

# 泓德智选启元混合型证券投资基金

## 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:华泰证券股份有限公司

送出日期:2025 年 03 月 28 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3月27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。

本年度报告财务资料经审计，容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2024年1月1日起至2024年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	92
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	94
8.6 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	94
8.7 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	94
8.8 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	94
8.9 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	94

8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	94
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	95
8.12 投资组合报告附注 .....	95
§9 基金份额持有人信息 .....	96
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	96
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	96
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	97
§10 开放式基金份额变动 .....	97
§11 重大事件揭示 .....	97
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	97
11.2 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 .....	98
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	98
11.4 基金投资策略的改变 .....	98
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	98
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	98
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	98
11.8 其他重大事件 .....	100
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	102
12.1 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 .....	102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	102
§13 备查文件目录 .....	102
13.1 备查文件目录 .....	102
13.2 存放地点 .....	102
13.3 查阅方式 .....	103

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	泓德智选启元混合型证券投资基金	
基金简称	泓德智选启元混合	
基金主代码	019982	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年11月21日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	144,155,504.73份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C
下属分级基金的交易代码	019982	019983
报告期末下属分级基金的份额总额	110,664,572.14份	33,490,932.59份

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	泓德基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春
	联系电话	010-59850177
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com
客户服务电话	4009-100-888	95597
传真	010-59850195	025-83387215
注册地址	西藏自治区拉萨市柳梧新区北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	江苏省南京市江东中路228号
办公地址	北京市西城区德胜门外大街1 25号	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码	100088	210009
法定代表人	王德晓	张伟

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26

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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2024年		2023年11月21日（基金合同生效日）-2023年12月31日	
	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C
本期已实现收益	10,169,491.24	-19,953,952.91	-349,683.43	-1,960,739.41
本期利润	7,576,331.86	-17,232,358.38	-670,296.22	-3,670,910.72
加权平均基金份额本期利润	0.1035	-0.1616	-0.0159	-0.0164
本期加权平均净值利润率	11.24%	-17.93%	-1.62%	-1.66%
本期基金份额净值增长率	3.58%	3.17%	-1.59%	-1.64%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末	
期末可供分配利润	2,141,297.92	495,035.03	-670,296.22	-3,670,910.72
期末可供分配基金份额利润	0.0193	0.0148	-0.0159	-0.0164
期末基金资产净值	112,805,870.06	33,985,967.62	41,410,627.36	220,709,555.04
期末基金份额净值	1.0193	1.0148	0.9841	0.9836
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末	
基金份额累计净值增长率	1.93%	1.48%	-1.59%	-1.64%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 泓德智选启元混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.90%	1.95%	0.06%	1.83%	1.84%	0.12%
过去六个月	17.38%	1.85%	14.69%	1.81%	2.69%	0.04%
过去一年	3.58%	1.66%	5.80%	1.64%	-2.22%	0.02%
自基金合同生效起至今	1.93%	1.59%	2.00%	1.56%	-0.07%	0.03%

##### 泓德智选启元混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.81%	1.95%	0.06%	1.83%	1.75%	0.12%
过去六个月	17.16%	1.85%	14.69%	1.81%	2.47%	0.04%
过去一年	3.17%	1.66%	5.80%	1.64%	-2.63%	0.02%
自基金合同生效起至今	1.48%	1.59%	2.00%	1.56%	-0.52%	0.03%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

基准指数的构建原则如下：

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

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



债券市场总体价格水平和变动趋势。

(3) 由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

泓德智选启元混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年11月21日-2024年12月31日)

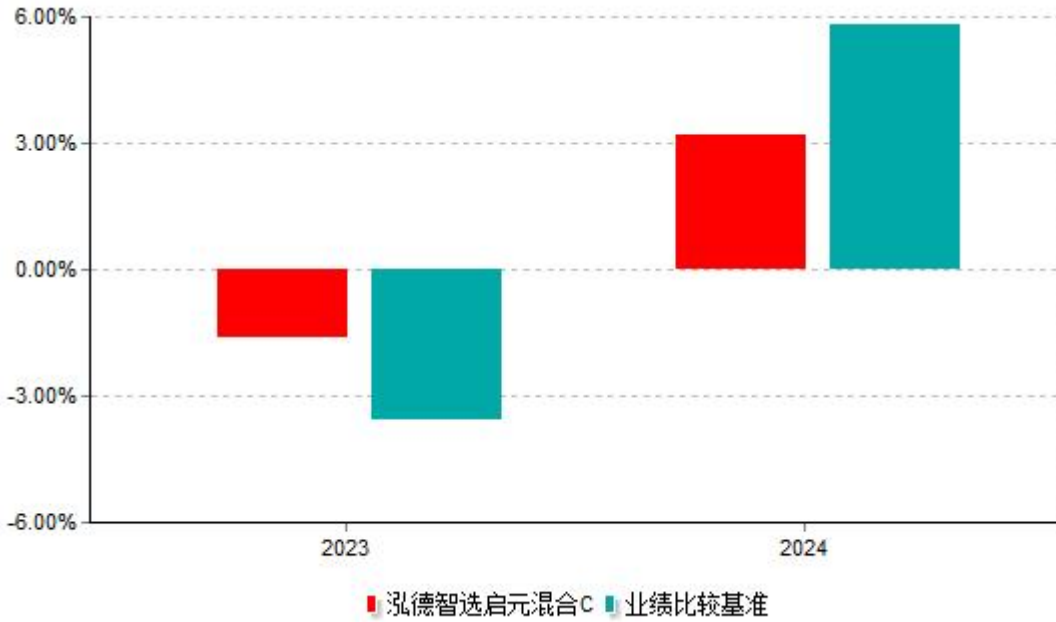
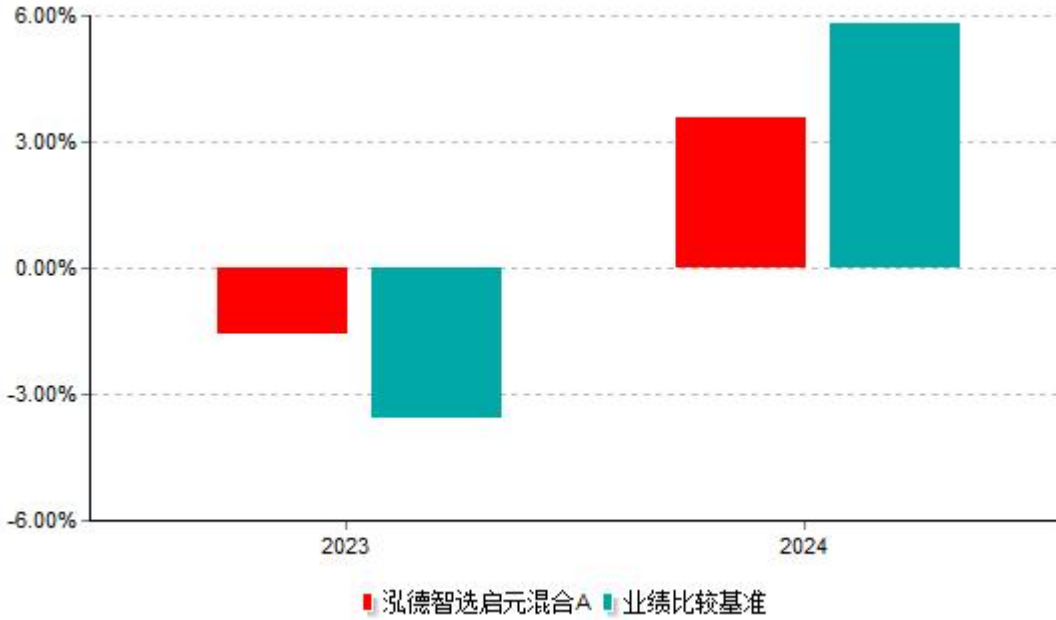


泓德智选启元混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年11月21日-2024年12月31日)



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。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同自2023年11月21日生效，生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §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。

泓德基金自成立以来，始终以“客户利益最大化”为己任，聚焦主动投资管理。公司建立了科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳健的运营保障体系，专业高效的市场服务体系，中长期的激励约束机制，致力于成为能持续为客户创造价值的、受人尊重的专业化资产管理公司。泓德基金坚持长期价值投资理念，以更好地保障客户利益为出发点，强调投资长周期性，同时在产品设计以及产品销售环节配合投资理念的落地执行。

公司已覆盖从公募到专户、从股票投资到固定收益投资、从低风险到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、货币型等基金品种。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李子昂	本基金的基金经理	2023-11-29	-	11年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。
刘令宇	本基金的基金经理	2024-08-20	-	5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。
苏昌景	本基金的基金经理、 量化投资部总监	2023- 11-21	2024- 12-07	16年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司研究部研究员，国都证券股份有限公司研究所研究员、资产管理总部总经理助理、投资经理。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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股市场出现了较大波动，小微盘股票在年初经历了大幅回撤，产品的超额收益也因为市场结构变化和流动性枯竭而受损，我们循序渐进地调整了模型架构、风格约束和成分股占比，并取得了一定的控回撤效果。后续，伴随成交量放大，市场出现明显反弹，同时市场风格再次反转，超额收益也有所修复，期间我们对模型进行了持续迭代，努力克服市场环境变化对超额收益的影响，并积极开发新的模型，力争实现Alpha来源的多样性，5月份开始市场再度掉头向下，成交量持续低迷，超额收益虽然持续修复，但幅度受到一定影响。9月份政治局会议的政策部署，强力提振了市场信心，指数迅速上涨，但选股因子却出现了不同程度的失效，我们采用的AI选股模型总体表现稳健。纵观全年，市场的大幅波动和风格的剧烈变化使我们需要越来越多地应对数据漂移的问题，对我们的模型结构、数据处理和训练方式都提出了新的挑战。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德智选启元混合A基金份额净值为1.0193元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.58%，同期业绩比较基准收益率为5.80%；截至报告期末泓德智选启元混合C基金份额净值为1.0148元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.17%，同期业绩比较基准收益率为5.80%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年伊始，DeepSeek火爆出圈，低成本高性能的中国大模型点燃了市场的做多热情，同时带来了中国科技股新一轮的价值重估，一时间各行各业纷纷接入DeepSeek，无论是上游的算力厂商还是下游的应用公司都直接受益。纵观AI的发展历史，从早期的感知机到神经网络，再从深度神经网络到大模型，AI经历了螺旋式的发展，伴随着硬件的摩尔定律，一代又一代高性能的模型被开发迭代出来，可以想象，从AI到AGI的过程中，越来越多的行业将通过AI实现降本增效，甚至被AI颠覆。DeepSeek带动了TMT板块的资

金流入，抬升了整个板块的估值水平，收窄了国内大厂与美国AI龙头的估值折价，当然，以红利为代表的稳健风格出现明显回调，尽管我们长期坚定看好AI的发展，但短期的行情依然是风险偏好提升带来的估值修复，真正的企业盈利提升仍需要技术的进一步落地。长期来看，科技创新是改善经济结构、促进经济增长的核心动能，而中短期的经济增长依然需要更加宽松的货币政策和更加积极的财政政策，从近期一系列高层会议的定调和一揽子增量政策的部署，我们可以看到中央对于稳增长的决心。随着信心恢复，成交愈发活跃，市场也逐渐企稳。我们也会努力开发更有效的深度学习模型，努力为投资者获取更好收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 根据法律法规的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

(2) 对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

(3) 通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

(4) 按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

(5) 认真贯彻落实反洗钱各项法律法规，切实履行金融机构的反洗钱法定义务，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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，2024年度未实施利润分配。

本基金截至2024年12月31日，期末可供分配利润为2,636,332.95元，其中：泓德智选启元混合A期末可供分配利润为2,141,297.92元（泓德智选启元混合A的未分配利润已实现部分为6,419,149.41元，未分配利润未实现部分为-4,277,851.49元），泓德智选启元混合C期末可供分配利润为495,035.03元（泓德智选启元混合C的未分配利润已实现部分为1,780,447.55元，未分配利润未实现部分为-1,285,412.52元）。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金2024年年度报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	容诚审字[2025]200Z1968号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泓德智选启元混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了泓德智选启元混合型证券投资基金（以下简称“泓德智选启元混合基金”）财务报表，包括2024年12月31日和2023年12月31日的资产负债表，2024年度和2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泓德智选启元混合基金2024年12月31日和2023年12月31日的财务状况以及2024年度和2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，</p>



	我们独立于泓德智选启元混合基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>泓德智选启元混合基金的基金管理人泓德基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估泓德智选启元混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泓德智选启元混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督泓德智选启元混合基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报</p>

	<p>表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对泓德智选启元混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泓德智选启元混合基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	陈熹   林佳璐
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26
审计报告日期	2025-03-25

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：泓德智选启元混合型证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	12,418,081.60	22,313,094.89
结算备付金		1,001.90	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	133,105,842.54	240,200,971.82
其中：股票投资		133,099,027.78	240,200,971.82
基金投资		-	-
债券投资		6,814.76	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,988,927.66	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		147,513,853.70	262,514,066.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		380,473.53	-
应付管理人报酬		146,829.05	265,981.08
应付托管费		18,353.65	33,247.66
应付销售服务费		12,302.29	74,655.57
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	7.4.7.6	164,057.50	20,000.00
负债合计		722,016.02	393,884.31
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	144,155,504.73	266,461,389.34
未分配利润	7.4.7.8	2,636,332.95	-4,341,206.94
净资产合计		146,791,837.68	262,120,182.40
负债和净资产总计		147,513,853.70	262,514,066.71

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额144,155,504.73份，其中A类基金份额总额为110,664,572.14份，基金份额净值为1.0193元；C类基金份额总额为33,490,932.59份，基金份额净值为1.0148元。

## 7.2 利润表

会计主体：泓德智选启元混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日(基 金合同生效日)至2 023年12月31日

<b>一、营业总收入</b>		-6,880,461.08	-3,835,650.43
1.利息收入		184,369.86	43,004.46
其中：存款利息收入	7.4.7.9	184,369.86	43,004.46
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）		-8,000,234.45	-1,847,870.79
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-11,071,916.72	-1,912,397.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	88,160.71	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	2,983,521.56	64,526.69
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	128,435.15	-2,030,784.10
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	806,968.36	-
<b>减：二、营业总支出</b>		2,775,565.44	505,556.51
1.管理人报酬		1,965,505.01	344,570.39
2.托管费		245,688.23	43,071.33
3.销售服务费		386,872.02	96,714.79
4.投资顾问费		-	-

5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		0.18	-
8.其他费用	7.4.7.16	177,500.00	21,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,656,026.52	-4,341,206.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,656,026.52	-4,341,206.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,656,026.52	-4,341,206.94

### 7.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选启元混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	266,461,389.34	-4,341,206.94	262,120,182.40
二、本期期初净资产	266,461,389.34	-4,341,206.94	262,120,182.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-122,305,884.61	6,977,539.89	-115,328,344.72
（一）、综合收益总额	-	-9,656,026.52	-9,656,026.52
（二）、本期基金	-122,305,884.61	16,633,566.41	-105,672,318.20

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	313,458,847.70	-18,407,936.55	295,050,911.15
2.基金赎回款	-435,764,732.31	35,041,502.96	-400,723,229.35
（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	144,155,504.73	2,636,332.95	146,791,837.68
项目	上年度可比期间		
	2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	266,461,389.34	-	266,461,389.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-4,341,206.94	-4,341,206.94
（一）、综合收益总额	-	-4,341,206.94	-4,341,206.94
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回	-	-	-

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	266,461,389.34	-4,341,206.94	262,120,182.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

王德晓

李娇

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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



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

本财务报表由本基金的基金管理人泓德基金管理有限公司于2025年3月25日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度和2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31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2024年12月31日和2023年12月31日的财务状况以及2024年度和2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2024年度和2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日止期间。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

##### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变

动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净

资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人

缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投

资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称"指引")，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 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。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服

务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	6,231,695.56	12,250,324.53
等于：本金	6,227,465.93	12,244,261.33
加：应计利息	4,229.63	6,063.20
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	6,186,386.04	10,062,770.36
等于：本金	6,185,927.76	10,061,561.91
加：应计利息	458.28	1,208.45
减：坏账准备	-	-
合计	12,418,081.60	22,313,094.89

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。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	135,002,790.45	-	133,099,027.78	-1,903,762.67
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	5,400.00	6,814.76	1,413.72
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,400.00	6,814.76	1,413.72
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	135,008,190.45	1.04	133,105,842.54	-1,902,348.95

项目	上年度末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	242,231,755.92	-	240,200,971.82	-2,030,784.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	242,231,755.92	-	240,200,971.82	-2,030,784.10

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	57.50	-

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	164,000.00	20,000.00
合计	164,057.50	20,000.00

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 泓德智选启元混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合A)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,080,923.58	42,080,923.58
本期申购	261,562,207.08	261,562,207.08
本期赎回（以“-”号填列）	-192,978,558.52	-192,978,558.52
本期末	110,664,572.14	110,664,572.14

##### 7.4.7.7.2 泓德智选启元混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合C)	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	224,380,465.76	224,380,465.76
本期申购	51,896,640.62	51,896,640.62
本期赎回（以“-”号填列）	-242,786,173.79	-242,786,173.79
本期末	33,490,932.59	33,490,932.59

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自2023年11月6日至2023年11月17日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币266,435,025.34元，折合为266,435,025.34份基金份额(其中A类基金份额42,074,397.69份，C类基金份额224,360,627.65份)。根据《泓德智选启元混合型证券投资

基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入26,364.00元在本基金成立后，折算为26,364.00份基金份额（其中A类基金份额为6,525.89份，C类基金份额为19,838.11份），划入基金份额持有人账户。

3、根据《泓德智选启元混合型证券投资基金基金合同》、《泓德智选启元混合型证券投资基金招募说明书》及《泓德基金管理有限公司关于泓德智选启元混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2023年11月21日(基金合同生效日)至2024年2月1日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换及定期定额投资业务自2024年2月2日起开始办理。

### 7.4.7.8 未分配利润

#### 7.4.7.8.1 泓德智选启元混合A

单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-349,683.43	-320,612.79	-670,296.22
本期期初	-349,683.43	-320,612.79	-670,296.22
本期利润	10,169,491.24	-2,593,159.38	7,576,331.86
本期基金份额交易产生的变动数	-3,400,658.40	-1,364,079.32	-4,764,737.72
其中：基金申购款	-26,113,012.88	11,767,500.72	-14,345,512.16
基金赎回款	22,712,354.48	-13,131,580.04	9,580,774.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,419,149.41	-4,277,851.49	2,141,297.92

#### 7.4.7.8.2 泓德智选启元混合C

单位：人民币元

项目 (泓德智选启元混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,960,739.41	-1,710,171.31	-3,670,910.72
本期期初	-1,960,739.41	-1,710,171.31	-3,670,910.72
本期利润	-19,953,952.91	2,721,594.53	-17,232,358.38
本期基金份额交易产生的变动数	23,695,139.87	-2,296,835.74	21,398,304.13

其中：基金申购款	-7,065,964.47	3,003,540.08	-4,062,424.39
基金赎回款	30,761,104.34	-5,300,375.82	25,460,728.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,780,447.55	-1,285,412.52	495,035.03

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	149,875.85	34,228.99
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	34,493.11	8,775.47
结算备付金利息收入	0.90	-
其他	-	-
合计	184,369.86	43,004.46

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。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	1,348,303,481.40	205,583,870.85
减：卖出股票成本总额	1,356,990,718.78	206,879,369.89
减：交易费用	2,384,679.34	616,898.44
买卖股票差价收入	-11,071,916.72	-1,912,397.48

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	46.57	-
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	88,114.14	-
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	88,160.71	-

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效日） 至2023年12月31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	402,677.32	-
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	314,500.00	-
减：应计利息总额	47.07	-
减：交易费用	16.11	-
买卖债券差价收入	88,114.14	-

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日(基金合同生效 日)至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,983,521.56	64,526.69
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	2,983,521.56	64,526.69

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日(基金合同生效日) 至2023年12月31日
1.交易性金融资产	128,435.15	-2,030,784.10
——股票投资	127,021.43	-2,030,784.10
——债券投资	1,413.72	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	128,435.15	-2,030,784.10

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日(基金合同生效 日)至2023年12月31日
----	-----------------------------------	---

基金赎回费收入	806,968.36	-
合计	806,968.36	-

注：本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
审计费用	44,000.00	-
信息披露费	120,000.00	20,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	13,500.00	-
开户费	-	1,200.00
合计	177,500.00	21,200.00

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
华泰证券股份有限公司（以下简称“华泰证券”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人的自然人股东
阳光资产管理股份有限公司	基金管理人股东
珠海市基业长青投资中心（有限合伙）	基金管理人股东



泓德基业（西藏）企业管理有限公司	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东
珠海市崇德企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东
珠海市广业企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
温永鹏	基金管理人的自然人股东
李晓春	基金管理人的自然人股东
王克玉	基金管理人的自然人股东
秦毅	基金管理人的自然人股东
李娇	基金管理人的自然人股东
李操纲	基金管理人的自然人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
华泰证券	1,343,052,947.65	51.73%	485,593,476.28	74.19%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例
华泰证券	266,912.36	66.28%	-	-

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
华泰证券	852,744.65	55.23%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
华泰证券	350,258.83	74.19%	-	-

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

## 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,965,505.01	344,570.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	730,448.31	133,064.95
应支付基金管理人的净管理费	1,235,056.70	211,505.44

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。

## 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	245,688.23	43,071.33

注：支付基金托管人华泰证券的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

## 7.4.10.2.3 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		
	2024年01月01日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C	合计
华泰证券	0.00	256,902.13	256,902.13
泓德基金	0.00	21,287.25	21,287.25
合计	0.00	278,189.38	278,189.38

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C	合计
华泰证券	0.00	74,280.49	74,280.49
泓德基金	0.00	10.11	10.11
合计	0.00	74,290.60	74,290.60

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

泓德智选启元混合A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金合同生效日（2023年11月21日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	12,285,002.66	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	12,285,002.66	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1.申购/买入总份额含红利再投、转换（入）份额、强制调增份额，赎回/卖出总份额含转换（出）份额、强制调减份额。

2.基金管理人投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

泓德智选启元混合A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	209,696.38	0.15%	0.00	0.00%

#### 7.4.10.5 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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
华泰证券-托管户	6,231,695.56	149,875.85	12,250,324.53	34,228.99
华泰证券-证券户	865,572.49	7,307.41	6,341,712.87	2,404.18

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

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

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

#### 7.4.11 利润分配情况

无。

#### 7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月以上	限售股	21.23	65.78	718	15,243.14	47,230.04	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6个月以上	限售股	8.00	56.10	599	4,792.00	33,603.90	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月以上	限售股	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
688615	合合信息	2024-09-19	6个月以上	限售股	55.18	165.78	103	5,683.54	17,075.34	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月以上	限售股	17.58	33.06	490	8,614.20	16,199.40	-

301556	托普云农	2024-10-10	6个月以上	限售股	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301522	上大股份	2024-10-09	6个月以上	限售股	6.88	24.84	627	4,313.76	15,574.68	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6个月以上	限售股	18.50	56.85	264	4,884.00	15,008.40	-
301571	国科天成	2024-08-14	6个月以上	限售股	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
603072	天和磁材	2024-12-24	7个交易日	新股未上市	12.30	12.30	1,106	13,603.80	13,603.80	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月以上	限售股	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301607	富特科技	2024-08-28	6个月以上	限售股	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
688710	益诺思	2024-08-27	6个月以上	限售股	19.06	33.58	256	4,879.36	8,596.48	-
301552	科力装备	2024-07-15	6个月以上	限售股	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6个月以上	限售股	21.21	36.49	208	4,411.68	7,589.92	-
001391	国货航	2024-12-23	6个月以上	限售股	2.30	6.80	1,100	2,530.00	7,480.00	-

001279	强邦新材	2024-09-27	6个月以上	限售股	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
301608	博实结	2024-07-25	6个月以上	限售股	44.50	65.38	104	4,628.00	6,799.52	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6个月以上	限售股	26.50	41.98	154	4,081.00	6,464.92	-
301613	新铝时代	2024-10-18	6个月以上	限售股	27.70	41.77	138	3,822.60	5,764.26	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6个月以上	限售股	23.95	35.85	156	3,736.20	5,592.60	-
603207	小方制药	2024-08-19	6个月以上	限售股	12.47	26.65	182	2,269.54	4,850.30	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6个月以上	限售股	26.50	44.43	81	2,146.50	3,598.83	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	限售股	20.56	36.17	91	1,870.96	3,291.47	-
603205	健尔康	2024-10-29	6个月以上	限售股	14.65	27.35	120	1,758.00	3,282.00	-
603194	中力股份	2024-12-17	6个月以上	限售股	20.32	28.13	113	2,296.16	3,178.69	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6个月以上	限售股	40.00	41.35	62	2,480.00	2,563.70	-



603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	限售股	18.65	22.61	88	1,641.20	1,989.68	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6个月以上	限售股	17.39	17.95	91	1,582.49	1,633.45	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月以上	新股未上市且限售	12.30	12.30	123	1,512.90	1,512.90	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。基金参与申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让，其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-1-2-23	重大资产重组	7.22	2025-01-07	6.93	14,000	99,826.51	101,080.00	-

注：本基金截至2024年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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%)。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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“7.4.12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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

**7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2024年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	12,418,081.60	-	-	-	12,418,081.60
结算备付金	1,001.90	-	-	-	1,001.90
交易性金融资产	-	-	6,814.76	133,099,027.78	133,105,842.54
应收申购款	-	-	-	1,988,927.66	1,988,927.66
资产总计	12,419,083.50	-	6,814.76	135,087,955.44	147,513,853.70
负债					
应付赎回款	-	-	-	380,473.53	380,473.53
应付管理人报酬	-	-	-	146,829.05	146,829.05
应付托管费	-	-	-	18,353.65	18,353.65
应付销售服务费	-	-	-	12,302.29	12,302.29
其他负债	-	-	-	164,057.50	164,057.50
负债总计	-	-	-	722,016.02	722,016.02

利率敏感度缺口	12,419,083.50	-	6,814.76	134,365,939.42	146,791,837.68
上年度末 2023年 12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	22,313,094.89	-	-	-	22,313,094.89
交易性金融资产	-	-	-	240,200,971.82	240,200,971.82
资产总计	22,313,094.89	-	-	240,200,971.82	262,514,066.71
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	265,981.08	265,981.08
应付托管费	-	-	-	33,247.66	33,247.66
应付销售服务费	-	-	-	74,655.57	74,655.57
其他负债	-	-	-	20,000.00	20,000.00
负债总计	-	-	-	393,884.31	393,884.31
利率敏感度缺口	22,313,094.89	-	-	239,807,087.51	262,120,182.40

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为0.00%(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)。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	133,099,027.78	90.67	240,200,971.82	91.64
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	133,099,027.78	90.67	240,200,971.82	91.64

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	7,065,740.92	-
	业绩比较基准下降5%	-7,065,740.92	-

注：于上年度末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

### 7.4.14 公允价值

#### 7.4.14.1 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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	132,677,793.81	240,175,510.11
第二层次	116,196.70	-
第三层次	311,852.03	25,461.71
合计	133,105,842.54	240,200,971.82

##### 7.4.14.2.2 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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	25,461.71	25,461.71
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	667,796.64	667,796.64
转出第三层次	-	254,997.19	254,997.19
当期利得或损失总额	-	-126,409.13	-126,409.13
其中：计入损益的利得或损失	-	-126,409.13	-126,409.13
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	311,852.03	311,852.03
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-40,885.57	-40,885.57
项目	上年度可比期间 2023年11月21日（基金合同生效日）至2023年12月31日		



	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	25,002.83	25,002.83
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	458.88	458.88
其中：计入损益的利得或损失	-	458.88	458.88
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	25,461.71	25,461.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	458.88	458.88

注：于2024年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2024年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

**7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况**

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	311,852.03	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	26.65%-57 4.44%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权	与公允价值之

				平均值	间的关系
股票投资	25,461.71	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	73.05%-167.89%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	133,099,027.78	90.23
	其中：股票	133,099,027.78	90.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,814.76	0.00
	其中：债券	6,814.76	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	12,419,083.50	8.42
8	其他各项资产	1,988,927.66	1.35

9	合计	147,513,853.70	100.00
---	----	----------------	--------

**8.2 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	905,247.00	0.62
B	采矿业	5,627,004.00	3.83
C	制造业	84,475,947.69	57.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,147,809.00	2.83
E	建筑业	1,307,148.00	0.89
F	批发和零售业	4,772,061.00	3.25
G	交通运输、仓储和邮政业	2,936,313.00	2.00
H	住宿和餐饮业	155,520.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,438,850.85	6.43
J	金融业	11,270,044.00	7.68
K	房地产业	2,016,301.00	1.37
L	租赁和商务服务业	1,776,773.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	1,065,262.24	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	1,290,660.00	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	641,744.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	1,272,343.00	0.87
S	综合	-	-
	合计	133,099,027.78	90.67

**8.3 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	300502	新易盛	6,300	728,154.00	0.50
2	600925	苏能股份	124,200	658,260.00	0.45
3	002500	山西证券	100,500	631,140.00	0.43
4	002273	水晶光电	26,300	584,386.00	0.40
5	600361	创新新材	149,800	578,228.00	0.39
6	002724	海洋王	104,600	556,472.00	0.38
7	002532	天山铝业	69,000	543,030.00	0.37
8	601399	国机重装	170,500	525,140.00	0.36
9	002266	浙富控股	165,900	517,608.00	0.35
10	002414	高德红外	68,200	506,726.00	0.35
11	002128	电投能源	25,700	503,206.00	0.34
12	601212	白银有色	178,300	495,674.00	0.34
13	002926	华西证券	59,600	495,276.00	0.34
14	000725	京东方 A	112,000	491,680.00	0.33
15	600739	辽宁成大	46,000	476,100.00	0.32
16	000623	吉林敖东	27,300	471,471.00	0.32
17	601179	中国西电	62,000	470,580.00	0.32
18	000050	深天马 A	51,400	464,142.00	0.32
19	600879	航天电子	50,300	450,688.00	0.31
20	600282	南钢股份	92,900	435,701.00	0.30
21	601106	中国一重	147,600	429,516.00	0.29
22	600959	江苏有线	127,300	426,455.00	0.29
23	600928	西安银行	117,600	424,536.00	0.29
24	601108	财通证券	51,100	417,487.00	0.28
25	600998	九州通	79,300	406,016.00	0.28
26	300447	全信股份	28,600	405,262.00	0.28
27	600096	云天化	17,700	394,710.00	0.27
28	600299	安迪苏	31,400	394,070.00	0.27
29	002224	三力士	90,500	390,960.00	0.27
30	601919	中远海控	25,200	390,600.00	0.27
31	601279	英利汽车	101,700	389,511.00	0.27

32	300289	利德曼	78,900	386,610.00	0.26
33	600435	北方导航	39,600	386,496.00	0.26
34	002563	森马服饰	54,900	385,398.00	0.26
35	002498	汉缆股份	113,600	385,104.00	0.26
36	300866	安克创新	3,900	380,796.00	0.26
37	002550	千红制药	61,000	378,200.00	0.26
38	600050	中国联通	71,000	377,010.00	0.26
39	300002	神州泰岳	32,500	376,675.00	0.26
40	000933	神火股份	22,200	375,180.00	0.26
41	600968	海油发展	85,600	365,512.00	0.25
42	002745	木林森	41,900	365,368.00	0.25
43	600918	中泰证券	55,400	363,978.00	0.25
44	000686	东北证券	45,600	362,064.00	0.25
45	688425	铁建重工	81,000	356,400.00	0.24
46	600871	石化油服	172,800	352,512.00	0.24
47	688055	龙腾光电	85,000	351,050.00	0.24
48	600219	南山铝业	89,200	348,772.00	0.24
49	000783	长江证券	51,000	347,820.00	0.24
50	002465	海格通信	31,500	345,870.00	0.24
51	000166	申万宏源	62,800	335,980.00	0.23
52	000825	太钢不锈	96,400	335,472.00	0.23
53	600827	百联股份	30,500	333,365.00	0.23
54	601168	西部矿业	20,600	331,042.00	0.23
55	601528	瑞丰银行	58,400	328,792.00	0.22
56	603577	汇金通	41,000	327,590.00	0.22
57	002797	第一创业	39,200	327,320.00	0.22
58	601319	中国人保	42,900	326,898.00	0.22
59	600109	国金证券	36,900	322,137.00	0.22
60	300433	蓝思科技	14,600	319,740.00	0.22
61	603893	瑞芯微	2,900	319,174.00	0.22
62	600517	国网英大	57,700	317,927.00	0.22

63	603799	华友钴业	10,800	316,008.00	0.22
64	601318	中国平安	6,000	315,900.00	0.22
65	601899	紫金矿业	20,800	314,496.00	0.21
66	002109	兴化股份	98,900	313,513.00	0.21
67	002595	豪迈科技	6,200	311,178.00	0.21
68	300682	朗新集团	25,400	309,880.00	0.21
69	000776	广发证券	19,100	309,611.00	0.21
70	601568	北元集团	73,700	309,540.00	0.21
71	601158	重庆水务	62,900	308,210.00	0.21
72	600610	中毅达	72,300	305,829.00	0.21
73	002544	普天科技	14,200	304,306.00	0.21
74	000750	国海证券	70,900	303,452.00	0.21
75	600488	津药药业	71,300	302,312.00	0.21
76	688122	西部超导	7,057	302,180.74	0.21
77	002625	光启技术	6,300	301,140.00	0.21
78	002522	浙江众成	77,000	301,070.00	0.21
79	000032	深桑达 A	17,000	299,880.00	0.20
80	600688	上海石化	99,100	299,282.00	0.20
81	301165	锐捷网络	4,100	296,020.00	0.20
82	002330	得利斯	67,600	295,412.00	0.20
83	600956	新天绿能	39,100	294,814.00	0.20
84	002881	美格智能	9,800	293,608.00	0.20
85	600237	铜峰电子	44,800	293,440.00	0.20
86	601162	天风证券	65,400	292,992.00	0.20
87	002261	拓维信息	16,000	292,960.00	0.20
88	600418	江淮汽车	7,700	288,750.00	0.20
89	000423	东阿阿胶	4,600	288,512.00	0.20
90	000509	华塑控股	86,100	286,713.00	0.20
91	000559	万向钱潮	45,800	281,670.00	0.19
92	002686	亿利达	51,900	278,184.00	0.19
93	000877	天山股份	49,100	277,906.00	0.19

94	300317	珈伟新能	75,600	277,452.00	0.19
95	600892	大晟文化	75,100	277,119.00	0.19
96	002970	锐明技术	5,800	276,254.00	0.19
97	603699	纽威股份	12,400	274,908.00	0.19
98	601211	国泰君安	14,700	274,155.00	0.19
99	300628	亿联网络	7,100	274,060.00	0.19
100	600655	豫园股份	42,600	273,918.00	0.19
101	601717	郑煤机	21,000	272,580.00	0.19
102	002001	新和成	12,300	270,231.00	0.18
103	000156	华数传媒	37,400	269,280.00	0.18
104	600066	宇通客车	10,200	269,076.00	0.18
105	000404	长虹华意	36,200	267,880.00	0.18
106	000060	中金岭南	57,100	267,799.00	0.18
107	600663	陆家嘴	26,900	264,696.00	0.18
108	600271	航天信息	29,000	264,190.00	0.18
109	600084	中信尼雅	50,000	263,000.00	0.18
110	600030	中信证券	9,000	262,530.00	0.18
111	600563	法拉电子	2,200	261,624.00	0.18
112	002557	洽洽食品	9,000	261,450.00	0.18
113	000528	柳工	21,600	260,496.00	0.18
114	000607	华媒控股	70,000	259,700.00	0.18
115	688018	乐鑫科技	1,180	257,240.00	0.18
116	300525	博思软件	16,500	257,070.00	0.18
117	600166	福田汽车	102,300	256,773.00	0.17
118	000039	中集集团	33,000	256,410.00	0.17
119	603601	再升科技	76,200	256,032.00	0.17
120	688509	正元地信	64,468	255,937.96	0.17
121	002228	合兴包装	85,300	255,900.00	0.17
122	000333	美的集团	3,400	255,748.00	0.17
123	603707	健友股份	19,200	254,784.00	0.17
124	002585	双星新材	47,500	253,650.00	0.17

125	000701	厦门信达	55,500	253,635.00	0.17
126	600383	金地集团	57,700	252,726.00	0.17
127	688798	艾为电子	3,616	252,469.12	0.17
128	688779	五矿新能	47,400	252,168.00	0.17
129	600718	东软集团	23,100	248,787.00	0.17
130	600900	长江电力	8,400	248,220.00	0.17
131	600320	振华重工	62,300	244,216.00	0.17
132	601098	中南传媒	16,000	240,160.00	0.16
133	002636	金安国纪	31,000	239,940.00	0.16
134	603256	宏和科技	28,600	238,810.00	0.16
135	600516	方大炭素	49,400	238,602.00	0.16
136	601958	金钼股份	23,400	235,404.00	0.16
137	002185	华天科技	20,200	234,522.00	0.16
138	601877	正泰电器	10,000	234,100.00	0.16
139	300140	节能环保	39,000	233,610.00	0.16
140	300737	科顺股份	46,000	233,220.00	0.16
141	300972	万辰集团	2,900	233,189.00	0.16
142	600707	彩虹股份	28,300	232,626.00	0.16
143	301267	华夏眼科	12,200	232,288.00	0.16
144	601137	博威合金	11,400	231,420.00	0.16
145	300244	迪安诊断	20,300	230,405.00	0.16
146	300394	天孚通信	2,500	228,400.00	0.16
147	688208	道通科技	5,800	227,128.00	0.15
148	600642	申能股份	23,800	225,862.00	0.15
149	002678	珠江钢琴	50,400	225,288.00	0.15
150	603600	永艺股份	18,900	224,721.00	0.15
151	000401	冀东水泥	42,900	224,367.00	0.15
152	002867	周大生	15,400	223,762.00	0.15
153	002202	金风科技	21,600	223,128.00	0.15
154	000967	盈峰环境	44,700	222,159.00	0.15
155	688772	珠海冠宇	13,800	221,904.00	0.15



156	600103	青山纸业	86,300	220,928.00	0.15
157	601665	齐鲁银行	39,400	220,246.00	0.15
158	002608	江苏国信	28,700	220,129.00	0.15
159	601288	农业银行	41,000	218,940.00	0.15
160	603508	思维列控	9,200	218,776.00	0.15
161	688550	瑞联新材	6,976	218,279.04	0.15
162	601398	工商银行	31,500	217,980.00	0.15
163	600691	阳煤化工	98,100	217,782.00	0.15
164	300034	钢研高纳	13,900	216,840.00	0.15
165	001914	招商积余	20,500	216,685.00	0.15
166	002609	捷顺科技	26,200	216,412.00	0.15
167	600528	中铁工业	26,800	216,008.00	0.15
168	603697	有友食品	21,200	215,816.00	0.15
169	000997	新大陆	10,800	215,460.00	0.15
170	600419	天润乳业	23,100	215,061.00	0.15
171	600268	国电南自	32,000	215,040.00	0.15
172	002517	恺英网络	15,800	215,038.00	0.15
173	600018	上港集团	35,100	214,812.00	0.15
174	000932	华菱钢铁	51,300	214,434.00	0.15
175	603228	景旺电子	7,700	214,368.00	0.15
176	600578	京能电力	60,700	213,664.00	0.15
177	002863	今飞凯达	46,000	213,440.00	0.15
178	000655	金岭矿业	34,700	213,405.00	0.15
179	600167	联美控股	37,200	213,156.00	0.15
180	000061	农产品	30,400	213,104.00	0.15
181	603201	常润股份	12,600	213,066.00	0.15
182	002385	大北农	49,200	213,036.00	0.15
183	002653	海思科	6,400	212,800.00	0.14
184	603173	福斯达	9,200	212,060.00	0.14
185	300253	卫宁健康	29,600	211,936.00	0.14
186	601218	吉鑫科技	65,000	211,900.00	0.14

187	600681	百川能源	60,500	211,750.00	0.14
188	000728	国元证券	25,300	211,508.00	0.14
189	002688	金河生物	47,300	211,431.00	0.14
190	002056	横店东磁	16,300	211,248.00	0.14
191	000921	海信家电	7,300	210,970.00	0.14
192	300475	香农芯创	7,400	210,826.00	0.14
193	000800	一汽解放	25,700	210,740.00	0.14
194	601608	中信重工	50,100	210,420.00	0.14
195	000100	TCL科技	41,800	210,254.00	0.14
196	000063	中兴通讯	5,200	210,080.00	0.14
197	601518	吉林高速	75,500	209,890.00	0.14
198	300821	东岳硅材	26,900	208,744.00	0.14
199	688981	中芯国际	2,200	208,164.00	0.14
200	002475	立讯精密	5,100	207,876.00	0.14
201	002446	盛路通信	31,700	207,635.00	0.14
202	600169	太原重工	83,300	207,417.00	0.14
203	000892	欢瑞世纪	63,400	206,684.00	0.14
204	600651	飞乐音响	49,800	206,172.00	0.14
205	605138	盛泰集团	37,000	204,240.00	0.14
206	603129	春风动力	1,300	204,191.00	0.14
207	002573	清新环境	51,200	203,776.00	0.14
208	002035	华帝股份	27,600	202,584.00	0.14
209	300724	捷佳伟创	3,200	202,272.00	0.14
210	300259	新天科技	57,600	201,600.00	0.14
211	002384	东山精密	6,900	201,480.00	0.14
212	300513	恒实科技	22,000	200,860.00	0.14
213	300404	博济医药	23,000	200,790.00	0.14
214	000790	华神科技	51,400	200,460.00	0.14
215	002132	恒星科技	73,000	200,020.00	0.14
216	300110	华仁药业	56,800	199,936.00	0.14
217	300111	向日葵	61,700	199,908.00	0.14

218	002003	伟星股份	14,100	199,797.00	0.14
219	002027	分众传媒	28,400	199,652.00	0.14
220	300558	贝达药业	3,700	199,541.00	0.14
221	002758	浙农股份	22,800	199,500.00	0.14
222	688408	中信博	2,763	198,936.00	0.14
223	300604	长川科技	4,500	198,585.00	0.14
224	600173	卧龙地产	50,100	198,396.00	0.14
225	002594	比亚迪	700	197,862.00	0.13
226	600252	中恒集团	80,100	197,046.00	0.13
227	600862	中航高科	7,800	197,028.00	0.13
228	600820	隧道股份	27,400	197,006.00	0.13
229	600935	华塑股份	78,100	196,812.00	0.13
230	600390	五矿资本	30,500	196,725.00	0.13
231	601678	滨化股份	52,200	196,272.00	0.13
232	600710	苏美达	21,100	196,230.00	0.13
233	002241	歌尔股份	7,600	196,156.00	0.13
234	000078	海王生物	76,500	195,075.00	0.13
235	300434	金石亚药	23,600	194,700.00	0.13
236	300185	通裕重工	75,600	194,292.00	0.13
237	601388	怡球资源	78,700	193,602.00	0.13
238	300190	维尔利	55,000	193,050.00	0.13
239	300389	艾比森	16,200	192,942.00	0.13
240	603113	金能科技	34,100	191,983.00	0.13
241	002368	太极股份	8,100	191,808.00	0.13
242	600981	汇鸿集团	74,300	191,694.00	0.13
243	600536	中国软件	4,100	191,429.00	0.13
244	600143	金发科技	22,100	190,944.00	0.13
245	002263	大东南	76,400	189,472.00	0.13
246	301015	百洋医药	7,800	188,838.00	0.13
247	601886	江河集团	34,900	188,460.00	0.13
248	000931	中关村	39,500	188,020.00	0.13

249	002788	鹭燕医药	22,900	188,009.00	0.13
250	301236	软通动力	3,200	187,872.00	0.13
251	300643	万通智控	15,700	187,772.00	0.13
252	002554	惠博普	74,600	187,246.00	0.13
253	000959	首钢股份	61,300	186,965.00	0.13
254	600191	华资实业	27,000	186,840.00	0.13
255	300750	宁德时代	700	186,200.00	0.13
256	002156	通富微电	6,300	186,165.00	0.13
257	300239	东宝生物	29,700	185,922.00	0.13
258	002099	海翔药业	35,900	185,244.00	0.13
259	603609	禾丰股份	21,300	183,606.00	0.13
260	300696	爱乐达	11,800	183,254.00	0.12
261	002418	康盛股份	74,800	182,512.00	0.12
262	688009	中国通号	29,000	181,540.00	0.12
263	000751	锌业股份	64,300	180,683.00	0.12
264	002439	启明星辰	11,400	180,348.00	0.12
265	300512	中亚股份	26,200	178,422.00	0.12
266	002214	大立科技	15,900	177,285.00	0.12
267	600000	浦发银行	17,200	176,988.00	0.12
268	300145	中金环境	47,500	176,225.00	0.12
269	002683	广东宏大	6,600	174,768.00	0.12
270	000807	云铝股份	12,900	174,537.00	0.12
271	002996	顺博合金	26,190	173,901.60	0.12
272	601825	沪农商行	20,400	173,604.00	0.12
273	605166	聚合顺	14,400	172,368.00	0.12
274	601857	中国石油	19,200	171,648.00	0.12
275	600428	中远海特	23,500	171,550.00	0.12
276	300910	瑞丰新材	3,600	171,324.00	0.12
277	300048	合康新能	33,900	170,856.00	0.12
278	601228	广州港	50,300	170,517.00	0.12
279	601728	中国电信	23,600	170,392.00	0.12

280	601616	广电电气	38,800	170,332.00	0.12
281	300529	健帆生物	5,800	170,172.00	0.12
282	002025	航天电器	3,500	169,960.00	0.12
283	002648	卫星化学	9,000	169,110.00	0.12
284	002078	太阳纸业	11,300	168,031.00	0.11
285	002935	天奥电子	10,400	167,440.00	0.11
286	300708	聚灿光电	13,400	167,366.00	0.11
287	600958	东方证券	15,800	166,848.00	0.11
288	603708	家家悦	14,600	166,294.00	0.11
289	000539	粤电力A	36,600	165,798.00	0.11
290	600036	招商银行	4,200	165,060.00	0.11
291	600261	阳光照明	50,400	164,808.00	0.11
292	002363	隆基机械	25,000	164,250.00	0.11
293	600496	精工钢构	54,300	163,986.00	0.11
294	001208	华菱线缆	18,000	163,440.00	0.11
295	002372	伟星新材	12,900	162,927.00	0.11
296	603408	建霖家居	13,000	162,890.00	0.11
297	300699	光威复材	4,700	162,855.00	0.11
298	600861	北京人力	8,400	162,540.00	0.11
299	600489	中金黄金	13,500	162,405.00	0.11
300	600216	浙江医药	10,200	161,772.00	0.11
301	605117	德业股份	1,900	161,120.00	0.11
302	600101	明星电力	18,300	161,040.00	0.11
303	603055	台华新材	14,500	160,660.00	0.11
304	688127	蓝特光学	5,920	160,432.00	0.11
305	601965	中国汽研	9,100	160,342.00	0.11
306	301187	欧圣电气	4,700	160,270.00	0.11
307	603986	兆易创新	1,500	160,200.00	0.11
308	605066	天正电气	26,600	160,132.00	0.11
309	600500	中化国际	39,700	159,594.00	0.11
310	002726	龙大美食	20,100	159,192.00	0.11

311	601336	新华保险	3,200	159,040.00	0.11
312	002508	老板电器	7,400	158,582.00	0.11
313	600873	梅花生物	15,800	158,474.00	0.11
314	300777	中简科技	5,600	158,424.00	0.11
315	603737	三棵树	3,700	157,620.00	0.11
316	601985	中国核电	15,100	157,493.00	0.11
317	688588	凌志软件	11,400	157,320.00	0.11
318	601898	中煤能源	12,900	157,122.00	0.11
319	002340	格林美	24,000	156,720.00	0.11
320	688332	中科蓝讯	1,200	156,600.00	0.11
321	603858	步长制药	9,900	156,420.00	0.11
322	002371	北方华创	400	156,400.00	0.11
323	300674	宇信科技	8,000	156,160.00	0.11
324	605305	中际联合	5,500	155,815.00	0.11
325	002044	美年健康	33,900	155,601.00	0.11
326	002306	中科云网	54,000	155,520.00	0.11
327	002064	华峰化学	19,000	155,420.00	0.11
328	002180	纳思达	5,500	154,935.00	0.11
329	002352	顺丰控股	3,800	153,140.00	0.10
330	600519	贵州茅台	100	152,400.00	0.10
331	000630	铜陵有色	46,800	151,164.00	0.10
332	603993	洛阳钼业	22,700	150,955.00	0.10
333	000977	浪潮信息	2,900	150,452.00	0.10
334	601866	中远海发	57,400	149,814.00	0.10
335	688041	海光信息	1,000	149,790.00	0.10
336	300474	景嘉微	1,600	149,584.00	0.10
337	688281	华秦科技	1,600	148,960.00	0.10
338	688617	惠泰医疗	400	148,932.00	0.10
339	600330	天通股份	20,800	147,680.00	0.10
340	600236	桂冠电力	21,700	147,560.00	0.10
341	002203	海亮股份	13,700	147,275.00	0.10

342	600369	西南证券	31,500	147,105.00	0.10
343	600848	上海临港	14,500	146,450.00	0.10
344	600906	财达证券	20,500	145,550.00	0.10
345	688606	奥泰生物	2,288	144,830.40	0.10
346	300455	航天智装	11,000	142,560.00	0.10
347	000517	荣安地产	63,800	142,274.00	0.10
348	000758	中色股份	28,400	140,296.00	0.10
349	688019	安集科技	1,000	139,360.00	0.09
350	600433	冠豪高新	43,800	138,846.00	0.09
351	688005	容百科技	4,400	138,820.00	0.09
352	000761	本钢板材	43,200	138,240.00	0.09
353	601018	宁波港	35,800	137,830.00	0.09
354	601600	中国铝业	18,700	137,445.00	0.09
355	600758	辽宁能源	39,900	137,256.00	0.09
356	688083	中望软件	1,600	136,912.00	0.09
357	600266	城建发展	26,800	136,680.00	0.09
358	002353	杰瑞股份	3,600	133,164.00	0.09
359	601601	中国太保	3,900	132,912.00	0.09
360	300212	易华录	5,600	131,040.00	0.09
361	002361	神剑股份	24,000	130,800.00	0.09
362	603979	金诚信	3,600	130,680.00	0.09
363	600909	华安证券	21,400	129,684.00	0.09
364	300705	九典制药	7,200	129,240.00	0.09
365	600416	湘电股份	11,300	127,577.00	0.09
366	000966	长源电力	26,800	127,300.00	0.09
367	600885	宏发股份	4,000	127,280.00	0.09
368	003035	南网能源	30,400	127,072.00	0.09
369	002850	科达利	1,300	126,984.00	0.09
370	601068	中铝国际	28,400	125,244.00	0.09
371	002100	天康生物	19,100	125,105.00	0.09
372	605080	浙江自然	5,300	124,550.00	0.08

373	002294	信立泰	4,000	123,720.00	0.08
374	600141	兴发集团	5,700	123,690.00	0.08
375	600329	达仁堂	4,000	123,200.00	0.08
376	600792	云煤能源	32,800	122,672.00	0.08
377	002831	裕同科技	4,500	121,950.00	0.08
378	300485	赛升药业	17,300	121,273.00	0.08
379	603766	隆鑫通用	13,300	121,030.00	0.08
380	002552	宝鼎科技	9,200	120,704.00	0.08
381	600612	老凤祥	2,200	119,394.00	0.08
382	002127	南极电商	26,900	118,360.00	0.08
383	300697	电工合金	9,300	117,273.00	0.08
384	600803	新奥股份	5,400	117,072.00	0.08
385	601567	三星医疗	3,800	116,888.00	0.08
386	000729	燕京啤酒	9,700	116,788.00	0.08
387	300059	东方财富	4,500	116,190.00	0.08
388	600449	宁夏建材	7,700	115,654.00	0.08
389	603259	药明康德	2,100	115,584.00	0.08
390	601801	皖新传媒	15,700	115,238.00	0.08
391	600035	楚天高速	25,000	115,000.00	0.08
392	600315	上海家化	6,800	114,988.00	0.08
393	002034	旺能环境	7,400	114,700.00	0.08
394	603169	兰石重装	21,000	114,450.00	0.08
395	600177	雅戈尔	12,800	113,920.00	0.08
396	601231	环旭电子	6,900	113,850.00	0.08
397	000738	航发控制	5,100	113,424.00	0.08
398	605388	均瑶健康	18,000	113,220.00	0.08
399	601088	中国神华	2,600	113,048.00	0.08
400	603558	健盛集团	10,500	112,980.00	0.08
401	002860	星帅尔	11,500	112,815.00	0.08
402	600794	保税科技	31,000	112,530.00	0.08
403	002916	深南电路	900	112,500.00	0.08



404	002991	甘源食品	1,200	112,224.00	0.08
405	002032	苏泊尔	2,100	111,741.00	0.08
406	603565	中谷物流	11,400	111,720.00	0.08
407	603890	春秋电子	9,500	111,625.00	0.08
408	601377	兴业证券	17,800	111,428.00	0.08
409	603166	福达股份	15,300	111,231.00	0.08
410	600064	南京高科	14,300	111,111.00	0.08
411	002966	苏州银行	13,700	111,107.00	0.08
412	600057	厦门象屿	17,100	110,979.00	0.08
413	600248	陕建股份	24,700	110,656.00	0.08
414	002851	麦格米特	1,800	110,628.00	0.08
415	601339	百隆东方	20,300	110,432.00	0.08
416	002546	新联电子	25,500	110,415.00	0.08
417	002637	赞宇科技	11,200	110,320.00	0.08
418	300021	大禹节水	27,100	110,297.00	0.08
419	002946	新乳业	7,600	110,276.00	0.08
420	002533	金杯电工	11,200	110,208.00	0.08
421	300979	华利集团	1,400	110,110.00	0.08
422	002238	天威视讯	13,700	110,011.00	0.07
423	600583	海油工程	20,100	109,947.00	0.07
424	603678	火炬电子	3,600	109,800.00	0.07
425	605018	长华集团	12,500	109,750.00	0.07
426	600372	中航机载	8,900	109,737.00	0.07
427	600497	驰宏锌锗	19,700	109,729.00	0.07
428	603338	浙江鼎力	1,700	109,684.00	0.07
429	601156	东航物流	6,500	109,655.00	0.07
430	603156	养元饮品	4,800	109,632.00	0.07
431	600755	厦门国贸	16,500	109,560.00	0.07
432	600511	国药股份	3,200	109,504.00	0.07
433	002483	润邦股份	21,000	109,410.00	0.07
434	002043	兔宝宝	9,200	109,296.00	0.07

435	688777	中控技术	2,200	109,274.00	0.07
436	002218	拓日新能	27,500	109,175.00	0.07
437	002531	天顺风能	13,800	109,158.00	0.07
438	600021	上海电力	11,900	109,123.00	0.07
439	600006	东风股份	14,800	109,076.00	0.07
440	300360	炬华科技	6,500	109,005.00	0.07
441	600795	国电电力	23,800	109,004.00	0.07
442	600062	华润双鹤	5,500	108,900.00	0.07
443	000885	城发环境	8,300	108,813.00	0.07
444	000001	平安银行	9,300	108,810.00	0.07
445	000930	中粮科技	19,600	108,780.00	0.07
446	601002	晋亿实业	25,000	108,750.00	0.07
447	603077	和邦生物	53,300	108,732.00	0.07
448	600887	伊利股份	3,600	108,648.00	0.07
449	002299	圣农发展	7,500	108,600.00	0.07
450	002984	森麒麟	4,400	108,504.00	0.07
451	600662	外服控股	21,400	108,498.00	0.07
452	600535	天士力	7,500	108,450.00	0.07
453	600073	光明肉业	15,600	108,264.00	0.07
454	001332	锡装股份	3,100	108,252.00	0.07
455	601099	太平洋	25,400	108,204.00	0.07
456	600380	健康元	9,600	108,192.00	0.07
457	600690	海尔智家	3,800	108,186.00	0.07
458	601456	国联证券	8,000	108,160.00	0.07
459	600352	浙江龙盛	10,500	108,045.00	0.07
460	001227	兰州银行	43,900	107,994.00	0.07
461	002255	海陆重工	19,400	107,864.00	0.07
462	600731	湖南海利	18,900	107,730.00	0.07
463	605333	沪光股份	3,300	107,679.00	0.07
464	601138	工业富联	5,000	107,500.00	0.07
465	002579	中京电子	13,600	107,440.00	0.07

466	300498	温氏股份	6,500	107,315.00	0.07
467	000541	佛山照明	17,300	107,260.00	0.07
468	600521	华海药业	6,000	107,220.00	0.07
469	301332	德尔玛	10,700	107,214.00	0.07
470	600967	内蒙一机	12,600	107,100.00	0.07
470	000672	上峰水泥	14,000	107,100.00	0.07
471	600637	东方明珠	13,800	107,088.00	0.07
472	002463	沪电股份	2,700	107,055.00	0.07
473	600664	哈药股份	25,900	106,967.00	0.07
474	603538	美诺华	8,400	106,764.00	0.07
475	002852	道道全	12,900	106,554.00	0.07
476	601016	节能风电	33,600	106,512.00	0.07
477	600618	氯碱化工	10,800	106,488.00	0.07
478	600118	中国卫星	3,900	106,470.00	0.07
479	605398	新炬网络	4,900	106,428.00	0.07
480	002707	众信旅游	14,400	106,416.00	0.07
481	002905	金逸影视	13,500	106,380.00	0.07
482	600737	中粮糖业	10,400	106,184.00	0.07
483	300677	英科医疗	4,200	106,176.00	0.07
484	600660	福耀玻璃	1,700	106,080.00	0.07
485	603599	广信股份	8,800	106,040.00	0.07
486	002432	九安医疗	2,600	106,028.00	0.07
487	000422	湖北宜化	8,400	106,008.00	0.07
488	603595	东尼电子	6,200	105,958.00	0.07
489	002301	齐心集团	14,900	105,939.00	0.07
490	300453	三鑫医疗	14,200	105,932.00	0.07
491	603087	甘李药业	2,400	105,840.00	0.07
492	300587	天铁股份	24,100	105,799.00	0.07
493	002938	鹏鼎控股	2,900	105,792.00	0.07
494	002300	太阳电缆	19,800	105,732.00	0.07
495	600977	中国电影	9,100	105,651.00	0.07

496	603676	卫信康	10,600	105,470.00	0.07
497	600509	天富能源	16,300	105,461.00	0.07
498	300827	上能电气	2,400	105,360.00	0.07
498	300001	特锐德	4,800	105,360.00	0.07
499	301389	隆扬电子	6,300	105,336.00	0.07
500	300487	蓝晓科技	2,200	105,314.00	0.07
501	600403	大有能源	35,800	105,252.00	0.07
502	002912	中新赛克	4,100	104,919.00	0.07
503	688553	汇宇制药	6,901	104,895.20	0.07
504	300685	艾德生物	4,600	104,880.00	0.07
505	603298	杭叉集团	5,860	104,835.40	0.07
506	300919	中伟股份	2,900	104,748.00	0.07
507	688312	燕麦科技	3,400	104,720.00	0.07
508	603598	引力传媒	6,200	104,718.00	0.07
509	300903	科翔股份	13,100	104,669.00	0.07
510	000560	我爱我家	34,300	104,615.00	0.07
511	002459	晶澳科技	7,600	104,500.00	0.07
512	000978	桂林旅游	17,300	104,492.00	0.07
513	300641	正丹股份	4,200	104,328.00	0.07
514	301218	华是科技	4,800	104,304.00	0.07
515	688052	纳芯微	800	104,240.00	0.07
516	001283	豪鹏科技	1,800	104,202.00	0.07
517	600377	宁沪高速	6,800	104,108.00	0.07
518	301031	中熔电气	1,000	104,020.00	0.07
519	601577	长沙银行	11,700	104,013.00	0.07
520	600131	国网信通	5,500	104,005.00	0.07
521	300285	国瓷材料	6,100	103,944.00	0.07
522	300251	光线传媒	11,000	103,840.00	0.07
523	000798	中水渔业	14,000	103,740.00	0.07
524	300752	隆利科技	6,100	103,700.00	0.07
524	000026	飞亚达	10,000	103,700.00	0.07

525	002373	千方科技	10,200	103,428.00	0.07
526	000636	风华高科	7,200	103,320.00	0.07
527	003022	联泓新科	7,500	103,275.00	0.07
528	301301	川宁生物	8,700	103,182.00	0.07
529	688508	芯朋微	2,400	103,128.00	0.07
530	003005	竞业达	3,800	103,056.00	0.07
531	600546	山煤国际	8,700	102,921.00	0.07
532	688209	英集芯	5,800	102,486.00	0.07
532	002250	联化科技	18,600	102,486.00	0.07
533	002265	建设工业	4,400	102,388.00	0.07
534	600970	中材国际	10,800	102,384.00	0.07
535	600729	重庆百货	3,500	102,375.00	0.07
536	002493	荣盛石化	11,300	102,265.00	0.07
537	603927	中科软	4,700	101,990.00	0.07
538	601311	骆驼股份	12,300	101,967.00	0.07
539	002635	安洁科技	6,400	101,888.00	0.07
540	300570	太辰光	1,400	101,780.00	0.07
541	300357	我武生物	5,000	101,600.00	0.07
542	600487	亨通光电	5,900	101,598.00	0.07
543	605358	立昂微	4,100	101,557.00	0.07
544	600988	赤峰黄金	6,500	101,465.00	0.07
545	002252	上海莱士	14,000	101,080.00	0.07
546	000030	富奥股份	19,700	101,061.00	0.07
547	601229	上海银行	11,000	100,650.00	0.07
548	000848	承德露露	11,200	100,464.00	0.07
549	688276	百克生物	4,000	100,440.00	0.07
550	002540	亚太科技	16,300	100,408.00	0.07
551	600649	城投控股	22,500	100,125.00	0.07
552	301050	雷电微力	1,940	100,065.20	0.07
553	603920	世运电路	3,400	99,960.00	0.07
554	601615	明阳智能	7,900	99,619.00	0.07

555	600478	科力远	24,100	99,533.00	0.07
556	000603	盛达资源	8,300	99,517.00	0.07
557	002617	露笑科技	13,000	99,450.00	0.07
558	605499	东鹏饮料	400	99,408.00	0.07
559	300761	立华股份	5,100	99,246.00	0.07
560	300568	星源材质	10,200	99,144.00	0.07
561	601113	华鼎股份	25,400	99,060.00	0.07
562	300308	中际旭创	800	98,808.00	0.07
563	300533	冰川网络	5,000	98,800.00	0.07
564	300088	长信科技	15,100	98,754.00	0.07
565	688349	三一重能	3,195	98,661.60	0.07
566	688472	阿特斯	7,800	97,968.00	0.07
567	000875	吉电股份	18,600	97,836.00	0.07
568	600798	宁波海运	32,200	97,566.00	0.07
569	603712	七一二	5,000	97,350.00	0.07
570	600467	好当家	42,100	97,251.00	0.07
571	002908	德生科技	11,100	97,236.00	0.07
572	688578	艾力斯	1,621	97,097.90	0.07
573	300440	运达科技	12,200	96,624.00	0.07
574	601700	风范股份	21,400	96,300.00	0.07
575	600061	国投资本	12,800	96,256.00	0.07
576	688172	燕东微	4,800	96,240.00	0.07
577	300870	欧陆通	900	96,102.00	0.07
578	002391	长青股份	19,100	95,691.00	0.07
579	600985	淮北矿业	6,800	95,676.00	0.07
580	300241	瑞丰光电	17,400	95,526.00	0.07
581	601225	陕西煤业	4,100	95,366.00	0.06
582	002506	协鑫集成	35,700	95,319.00	0.06
583	301025	读客文化	10,000	95,300.00	0.06
584	688223	晶科能源	13,400	95,274.00	0.06
585	301358	湖南裕能	2,100	95,172.00	0.06

586	002060	广东建工	26,000	95,160.00	0.06
587	603322	超讯通信	2,500	95,000.00	0.06
588	688468	科美诊断	13,862	94,954.70	0.06
589	300369	绿盟科技	13,200	94,908.00	0.06
590	002343	慈文传媒	15,300	94,860.00	0.06
591	601058	赛轮轮胎	6,600	94,578.00	0.06
592	688183	生益电子	2,400	94,224.00	0.06
593	603019	中科曙光	1,300	94,016.00	0.06
594	688301	奕瑞科技	983	93,945.31	0.06
595	300230	永利股份	21,100	93,895.00	0.06
596	000926	福星股份	36,800	93,840.00	0.06
597	000895	双汇发展	3,600	93,456.00	0.06
598	601799	星宇股份	700	93,436.00	0.06
599	603966	法兰泰克	12,100	93,412.00	0.06
600	000999	华润三九	2,100	93,114.00	0.06
601	600295	鄂尔多斯	9,500	92,720.00	0.06
602	600582	天地科技	15,000	92,700.00	0.06
603	600255	鑫科材料	27,100	92,682.00	0.06
604	301004	嘉益股份	800	92,520.00	0.06
605	601015	陕西黑猫	27,700	92,518.00	0.06
606	002969	嘉美包装	29,600	92,056.00	0.06
607	688313	仕佳光子	5,600	91,784.00	0.06
608	002670	国盛金控	7,000	91,630.00	0.06
609	301090	华润材料	13,200	91,608.00	0.06
610	600617	国新能源	33,900	91,530.00	0.06
611	600392	盛和资源	8,900	91,492.00	0.06
612	600499	科达制造	11,700	91,260.00	0.06
613	603162	海通发展	9,900	91,080.00	0.06
614	603885	吉祥航空	6,600	90,420.00	0.06
615	600585	海螺水泥	3,800	90,364.00	0.06
616	000066	中国长城	6,200	90,334.00	0.06

617	301149	隆华新材	9,100	89,999.00	0.06
618	605376	博迁新材	3,100	89,745.00	0.06
619	600815	厦工股份	33,800	89,570.00	0.06
620	000709	河钢股份	40,400	89,284.00	0.06
621	003031	中瓷电子	1,700	89,063.00	0.06
622	600031	三一重工	5,400	88,992.00	0.06
623	002329	皇氏集团	24,500	88,935.00	0.06
624	002212	天融信	13,600	87,720.00	0.06
625	600386	北巴传媒	19,600	87,612.00	0.06
626	600961	株冶集团	11,100	87,357.00	0.06
627	605188	国光连锁	11,300	86,332.00	0.06
628	300033	同花顺	300	86,250.00	0.06
629	688685	迈信林	2,571	85,331.49	0.06
630	002666	德联集团	19,400	84,584.00	0.06
631	000897	津滨发展	35,500	84,135.00	0.06
632	601019	山东出版	7,400	83,990.00	0.06
633	600867	通化东宝	10,400	83,824.00	0.06
634	603612	索通发展	6,200	83,762.00	0.06
635	600067	冠城新材	31,600	83,740.00	0.06
636	600019	宝钢股份	11,900	83,300.00	0.06
637	600339	中油工程	23,200	83,056.00	0.06
638	002408	齐翔腾达	16,200	81,486.00	0.06
639	002019	亿帆医药	7,600	81,472.00	0.06
640	000960	锡业股份	5,800	81,374.00	0.06
641	002400	省广集团	10,100	80,699.00	0.05
642	001872	招商港口	3,900	79,833.00	0.05
643	600562	国睿科技	4,000	79,720.00	0.05
644	601696	中银证券	7,100	79,236.00	0.05
645	002430	杭氧股份	3,600	78,480.00	0.05
646	000723	美锦能源	17,100	77,121.00	0.05
647	600996	贵广网络	9,000	76,950.00	0.05



648	600015	华夏银行	9,600	76,896.00	0.05
649	000426	兴业银锡	6,900	76,728.00	0.05
650	002865	钧达股份	1,500	76,650.00	0.05
651	600052	东望时代	16,900	76,388.00	0.05
652	688131	皓元医药	2,134	76,183.80	0.05
653	600468	百利电气	16,200	76,140.00	0.05
654	600990	四创电子	3,500	74,480.00	0.05
655	000898	鞍钢股份	30,800	73,920.00	0.05
656	002311	海大集团	1,500	73,575.00	0.05
657	600704	物产中大	14,500	73,370.00	0.05
658	301339	通行宝	3,600	73,224.00	0.05
659	301439	泓淋电力	5,300	72,875.00	0.05
660	688050	爱博医疗	800	72,824.00	0.05
661	000957	中通客车	6,600	72,600.00	0.05
662	002390	信邦制药	15,800	71,890.00	0.05
663	002284	亚太股份	9,200	71,208.00	0.05
664	688543	国科军工	1,400	70,168.00	0.05
665	301029	怡合达	2,800	69,216.00	0.05
666	603998	方盛制药	6,600	68,772.00	0.05
667	002558	巨人网络	5,400	68,526.00	0.05
668	601226	华电科工	10,100	68,276.00	0.05
669	603158	腾龙股份	8,400	67,872.00	0.05
670	002661	克明食品	6,700	67,402.00	0.05
671	002936	郑州银行	31,800	66,780.00	0.05
672	002445	中南文化	27,000	66,150.00	0.05
673	000968	蓝焰控股	9,900	65,835.00	0.04
674	601998	中信银行	9,400	65,612.00	0.04
675	688608	恒玄科技	200	65,074.00	0.04
676	600180	瑞茂通	15,100	64,930.00	0.04
677	002738	中矿资源	1,800	63,900.00	0.04
678	300888	稳健医疗	1,500	63,120.00	0.04

679	000703	恒逸石化	10,000	62,800.00	0.04
680	300065	海兰信	7,400	60,680.00	0.04
681	300679	电连技术	1,000	59,700.00	0.04
682	300424	航新科技	3,300	59,598.00	0.04
683	601778	晶科科技	21,100	59,502.00	0.04
684	300493	润欣科技	2,100	59,073.00	0.04
685	002264	新华都	9,500	58,710.00	0.04
686	301035	润丰股份	1,200	58,464.00	0.04
687	600694	大商股份	2,200	58,014.00	0.04
688	002714	牧原股份	1,500	57,660.00	0.04
689	601298	青岛港	6,300	57,393.00	0.04
690	603989	艾华集团	3,800	57,304.00	0.04
691	600875	东方电气	3,600	57,204.00	0.04
692	002891	中宠股份	1,600	57,120.00	0.04
693	605020	永和股份	2,800	56,924.00	0.04
694	603109	神驰机电	3,200	56,800.00	0.04
695	600348	华阳股份	8,000	56,720.00	0.04
696	300832	新产业	800	56,680.00	0.04
697	688093	世华科技	2,800	56,532.00	0.04
698	603297	永新光学	600	56,292.00	0.04
699	000680	山推股份	5,800	56,260.00	0.04
700	002318	久立特材	2,400	56,184.00	0.04
701	601598	中国外运	10,500	56,175.00	0.04
702	600648	外高桥	4,700	55,977.00	0.04
703	000048	京基智农	3,100	55,800.00	0.04
704	002599	盛通股份	7,500	55,725.00	0.04
705	002468	申通快递	5,500	55,715.00	0.04
706	002476	宝莫股份	13,200	55,704.00	0.04
707	002911	佛燃能源	4,400	55,616.00	0.04
708	002401	中远海科	3,500	55,580.00	0.04
709	000975	山金国际	3,600	55,332.00	0.04

710	600183	生益科技	2,300	55,315.00	0.04
711	600438	通威股份	2,500	55,275.00	0.04
712	601083	锦江航运	5,800	55,216.00	0.04
713	600037	歌华有线	7,400	55,204.00	0.04
714	002244	滨江集团	6,400	55,104.00	0.04
715	603288	海天味业	1,200	55,080.00	0.04
716	601991	大唐发电	19,300	55,005.00	0.04
717	300232	洲明科技	8,000	54,960.00	0.04
718	002577	雷柏科技	2,900	54,897.00	0.04
719	002690	美亚光电	3,700	54,834.00	0.04
720	603337	杰克股份	1,800	54,828.00	0.04
721	688378	奥来德	2,400	54,744.00	0.04
722	600170	上海建工	20,600	54,590.00	0.04
723	000153	丰原药业	8,900	54,557.00	0.04
724	601077	渝农商行	9,000	54,450.00	0.04
725	600621	华鑫股份	3,300	54,384.00	0.04
726	603369	今世缘	1,200	54,276.00	0.04
727	002734	利民股份	6,800	54,196.00	0.04
728	000538	云南白药	900	53,955.00	0.04
729	601121	宝地矿业	7,700	53,900.00	0.04
730	300418	昆仑万维	1,400	53,872.00	0.04
731	300861	美畅股份	2,700	53,865.00	0.04
732	600027	华电国际	9,600	53,856.00	0.04
733	600346	恒力石化	3,500	53,725.00	0.04
734	603187	海容冷链	4,800	53,712.00	0.04
735	002507	涪陵榨菜	3,800	53,694.00	0.04
736	002660	茂硕电源	5,200	53,664.00	0.04
737	600153	建发股份	5,100	53,652.00	0.04
738	002747	埃斯顿	2,900	53,650.00	0.04
739	600552	凯盛科技	4,700	53,627.00	0.04
740	688132	邦彦技术	3,157	53,605.86	0.04

741	000969	安泰科技	4,800	53,520.00	0.04
742	300857	协创数据	500	53,445.00	0.04
743	001289	龙源电力	3,400	53,414.00	0.04
744	002755	奥赛康	4,200	53,382.00	0.04
745	000690	宝新能源	11,900	53,312.00	0.04
746	600161	天坛生物	2,600	53,300.00	0.04
747	300003	乐普医疗	4,700	53,298.00	0.04
748	688479	友车科技	3,000	53,250.00	0.04
749	002568	百润股份	1,900	53,219.00	0.04
750	600023	浙能电力	9,400	53,204.00	0.04
751	002230	科大讯飞	1,100	53,152.00	0.04
752	600557	康缘药业	3,900	53,118.00	0.04
753	600537	亿晶光电	17,300	53,111.00	0.04
754	688789	宏华数科	800	53,104.00	0.04
755	002768	国恩股份	2,300	53,061.00	0.04
756	002074	国轩高科	2,500	53,050.00	0.04
757	601677	明泰铝业	4,400	52,932.00	0.04
758	002393	力生制药	3,000	52,920.00	0.04
759	000938	紫光股份	1,900	52,877.00	0.04
760	603301	振德医疗	2,400	52,776.00	0.04
761	601633	长城汽车	2,000	52,660.00	0.04
762	300395	菲利华	1,400	52,654.00	0.04
763	300070	碧水源	10,400	52,624.00	0.04
764	002282	博深股份	7,100	52,611.00	0.04
765	300226	上海钢联	2,300	52,601.00	0.04
766	000034	神州数码	1,500	52,575.00	0.04
767	300770	新媒股份	1,300	52,533.00	0.04
768	301039	中集车辆	5,800	52,490.00	0.04
769	002967	广电计量	3,200	52,480.00	0.04
769	000887	中鼎股份	4,000	52,480.00	0.04
770	000400	许继电气	1,900	52,307.00	0.04

771	601169	北京银行	8,500	52,275.00	0.04
771	002906	华阳集团	1,700	52,275.00	0.04
772	603501	韦尔股份	500	52,205.00	0.04
773	600486	扬农化工	900	52,083.00	0.04
774	003000	劲仔食品	3,800	52,060.00	0.04
775	600312	平高电气	2,700	51,840.00	0.04
776	605338	巴比食品	3,000	51,810.00	0.04
777	600623	华谊集团	7,400	51,800.00	0.04
778	603688	石英股份	1,800	51,714.00	0.04
779	600481	双良节能	9,400	51,700.00	0.04
780	301376	致欧科技	2,700	51,624.00	0.04
781	300298	三诺生物	2,000	51,620.00	0.04
782	300783	三只松鼠	1,400	51,618.00	0.04
783	300482	万孚生物	2,300	51,543.00	0.04
784	002237	恒邦股份	5,100	51,510.00	0.04
785	605090	九丰能源	1,800	51,354.00	0.03
786	688117	圣诺生物	2,000	51,340.00	0.03
787	603713	密尔克卫	1,000	51,200.00	0.03
788	688336	三生国健	2,390	51,193.80	0.03
789	002812	恩捷股份	1,600	51,184.00	0.03
790	300595	欧普康视	2,700	51,165.00	0.03
791	600741	华域汽车	2,900	51,069.00	0.03
792	300760	迈瑞医疗	200	51,000.00	0.03
793	601000	唐山港	10,800	50,868.00	0.03
794	000768	中航西飞	1,800	50,832.00	0.03
795	601869	长飞光纤	1,700	50,813.00	0.03
796	605337	李子园	4,500	50,805.00	0.03
797	300973	立高食品	1,300	50,739.00	0.03
798	600595	中孚实业	17,900	50,657.00	0.03
799	300252	金信诺	4,700	50,572.00	0.03
800	300662	科锐国际	2,400	50,544.00	0.03

801	600276	恒瑞医药	1,100	50,490.00	0.03
802	603115	海星股份	3,900	50,349.00	0.03
803	001203	大中矿业	5,800	50,228.00	0.03
804	300634	彩讯股份	2,300	50,140.00	0.03
805	002534	西子洁能	4,500	49,995.00	0.03
806	600309	万华化学	700	49,945.00	0.03
807	300822	贝仕达克	2,400	49,560.00	0.03
808	688351	微电生理	2,600	49,504.00	0.03
809	688033	天宜上佳	8,600	49,450.00	0.03
810	002985	北摩高科	2,100	49,350.00	0.03
811	300378	鼎捷数智	1,900	49,153.00	0.03
812	688311	盟升电子	1,481	49,035.91	0.03
813	603680	今创集团	5,900	48,970.00	0.03
814	300999	金龙鱼	1,500	48,915.00	0.03
815	603083	剑桥科技	1,200	48,720.00	0.03
816	600722	金牛化工	10,400	48,672.00	0.03
817	603101	汇嘉时代	5,200	48,516.00	0.03
818	601236	红塔证券	5,700	48,393.00	0.03
819	605123	派克新材	900	48,384.00	0.03
820	603160	汇顶科技	600	48,324.00	0.03
821	605286	同力日升	1,600	48,256.00	0.03
822	688513	苑东生物	1,600	48,208.00	0.03
823	603218	日月股份	4,000	48,200.00	0.03
824	603658	安图生物	1,100	48,004.00	0.03
825	301155	海力风电	900	47,979.00	0.03
826	300803	指南针	500	47,975.00	0.03
827	688187	时代电气	1,000	47,920.00	0.03
828	603236	移远通信	700	47,908.00	0.03
829	301317	鑫磊股份	2,400	47,736.00	0.03
830	688029	南微医学	706	47,718.54	0.03
831	600841	动力新科	9,400	47,658.00	0.03

832	002624	完美世界	4,600	47,518.00	0.03
833	601100	恒立液压	900	47,493.00	0.03
834	688687	凯因科技	2,200	47,476.00	0.03
835	002829	星网宇达	2,500	47,400.00	0.03
836	301626	苏州天脉	718	47,230.04	0.03
837	002179	中航光电	1,200	47,160.00	0.03
838	688362	甬矽电子	1,400	47,152.00	0.03
839	002080	中材科技	3,600	47,088.00	0.03
840	300079	数码视讯	8,700	47,067.00	0.03
841	300296	利亚德	7,300	47,012.00	0.03
842	688002	睿创微纳	1,000	47,010.00	0.03
843	002281	光迅科技	900	46,953.00	0.03
844	600525	长园集团	9,600	46,848.00	0.03
845	601658	邮储银行	8,200	46,576.00	0.03
846	002601	龙佰集团	2,600	45,942.00	0.03
847	300348	长亮科技	3,200	45,760.00	0.03
848	600790	轻纺城	12,200	45,750.00	0.03
849	600399	抚顺特钢	7,800	45,240.00	0.03
850	600919	江苏银行	4,600	45,172.00	0.03
851	000831	中国稀土	1,600	44,880.00	0.03
852	600151	航天机电	5,600	44,688.00	0.03
853	002841	视源股份	1,200	44,292.00	0.03
854	002948	青岛银行	11,400	44,232.00	0.03
855	605162	新中港	6,500	44,135.00	0.03
856	600999	招商证券	2,300	44,068.00	0.03
857	002920	德赛西威	400	44,044.00	0.03
858	601702	华峰铝业	2,400	43,968.00	0.03
859	688169	石头科技	200	43,858.00	0.03
860	601928	凤凰传媒	3,800	43,852.00	0.03
861	002142	宁波银行	1,800	43,758.00	0.03
862	688253	英诺特	1,200	43,512.00	0.03

863	000998	隆平高科	3,800	42,446.00	0.03
864	000858	五粮液	300	42,012.00	0.03
865	688200	华峰测控	400	41,800.00	0.03
866	301180	万祥科技	2,700	41,769.00	0.03
867	600032	浙江新能	5,500	40,700.00	0.03
868	002004	华邦健康	9,000	40,680.00	0.03
869	600549	厦门钨业	2,100	40,467.00	0.03
870	603730	岱美股份	4,500	40,455.00	0.03
871	603596	伯特利	900	40,131.00	0.03
872	300016	北陆药业	6,400	39,680.00	0.03
873	000736	中交地产	4,600	39,560.00	0.03
874	600076	康欣新材	18,900	39,312.00	0.03
875	600636	国新文化	4,200	38,976.00	0.03
876	300659	中孚信息	2,400	38,856.00	0.03
877	002613	北玻股份	9,600	38,784.00	0.03
878	000301	东方盛虹	4,700	38,587.00	0.03
879	603308	应流股份	2,700	38,070.00	0.03
880	600641	万业企业	2,600	38,012.00	0.03
881	688025	杰普特	800	38,000.00	0.03
882	688432	有研硅	3,300	37,290.00	0.03
883	603786	科博达	600	37,080.00	0.03
884	601816	京沪高铁	6,000	36,960.00	0.03
885	002236	大华股份	2,300	36,800.00	0.03
886	002262	恩华药业	1,500	36,525.00	0.02
887	688205	德科立	400	36,400.00	0.02
888	600801	华新水泥	3,000	36,300.00	0.02
889	600863	内蒙华电	8,300	35,939.00	0.02
890	603816	顾家家居	1,300	35,854.00	0.02
891	300151	昌红科技	2,100	35,700.00	0.02
892	300393	中来股份	5,700	35,625.00	0.02
893	600215	派斯林	5,100	34,884.00	0.02



894	688521	芯原股份	665	34,865.95	0.02
895	002065	东华软件	4,800	34,848.00	0.02
896	600523	贵航股份	2,900	34,568.00	0.02
897	002342	巨力索具	10,600	34,238.00	0.02
898	300053	航宇微	2,600	34,034.00	0.02
899	605118	力鼎光电	1,900	33,839.00	0.02
900	301611	珂玛科技	599	33,603.90	0.02
901	603811	诚意药业	4,300	33,196.00	0.02
902	002240	盛新锂能	2,400	33,072.00	0.02
903	603378	亚士创能	5,100	32,742.00	0.02
904	600814	杭州解百	3,900	32,331.00	0.02
905	300073	当升科技	800	32,224.00	0.02
906	600653	申华控股	15,000	32,100.00	0.02
907	002314	南山控股	13,400	31,892.00	0.02
908	300751	迈为股份	300	31,545.00	0.02
909	300438	鹏辉能源	1,100	30,921.00	0.02
910	688599	天合光能	1,600	30,880.00	0.02
911	601918	新集能源	4,300	30,874.00	0.02
912	600200	江苏吴中	3,300	30,756.00	0.02
913	600575	淮河能源	7,700	30,569.00	0.02
914	688188	柏楚电子	157	30,497.25	0.02
915	688582	芯动联科	600	30,186.00	0.02
916	600491	龙元建设	8,000	29,920.00	0.02
917	300274	阳光电源	400	29,532.00	0.02
918	603948	建业股份	1,600	29,488.00	0.02
918	002015	协鑫能科	3,800	29,488.00	0.02
919	688658	悦康药业	2,040	29,396.40	0.02
920	603826	坤彩科技	1,500	28,875.00	0.02
921	000096	广聚能源	2,300	28,198.00	0.02
922	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.02
923	601101	昊华能源	3,400	27,982.00	0.02

924	603528	多伦科技	3,500	27,580.00	0.02
925	600095	湘财股份	3,800	27,360.00	0.02
926	300762	上海瀚讯	1,300	27,339.00	0.02
927	000651	格力电器	600	27,270.00	0.02
928	600750	江中药业	1,200	27,240.00	0.02
929	002270	华明装备	1,600	27,024.00	0.02
930	688095	福昕软件	400	26,864.00	0.02
931	688047	龙芯中科	200	26,456.00	0.02
932	002645	华宏科技	3,800	25,916.00	0.02
933	002847	盐津铺子	400	25,040.00	0.02
934	688006	杭可科技	1,400	25,004.00	0.02
935	600350	山东高速	2,400	24,672.00	0.02
936	600989	宝丰能源	1,400	23,576.00	0.02
937	300593	新雷能	2,100	23,520.00	0.02
938	301239	普瑞眼科	500	23,450.00	0.02
939	002567	唐人神	4,500	22,950.00	0.02
940	000021	深科技	1,200	22,872.00	0.02
941	688375	国博电子	458	22,606.88	0.02
942	603983	丸美生物	700	22,582.00	0.02
943	688032	禾迈股份	200	22,528.00	0.02
944	688016	心脉医疗	200	21,970.00	0.01
945	002884	凌霄泵业	1,200	21,924.00	0.01
946	601611	中国核建	2,300	20,792.00	0.01
947	601766	中国中车	2,400	20,112.00	0.01
948	603225	新凤鸣	1,800	20,034.00	0.01
949	002649	博彦科技	1,600	19,392.00	0.01
950	688475	萤石网络	600	18,114.00	0.01
951	600298	安琪酵母	500	18,025.00	0.01
952	301217	铜冠铜箔	1,600	17,728.00	0.01
953	002409	雅克科技	300	17,385.00	0.01
954	600398	海澜之家	2,300	17,250.00	0.01

955	688615	合合信息	103	17,075.34	0.01
956	688390	固德威	400	16,360.00	0.01
957	688726	拉普拉斯	490	16,199.40	0.01
958	000893	亚钾国际	800	16,128.00	0.01
959	688297	中无人机	400	16,112.00	0.01
960	600098	广州发展	2,500	16,050.00	0.01
961	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
962	301522	上大股份	627	15,574.68	0.01
963	603072	天和磁材	1,229	15,116.70	0.01
964	603197	保隆科技	400	15,100.00	0.01
965	688721	龙图光罩	264	15,008.40	0.01
966	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
967	300855	图南股份	600	13,152.00	0.01
968	688295	中复神鹰	600	11,958.00	0.01
969	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
970	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01
971	688710	益诺思	256	8,596.48	0.01
972	301552	科力装备	143	8,132.41	0.01
973	301606	绿联科技	208	7,589.92	0.01
974	001391	国货航	1,100	7,480.00	0.01
975	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.01
976	301608	博实结	104	6,799.52	0.00
977	301603	乔锋智能	154	6,464.92	0.00
978	301613	新铝时代	138	5,764.26	0.00
979	301585	蓝宇股份	156	5,592.60	0.00
980	603207	小方制药	182	4,850.30	0.00
981	603091	众鑫股份	81	3,598.83	0.00
982	603350	安乃达	91	3,291.47	0.00
983	603205	健尔康	120	3,282.00	0.00
984	603194	中力股份	113	3,178.69	0.00
985	603391	力聚热能	62	2,563.70	0.00

986	603285	键邦股份	88	1,989.68	0.00
987	603310	巍华新材	91	1,633.45	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603993	洛阳钼业	3,092,179.00	1.18
2	000651	格力电器	2,945,089.00	1.12
3	000725	京东方 A	2,937,974.00	1.12
4	002128	电投能源	2,753,548.00	1.05
5	000933	神火股份	2,717,217.00	1.04
6	000100	TCL科技	2,674,015.00	1.02
7	300274	阳光电源	2,671,537.00	1.02
8	601211	国泰君安	2,654,948.00	1.01
9	600919	江苏银行	2,644,054.00	1.01
10	688111	金山办公	2,600,774.55	0.99
11	300502	新易盛	2,542,175.00	0.97
12	603392	万泰生物	2,498,335.00	0.95
13	601919	中远海控	2,481,792.00	0.95
14	603501	韦尔股份	2,452,197.00	0.94
15	300896	爱美客	2,422,337.00	0.92
16	600887	伊利股份	2,415,192.00	0.92
17	002273	水晶光电	2,325,982.00	0.89
18	605138	盛泰集团	2,290,576.00	0.87
19	600282	南钢股份	2,266,854.00	0.86
20	000776	广发证券	2,248,961.00	0.86

##### 8.4.2 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	300308	中际旭创	3,905,157.00	1.49
2	300502	新易盛	3,769,014.00	1.44
3	601398	工商银行	3,657,818.00	1.40
4	600828	茂业商业	3,550,087.00	1.35
5	002371	北方华创	3,335,408.00	1.27
6	000725	京东方A	3,322,415.00	1.27
7	300394	天孚通信	3,280,608.00	1.25
8	300059	东方财富	3,195,778.80	1.22
9	300760	迈瑞医疗	3,127,213.00	1.19
10	000651	格力电器	3,091,443.00	1.18
11	603993	洛阳钼业	3,024,578.00	1.15
12	600030	中信证券	3,023,455.00	1.15
13	300750	宁德时代	2,984,358.00	1.14
14	300274	阳光电源	2,923,968.00	1.12
15	002594	比亚迪	2,920,588.00	1.11
16	002996	顺博合金	2,906,030.00	1.11
17	002475	立讯精密	2,876,655.00	1.10
18	601899	紫金矿业	2,826,509.00	1.08
19	300512	中亚股份	2,763,372.00	1.05
20	000933	神火股份	2,725,740.00	1.04

#### 8.4.3 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	1,249,761,753.31
卖出股票收入（成交）总额	1,348,303,481.40

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3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。

**8.5 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)	6,814.76	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,814.76	0.00

**8.6 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	127107	领益转债	54	6,814.76	0.00

注:本基金本报告期末仅持有一只债券。

**8.7 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。

**8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 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	1,988,927.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,988,927.66

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

### 8.12.6 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。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泓德智选启元混合A	750	147,552.76	1,769,581.74	1.60%	108,894,990.40	98.40%
泓德智选启元混合C	1,254	26,707.28	178,000.63	0.53%	33,312,931.96	99.47%
合计	1,984	72,659.02	1,947,582.37	1.35%	142,207,922.36	98.65%

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）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泓德智选启元混合A	210,530.80	0.19%
	泓德智选启元混合C	3,392.93	0.01%
	合计	213,923.73	0.15%



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）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德智选启元混合A	10~50
	泓德智选启元混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德智选启元混合A	0
	泓德智选启元混合C	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德智选启元混合A	泓德智选启元混合C
基金合同生效日(2023年11月21日)基金份额总额	42,080,923.58	224,380,465.76
本报告期期初基金份额总额	42,080,923.58	224,380,465.76
本报告期基金总申购份额	261,562,207.08	51,896,640.62
减：本报告期基金总赎回份额	192,978,558.52	242,786,173.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	110,664,572.14	33,490,932.59

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 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。

## 11.2 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

2024年3月26日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

## 11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为44,000.00元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为1年。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

	数量					
华泰证券	3	1,343,052,947.65	51.73%	852,744.65	55.23%	-
开源证券	3	732,478,074.59	28.22%	452,072.28	29.28%	-
中银国际证券	3	520,508,421.42	20.05%	239,115.85	15.49%	-

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

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

3、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

4、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

5、交易佣金包含已由证券经纪商扣收的相关交易费用。本基金本报告期内未租用其他证券公司交易单元进行证券投资。

6、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《泓德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	266,912.36	66.28%	-	-	-	-	-	-

开源证券	109,753.17	27.26%	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	26,011.79	6.46%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-05
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
3	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启元混合型证券投资基金增加中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-25
4	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-01
5	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启元混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-02
6	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-02-24
7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构并开通转换业务的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20

8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
9	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-22
10	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-18
11	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-18
12	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启元混合型证券投资基金的基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-20
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-30
14	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的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-09-20
15	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-10-11
16	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-10-23
17	泓德基金管理有限公司关于	公司官网、中国证券报、中	2024-11-06

	旗下部分基金增加中信证券股份有限公司等机构为销售机构的公告	中国证监会基金电子披露网站	
18	泓德基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-07
19	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启元混合型证券投资基金的基金经理变更公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-12-07
20	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-12-31

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

**12.1 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**  
无。

**12.2 影响投资者决策的其他重要信息**  
无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

### 13.2 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

### 13.3 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  
二〇二五年三月二十八日