 688785 | 恒运昌  | 24    | 11,115.60 | 0.02 |
| 444 | 301331 | 恩威医药 | 500   | 11,000.00 | 0.02 |
| 445 | 600809 | 山西汾酒 | 100   | 10,937.00 | 0.02 |
| 446 | 600298 | 安琪酵母 | 300   | 10,860.00 | 0.02 |
| 447 | 000800 | 一汽解放 | 1,800 | 10,710.00 | 0.02 |
| 448 | 605155 | 西大门  | 900   | 10,656.00 | 0.02 |
| 449 | 001268 | 联合精密 | 300   | 10,626.00 | 0.02 |
| 450 | 603808 | 歌力思  | 1,400 | 10,598.00 | 0.02 |
| 451 | 603326 | 我乐家居 | 1,700 | 10,472.00 | 0.02 |
| 452 | 600885 | 宏发股份 | 300   | 10,347.00 | 0.02 |
| 453 | 600100 | 同方股份 | 1,500 | 10,275.00 | 0.02 |
| 454 | 603209 | 兴通股份 | 800   | 10,024.00 | 0.02 |
| 455 | 000426 | 兴业银锡 | 300   | 9,888.00  | 0.02 |
| 456 | 301535 | 浙江华远 | 734   | 9,850.28  | 0.02 |
| 457 | 000951 | 中国重汽 | 500   | 9,755.00  | 0.01 |
| 458 | 600858 | 银座股份 | 2,200 | 9,702.00  | 0.01 |
| 459 | 300222 | 科大智能 | 700   | 9,695.00  | 0.01 |
| 460 | 002266 | 浙富控股 | 1,900 | 9,614.00  | 0.01 |
| 461 | 603230 | 内蒙新华 | 1,100 | 9,603.00  | 0.01 |
| 462 | 605339 | 南侨食品 | 800   | 9,552.00  | 0.01 |
| 463 | 002222 | 福晶科技 | 100   | 9,228.00  | 0.01 |
| 464 | 002852 | 道道全  | 1,300 | 9,217.00  | 0.01 |
| 465 | 300534 | 陇神戎发 | 1,300 | 9,204.00  | 0.01 |
| 466 | 603187 | 海容冷链 | 800   | 9,192.00  | 0.01 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 467 | 603755 | 日辰股份 | 400   | 9,076.00 | 0.01 |
| 468 | 300277 | 汽轮科技 | 600   | 9,024.00 | 0.01 |
| 469 | 600196 | 复星医药 | 400   | 8,988.00 | 0.01 |
| 470 | 000960 | 锡业股份 | 200   | 8,538.00 | 0.01 |
| 471 | 603018 | 华设集团 | 1,600 | 8,224.00 | 0.01 |
| 472 | 603392 | 万泰生物 | 300   | 8,091.00 | 0.01 |
| 473 | 300432 | 富临精工 | 400   | 8,036.00 | 0.01 |
| 474 | 002515 | 金字火腿 | 800   | 8,008.00 | 0.01 |
| 475 | 688371 | 菲沃泰  | 200   | 7,798.00 | 0.01 |
| 476 | 300863 | 卡倍亿  | 100   | 7,663.00 | 0.01 |
| 477 | 300892 | 品渥食品 | 400   | 7,512.00 | 0.01 |
| 478 | 002981 | 朝阳科技 | 400   | 7,376.00 | 0.01 |
| 479 | 600498 | 烽火通信 | 100   | 7,360.00 | 0.01 |
| 480 | 002063 | 远光软件 | 1,400 | 7,140.00 | 0.01 |
| 481 | 300479 | 神思电子 | 500   | 6,770.00 | 0.01 |
| 482 | 688805 | 健信超导 | 140   | 6,575.80 | 0.01 |
| 483 | 600795 | 国电电力 | 1,400 | 6,538.00 | 0.01 |
| 484 | 601777 | 千里科技 | 800   | 6,528.00 | 0.01 |
| 485 | 000529 | 广弘控股 | 1,500 | 6,390.00 | 0.01 |
| 486 | 688618 | 三旺通信 | 200   | 6,154.00 | 0.01 |
| 487 | 302132 | 中航成飞 | 100   | 5,832.00 | 0.01 |
| 488 | 301286 | 侨源股份 | 100   | 5,799.00 | 0.01 |
| 489 | 002487 | 大金重工 | 100   | 5,797.00 | 0.01 |
| 490 | 603107 | 上海汽配 | 500   | 5,675.00 | 0.01 |
| 491 | 603168 | 莎普爱思 | 1,200 | 5,664.00 | 0.01 |
| 492 | 601808 | 中海油服 | 500   | 5,405.00 | 0.01 |
| 493 | 600039 | 四川路桥 | 600   | 4,692.00 | 0.01 |
| 494 | 301382 | 蜂助手  | 100   | 4,600.00 | 0.01 |
| 494 | 301057 | 汇隆新材 | 200   | 4,600.00 | 0.01 |
| 495 | 300784 | 利安科技 | 100   | 4,237.00 | 0.01 |
| 496 | 002172 | 澳洋健康 | 1,500 | 4,230.00 | 0.01 |

|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 497 | 688728 | 格科微  | 200 | 4,208.00 | 0.01 |
| 498 | 600760 | 中航沈飞 | 100 | 4,110.00 | 0.01 |
| 499 | 300915 | 海融科技 | 200 | 3,960.00 | 0.01 |
| 500 | 603080 | 新疆火炬 | 200 | 3,700.00 | 0.01 |
| 501 | 300213 | 佳讯飞鸿 | 600 | 3,636.00 | 0.01 |
| 502 | 603551 | 奥普科技 | 400 | 3,596.00 | 0.01 |
| 503 | 601238 | 广汽集团 | 700 | 3,556.00 | 0.01 |
| 504 | 002857 | 三晖电气 | 200 | 3,514.00 | 0.01 |
| 505 | 300795 | 米奥会展 | 400 | 3,424.00 | 0.01 |
| 506 | 600673 | 东阳光  | 100 | 3,358.00 | 0.01 |
| 507 | 605066 | 天正电气 | 400 | 2,716.00 | 0.00 |
| 508 | 688597 | 煜邦电力 | 400 | 2,600.00 | 0.00 |
| 509 | 003022 | 联泓新科 | 100 | 2,590.00 | 0.00 |
| 510 | 688292 | 浩瀚深度 | 132 | 2,455.20 | 0.00 |
| 511 | 301059 | 金三江  | 200 | 2,218.00 | 0.00 |
| 512 | 301193 | 家联科技 | 100 | 1,854.00 | 0.00 |
| 513 | 600588 | 用友网络 | 200 | 1,836.00 | 0.00 |
| 514 | 603406 | 天富龙  | 69  | 1,790.55 | 0.00 |
| 515 | 605033 | 美邦股份 | 100 | 1,664.00 | 0.00 |
| 516 | 603418 | 友升股份 | 37  | 1,634.29 | 0.00 |
| 517 | 300193 | 佳士科技 | 200 | 1,628.00 | 0.00 |
| 518 | 601112 | 振石股份 | 88  | 1,547.92 | 0.00 |
| 519 | 688579 | 地纬智能 | 200 | 1,518.00 | 0.00 |
| 520 | 300650 | 太龙股份 | 100 | 1,453.00 | 0.00 |
| 521 | 000157 | 中联重科 | 200 | 1,394.00 | 0.00 |
| 522 | 603352 | 至信股份 | 34  | 867.68   | 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 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金 |
|---|------|------|----------|-------|
|---|------|------|----------|-------|

| 号  |        |      |              | 资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|-----------|
| 1  | 300308 | 中际旭创 | 1,422,418.00 | 1.53      |
| 2  | 002475 | 立讯精密 | 1,141,211.00 | 1.23      |
| 3  | 300502 | 新易盛  | 1,125,039.02 | 1.21      |
| 4  | 000338 | 潍柴动力 | 1,057,609.00 | 1.14      |
| 5  | 688012 | 中微公司 | 979,205.84   | 1.05      |
| 6  | 601398 | 工商银行 | 897,121.00   | 0.97      |
| 7  | 601288 | 农业银行 | 872,372.00   | 0.94      |
| 8  | 600150 | 中国船舶 | 871,100.00   | 0.94      |
| 9  | 603986 | 兆易创新 | 864,211.00   | 0.93      |
| 10 | 603993 | 洛阳钼业 | 862,271.00   | 0.93      |
| 11 | 600183 | 生益科技 | 851,932.00   | 0.92      |
| 12 | 300476 | 胜宏科技 | 827,554.00   | 0.89      |
| 13 | 002463 | 沪电股份 | 806,408.64   | 0.87      |
| 14 | 600887 | 伊利股份 | 775,771.00   | 0.84      |
| 15 | 002384 | 东山精密 | 740,847.00   | 0.80      |
| 16 | 601328 | 交通银行 | 729,176.00   | 0.79      |
| 17 | 600346 | 恒力石化 | 723,499.00   | 0.78      |
| 18 | 600028 | 中国石化 | 692,911.00   | 0.75      |
| 19 | 600176 | 中国巨石 | 671,080.00   | 0.72      |
| 20 | 600000 | 浦发银行 | 669,754.00   | 0.72      |

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  | 300750 | 宁德时代 | 1,992,281.00 | 2.15           |
| 2  | 600519 | 贵州茅台 | 1,927,519.00 | 2.08           |
| 3  | 601318 | 中国平安 | 1,490,192.00 | 1.60           |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 4  | 300502 | 新易盛  | 1,409,069.00 | 1.52 |
| 5  | 300308 | 中际旭创 | 1,376,559.00 | 1.48 |
| 6  | 002475 | 立讯精密 | 1,233,430.00 | 1.33 |
| 7  | 603993 | 洛阳钼业 | 1,191,503.00 | 1.28 |
| 8  | 601398 | 工商银行 | 1,189,604.00 | 1.28 |
| 9  | 000333 | 美的集团 | 1,122,564.00 | 1.21 |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 1,066,539.00 | 1.15 |
| 11 | 601288 | 农业银行 | 1,062,873.00 | 1.14 |
| 12 | 000338 | 潍柴动力 | 1,055,399.00 | 1.14 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 1,034,155.00 | 1.11 |
| 14 | 300274 | 阳光电源 | 1,015,002.00 | 1.09 |
| 15 | 601328 | 交通银行 | 1,008,092.00 | 1.09 |
| 16 | 600183 | 生益科技 | 985,807.00   | 1.06 |
| 17 | 601898 | 中煤能源 | 963,213.00   | 1.04 |
| 18 | 601857 | 中国石油 | 936,790.00   | 1.01 |
| 19 | 600938 | 中国海油 | 934,023.00   | 1.01 |
| 20 | 601166 | 兴业银行 | 917,986.00   | 0.99 |

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 | 140,531,416.69 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 172,852,950.34 |

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) | 300.02 | 0.00 |
| 8  | 同业存单      | -      | -    |
| 9  | 其他        | -      | -    |
| 10 | 合计        | 300.02 | 0.00 |

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  | 123273 | 三江转债 | 3     | 300.02 | 0.00         |

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

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约定的备选股票库。

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 | 676.87 |
| 6  | 其他应收款 | -      |
| 7  | 待摊费用  | -      |
| 8  | 其他    | -      |
| 9  | 合计    | 676.87 |

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<br>级别              | 持<br>有<br>人<br>户<br>数<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>份额<br>比例 | 持有份额          | 占总份<br>额比例 |
| 泓德<br>智选<br>领航<br>混合A | 187                          | 167,098.29    | 23,809,386.47 | 76.2<br>0%     | 7,437,994.14  | 23.80%     |
| 泓德<br>智选<br>领航<br>混合C | 399                          | 43,924.09     | 100,032.22    | 0.57%          | 17,425,681.65 | 99.43%     |
| 合计                    | 573                          | 85,118.84     | 23,909,418.69 | 49.0<br>2%     | 24,863,675.79 | 50.98%     |

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 盈利投资者数量占比

| 项目        | 过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日） |
|-----------|-------------------------------|
| 盈利投资者数量占比 | 97.00%                        |

8.3 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<br>（份） | 占基金总份额比<br>例 |
|------------------|-----------|---------------|--------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 泓德智选领航混合A | 1,591.23      | 0.01%        |
|                  | 泓德智选领航混合C | -             | -            |
|                  | 合计        | 1,591.23      | 0.00%        |

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）。

8.4 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 | 泓德智选领航混合A | 0                 |
|                                | 泓德智选领航混合C | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 泓德智选领航混合A | 0                 |
|                                | 泓德智选领航混合C | 0                 |
|                                | 合计        | 0                 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            | 泓德智选领航混合A      | 泓德智选领航混合C      |
|----------------------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日(2024年10月24日)基金份额总额 | 174,458,855.02 | 398,258,175.72 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 42,891,293.49  | 33,021,122.18  |
| 本报告期基金总申购份额                | 6,083,339.65   | 2,474,400.34   |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 17,727,252.53  | 17,969,808.65  |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 31,247,380.61  | 17,525,713.87  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

### （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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期未发生公司被中国证监会、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 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人高级管理人员及其他从业人员受调查或处罚的情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过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 |    |
| 中信证券（山东） | 3      | 157,579,833.03 | 50.29%       | 68,691.38 | 50.29%     | -  |
| 中银国际证券   | 3      | 155,766,139.78 | 49.71%       | 67,896.46 | 49.71%     | -  |
| 中信证券     | 3      | -              | -            | -         | -          | -  |

注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择中信证券、中信证券（山东）、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 基金租用或者通过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 |
| 中信证券（山东） | 12,475.00 | 51.80%       | -      | -              | -    | -            | -    | -            |

|        |           |        |   |   |   |   |   |   |
|--------|-----------|--------|---|---|---|---|---|---|
| 中银国际证券 | 11,606.05 | 48.20% | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券   | -         | -      | - | - | - | - | - | - |

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、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-01-21 |
| 2  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告 | 公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-02-26 |
| 3  | 泓德基金管理有限公司关于泓德智选领航混合型证券投资基金的基金经理变更公告           | 公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-05 |
| 4  | 泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告        | 公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-10 |
| 5  | 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（2025年度）      | 公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-03-31 |
| 6  | 泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告 | 公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-05-22 |
| 7  | 泓德基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告     | 公司官网、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-05-29 |
| 8  | 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、证券日报、中国证监会基金电子披露网站 | 2026-06-19 |

§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              | 2026/01/01-2026/06/30  | 18,764,444.44 | -    | -    | 18,764,444.44 | 38.47% |
| 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领航混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德智选领航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德智选领航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德智选领航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](http://www.hongdefund.com)

泓德基金管理有限公司  
二〇二六年八月二十九日