

泓德智选启航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:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大银行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3月19日(基金合同生效日)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	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
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	12
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	13
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	14
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	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	91
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	93
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	94
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	97
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	97
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	98
§10 开放式基金份额变动	98
§11 重大事件揭示	98
11.1 基金份额持有人大会决议	98
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	99
11.4 基金投资策略的改变	99
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	99
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	99
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	99
11.8 其他重大事件	101
§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	泓德智选启航混合型证券投资基金	
基金简称	泓德智选启航混合	
基金主代码	020567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年03月19日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	143,230,844.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德智选启航混合A	泓德智选启航混合C
下属分级基金的交易代码	020567	020568
报告期末下属分级基金的份额总额	115,558,049.94份	27,672,794.40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、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	中证全指指数收益率×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	中国光大银行股份有限公司
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	95595
传真	010-59850195	010-63639132
注册地址	西藏自治区拉萨市柳梧新区北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址	北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码	100088	100033
法定代表人	王德晓	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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	本期2024年03月19日（基金合同生效日） - 2024年12月31日	
	泓德智选启航混合 A	泓德智选启航混合 C
本期已实现收益	19,194,137.49	3,953,570.85
本期利润	17,164,192.97	6,341,697.00
加权平均基金份额本期利润	0.1450	0.1054
本期加权平均净值利润率	13.89%	10.42%
本期基金份额净值增长率	15.78%	15.41%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末	
期末可供分配利润	15,535,056.54	3,618,142.02
期末可供分配基金份额利润	0.1344	0.1307
期末基金资产净值	133,795,176.77	31,937,812.50
期末基金份额净值	1.1578	1.1541
3.1.3 累计期末指标	2024年末	
基金份额累计净值增长率	15.78%	15.41%

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）。

4、本基金基金合同生效日为2024年3月19日，本年度财务报表的实际编制期间为2024年3月19日至2024年12月31日。

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

泓德智选启航混合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	1.95%	1.77%	1.17%	1.76%	0.78%	0.01%
过去六个月	18.36%	1.66%	16.21%	1.67%	2.15%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	15.78%	1.36%	7.11%	1.45%	8.67%	-0.09%

泓德智选启航混合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	1.84%	1.77%	1.17%	1.76%	0.67%	0.01%
过去六个月	18.11%	1.66%	16.21%	1.67%	1.90%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	15.41%	1.35%	7.11%	1.45%	8.30%	-0.10%

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：中证全指指数收益率×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) 中证全指指数由剔除 ST、*ST 股票，以及上市时间不足 3 个月等股票后的剩余股票构成样本股，该指数编制合理、透明，有一定市场覆盖率，不易被操纵，并且有较高的知名度和市场影响力。适合作为本基金 A 股投资部分的业绩比较基准。

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

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

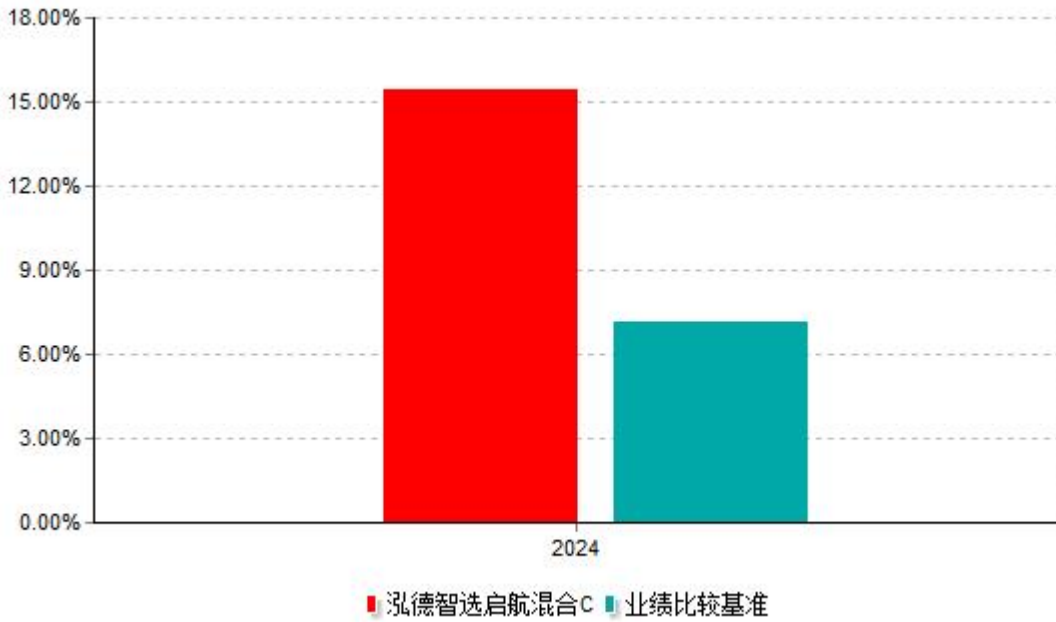
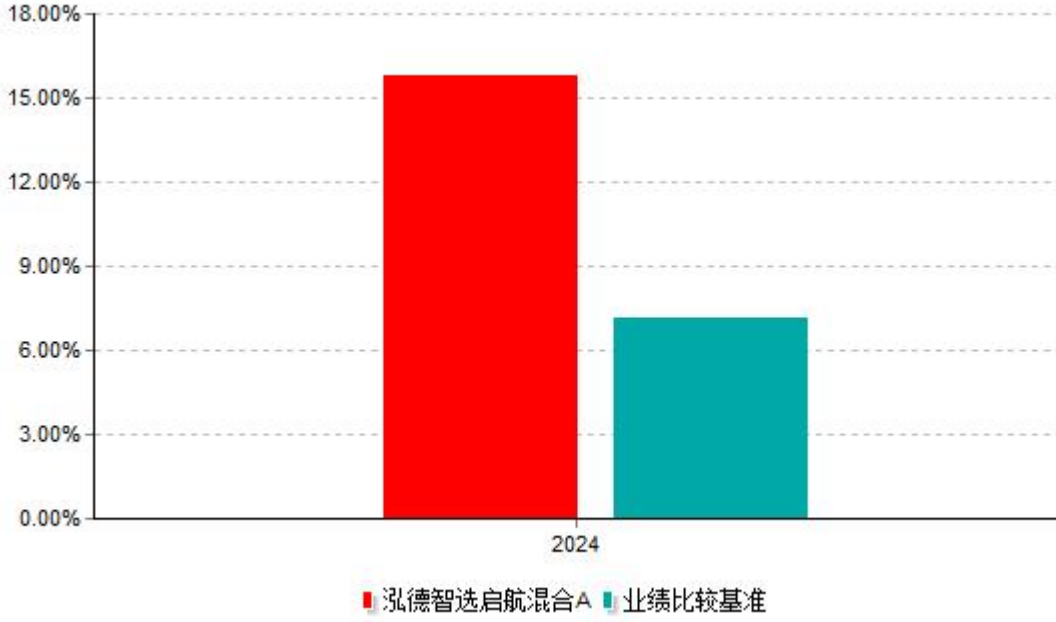
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金的基金合同于2024年3月19日生效，截至2024年12月31日止，本基金成立未满1年。

2、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2024年3月19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，同时在产品的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	2024-03-19	-	11年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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，随后，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。产品成立后，市场经历短暂波动后便一路向下，成交量持续低迷，我们践行了稳健建仓的策略，同时我们对模

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，积极开发新的模型并取得了一定效果。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航混合A基金份额净值为1.1578元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.78%，同期业绩比较基准收益率为7.11%；截至报告期末泓德智选启航混合C基金份额净值为1.1541元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为15.41%，同期业绩比较基准收益率为7.11%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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一轮新的价值重估，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19,153,198.56元,其中:泓德智选启航混合A期末可供分配利润为15,535,056.54元(泓德智选启航混合A的未分配利润已实现部分为15,535,056.54元,未分配利润未实现部分为2,702,070.29元),泓德智选启航混合C期末可供分配利润为3,618,142.02元(泓德智选启航混合C的未分配利润已实现部分为3,618,142.02元,未分配利润未实现部分为646,876.08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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在泓德智选启航混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《泓德智选启航混合型证券投资基金2024年年度报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§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]200Z1970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	泓德智选启航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航混合型证券投资基金（以下简称“泓德智选启航混合基金”）财务报表，包括2024年12月31日的资产负债表，2024年3月19日（基金合同生效日）至2024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航混合基金2024年12月31日的财务状况以及2024年3月19日（基金合同生效日）至2024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，我们独立于泓德智选启航混合基金，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。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>泓德智选启航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航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航混合基金、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航混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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</p>

	<p>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航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航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：泓德智选启航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
资产：		
货币资金	7.4.7.1	14,912,604.36
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	151,932,106.68
其中：股票投资		151,915,544.22
基金投资		-
债券投资		16,562.46
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		262,026.16
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		167,106,737.20
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		1,107,641.77
应付管理人报酬		183,327.58
应付托管费		30,554.61

应付销售服务费		11,524.66
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	40,699.31
负债合计		1,373,747.93
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	143,230,844.34
未分配利润	7.4.7.8	22,502,144.93
净资产合计		165,732,989.27
负债和净资产总计		167,106,737.20

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额总额143,230,844.34份，其中A类基金份额总额为115,558,049.94份，基金份额净值为1.1578元；C类基金份额总额为27,672,794.40份，基金份额净值为1.1541元。

7.2 利润表

会计主体：泓德智选启航混合型证券投资基金

本报告期：2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年03月19日（基金合同 生效日）至2024年12月31 日
一、营业总收入		25,857,634.61
1.利息收入		186,337.24
其中：存款利息收入	7.4.7.9	186,337.24
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）		24,444,005.85

其中：股票投资收益	7.4.7.10	21,656,911.07
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	17,173.32
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	2,769,921.46
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	358,181.63
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	869,109.89
减：二、营业总支出		2,351,744.64
1.管理人报酬		1,725,894.57
2.托管费		287,649.10
3.销售服务费		191,000.97
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	7.4.7.16	147,200.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		23,505,889.97
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		23,505,889.97
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		23,505,889.97

7.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选启航混合型证券投资基金

本报告期：2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	220,461,163.73	-	220,461,163.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-77,230,319.39	22,502,144.93	-54,728,174.46
（一）、综合收益总额	-	23,505,889.97	23,505,889.97
（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）	-77,230,319.39	-1,003,745.04	-78,234,064.43
其中：1.基金申购款	213,459,489.15	27,329,389.03	240,788,878.18
2.基金赎回款	-290,689,808.54	-28,333,134.07	-319,022,942.61
（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	143,230,844.34	22,502,144.93	165,732,989.27

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[2023]2901号《关于准予泓德智选启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《泓德智选启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220,441,631.57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(2024)第0107号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同》于2024年3月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为220,461,163.73份，其中认购资金利息折合19,532.16份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《泓德智选启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、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：中证全指指数收益率×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》、《泓德智选启航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3月19日(基金合同生效日)至2024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日的财务状况以及2024年3月19日(基金合同生效日)至2024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3月19日(基金合同生效日)至2024年12月31日。

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业务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业务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
活期存款	8,116,862.24
等于：本金	8,114,893.92
加：应计利息	1,968.32
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	6,795,742.12
等于：本金	6,795,490.30
加：应计利息	251.82

减：坏账准备	-
合计	14,912,604.36

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	151,561,721.19	-	151,915,544.22	353,823.03	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	12,200.00	3.86	16,562.46	4,358.60
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,200.00	3.86	16,562.46	4,358.60
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	151,573,921.19	3.86	151,932,106.68	358,181.63	

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
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	699.31
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	40,000.00
合计	40,699.31

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 泓德智选启航混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合A)	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	128,991,605.26	128,991,605.26
本期申购	180,960,744.27	180,960,744.27
本期赎回（以“-”号填列）	-194,394,299.59	-194,394,299.59
本期末	115,558,049.94	115,558,049.94

7.4.7.7.2 泓德智选启航混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合C)	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	91,469,558.47	91,469,558.47
本期申购	32,498,744.88	32,498,744.88
本期赎回（以“-”号填列）	-96,295,508.95	-96,295,508.95
本期末	27,672,794.40	27,672,794.40

注：1.申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2.本基金于2024年3月1日至2024年3月15日期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币220,441,631.57元，折合为220,441,631.57份基金份额(其中A类基金份额128,979,288.21份，C类基金份额91,462,343.36份)。根据《泓德智选启航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19,532.16元。在本基金成立后，折算为19,532.16份基金份额(其中A类基金份额12,317.05份，C类基金份额7,215.11份)，划入基金份额持有人账户。

3.根据《泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同》、《泓德智选启航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航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2024年3月19日(基金合同生效日)至2024年6月18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6月19日起开始办理。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 泓德智选启航混合A

单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	19,194,137.49	-2,029,944.52	17,164,192.97
本期基金份额交易产生的变动数	-3,659,080.95	4,732,014.81	1,072,933.86
其中：基金申购款	4,220,556.39	19,153,466.08	23,374,022.47
基金赎回款	-7,879,637.34	-14,421,451.27	-22,301,088.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,535,056.54	2,702,070.29	18,237,126.83

7.4.7.8.2 泓德智选启航混合C

单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,953,570.85	2,388,126.15	6,341,697.00
本期基金份额交易产生的变动数	-335,428.83	-1,741,250.07	-2,076,678.90
其中：基金申购款	733,744.71	3,221,621.85	3,955,366.56
基金赎回款	-1,069,173.54	-4,962,871.92	-6,032,045.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,618,142.02	646,876.08	4,265,018.10

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
活期存款利息收入	99,810.18
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	86,526.36
结算备付金利息收入	-
其他	0.70
合计	186,337.24

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——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
----	----------------------------------------

卖出股票成交总额	639,808,235.35
减：卖出股票成本总额	617,271,237.34
减：交易费用	880,086.94
买卖股票差价收入	21,656,911.07

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03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	22.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,151.06
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	17,173.32

7.4.7.11.2 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,673.57
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	84,500.00
减：应计利息总额	18.43

减：交易费用	4.08
买卖债券差价收入	17,151.06

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03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,769,921.46
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	2,769,921.46

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03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1.交易性金融资产	358,181.63
——股票投资	353,823.03
——债券投资	4,358.60
——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	358,181.63
----	------------

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	868,865.04
基金转换费收入	244.85
合计	869,109.89

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费25%的部分归入转出基金的基金资产。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	6,000.00
开户费	1,200.00
合计	147,200.00

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
中国光大银行股份有限公司（以下简称“中国光大银行”）	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

无。

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
	2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,725,894.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	653,036.35
应支付基金管理人的净管理费	1,072,858.22

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
	2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	287,649.10

注：支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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：
日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德智选启航混合A	泓德智选启航混合C	合计
中国光大银行	0.00	24,072.85	24,072.85
泓德基金	0.00	114.13	114.13
合计	0.00	24,186.98	24,186.98

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

无。

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

泓德智选启航混合A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	166,085.64	0.12%

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03月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	8,116,862.24	99,810.18

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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

无。

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
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月以上	限售股	17.58	33.06	557	9,792.06	18,414.42	-
603072	天和磁材	2024-12-24	7个交易日	新股未上市	12.30	12.30	1,308	16,088.40	16,088.40	-
688615	合合信息	2024-09-19	6个月以上	限售股	55.18	165.78	83	4,579.94	13,759.74	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6个月以上	限售股	18.50	56.85	236	4,366.00	13,416.60	-
001391	国货航	2024-12-23	6个月以上	限售股	2.30	6.80	1,345	3,093.50	9,146.00	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6个月以上	限售股	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
688710	益诺思	2024-08-27	6个月以上	限售股	19.06	33.58	216	4,116.96	7,253.28	-
603194	中力股份	2024-12-17	6个月以	限售股	20.32	28.13	149	3,027.68	4,191.37	-

			上							
603207	小方制药	2024-08-19	6个月以上	限售股	12.47	26.65	154	1,920.38	4,104.10	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	限售股	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	6个月以上	限售股	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6个月以上	限售股	26.50	44.43	66	1,749.00	2,932.38	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6个月以上	限售股	40.00	41.35	58	2,320.00	2,398.30	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	限售股	18.65	22.61	92	1,715.80	2,080.12	-
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	146	1,795.80	1,795.80	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6个月以上	限售股	17.39	17.95	79	1,373.81	1,418.05	-

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
000016	深康佳A	2024-12-30	重大事项	5.52	2025-01-14	6.07	11,600	64,427.30	64,032.00	-
002252	上海莱士	2024-12-23	重大资产重组	7.22	2025-01-07	6.93	20,100	141,162.18	145,122.00	-

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0.01%。

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	14,912,604.36	-	-	-	14,912,604.36

交易性金融资产	-	-	16,562.46	151,915,544.22	151,932,106.68
应收申购款	-	-	-	262,026.16	262,026.16
资产总计	14,912,604.36	-	16,562.46	152,177,570.38	167,106,737.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,107,641.77	1,107,641.77
应付管理人报酬	-	-	-	183,327.58	183,327.58
应付托管费	-	-	-	30,554.61	30,554.61
应付销售服务费	-	-	-	11,524.66	11,524.66
其他负债	-	-	-	40,699.31	40,699.31
负债总计	-	-	-	1,373,747.93	1,373,747.93
利率敏感度缺口	14,912,604.36	-	16,562.46	150,803,822.45	165,732,989.27

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0.01%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	151,915,544.22	91.66
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	151,915,544.22	91.66

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期期末，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
第一层次	151,611,090.80
第二层次	227,038.20
第三层次	93,977.68
合计	151,932,106.68

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03月19日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	103,247.60	103,247.60
转出第三层次	-	2,071.11	2,071.11
当期利得或损失总额	-	-7,198.81	-7,198.81

其中：计入损益的利得或损失	-	-7,198.81	-7,198.81
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	93,977.68	93,977.68
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	-	-6,372.97	-6,372.97

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3月19日（基金合同生效日）至2024年12月31日止期间，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	93,977.68	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	26.65%-27.658%	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	151,915,544.22	90.91
	其中：股票	151,915,544.22	90.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,562.46	0.01
	其中：债券	16,562.46	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,912,604.36	8.92
8	其他各项资产	262,026.16	0.16
9	合计	167,106,737.20	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	1,236,122.00	0.75
B	采矿业	6,369,176.80	3.84
C	制造业	89,385,527.20	53.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,633,568.00	2.80
E	建筑业	2,220,325.00	1.34
F	批发和零售业	3,623,660.00	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	4,617,264.00	2.79
H	住宿和餐饮业	175,329.00	0.11

I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,646,364.34	5.22
J	金融业	24,468,623.00	14.76
K	房地产业	2,126,990.00	1.28
L	租赁和商务服务业	1,463,114.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	928,099.88	0.56
N	水利、环境和公共设施管理业	938,300.00	0.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	85,448.00	0.05
Q	卫生和社会工作	353,680.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	612,341.00	0.37
S	综合	31,612.00	0.02
	合计	151,915,544.22	91.66

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	600519	贵州茅台	2,200	3,352,800.00	2.02
2	300750	宁德时代	10,700	2,846,200.00	1.72
3	601318	中国平安	42,500	2,237,625.00	1.35
4	600900	长江电力	54,200	1,601,610.00	0.97
5	000333	美的集团	20,700	1,557,054.00	0.94
6	600036	招商银行	37,300	1,465,890.00	0.88
7	000725	京东方 A	262,700	1,153,253.00	0.70
8	601899	紫金矿业	76,100	1,150,632.00	0.69
9	600030	中信证券	39,200	1,143,464.00	0.69
10	300059	东方财富	42,500	1,097,350.00	0.66
11	601398	工商银行	158,400	1,096,128.00	0.66
12	600887	伊利股份	35,300	1,065,354.00	0.64
13	601288	农业银行	175,500	937,170.00	0.57

14	002594	比亚迪	3,300	932,778.00	0.56
15	000651	格力电器	20,000	909,000.00	0.55
16	002475	立讯精密	22,029	897,902.04	0.54
17	601688	华泰证券	43,200	759,888.00	0.46
18	601166	兴业银行	38,800	743,408.00	0.45
19	601319	中国人保	97,300	741,426.00	0.45
20	601229	上海银行	77,500	709,125.00	0.43
21	600000	浦发银行	66,900	688,401.00	0.42
22	000858	五粮液	4,900	686,196.00	0.41
23	002001	新和成	30,700	674,479.00	0.41
24	601816	京沪高铁	106,200	654,192.00	0.39
25	300433	蓝思科技	29,300	641,670.00	0.39
26	600050	中国联通	120,800	641,448.00	0.39
27	002027	分众传媒	89,200	627,076.00	0.38
28	601728	中国电信	86,800	626,696.00	0.38
29	601336	新华保险	12,600	626,220.00	0.38
30	601328	交通银行	79,400	616,938.00	0.37
31	601919	中远海控	39,200	607,600.00	0.37
32	601988	中国银行	106,600	587,366.00	0.35
33	688041	海光信息	3,600	539,244.00	0.33
34	000776	广发证券	33,100	536,551.00	0.32
35	688981	中芯国际	5,600	529,872.00	0.32
36	601939	建设银行	59,200	520,368.00	0.31
37	600015	华夏银行	64,600	517,446.00	0.31
38	002648	卫星化学	27,500	516,725.00	0.31
39	603501	韦尔股份	4,900	511,609.00	0.31
40	000895	双汇发展	19,300	501,028.00	0.30
41	601601	中国太保	14,700	500,976.00	0.30
42	603993	洛阳钼业	74,400	494,760.00	0.30
43	601211	国泰君安	25,400	473,710.00	0.29
44	000425	徐工机械	58,600	464,698.00	0.28

45	601877	正泰电器	19,800	463,518.00	0.28
46	600690	海尔智家	15,800	449,826.00	0.27
47	600919	江苏银行	45,500	446,810.00	0.27
48	600660	福耀玻璃	7,100	443,040.00	0.27
49	601088	中国神华	10,000	434,800.00	0.26
50	002938	鹏鼎控股	11,900	434,112.00	0.26
51	000100	TCL科技	86,300	434,089.00	0.26
52	600707	彩虹股份	52,600	432,372.00	0.26
53	002371	北方华创	1,100	430,100.00	0.26
54	601658	邮储银行	75,100	426,568.00	0.26
55	002724	海洋王	78,300	416,556.00	0.25
56	601169	北京银行	67,700	416,355.00	0.25
57	600276	恒瑞医药	9,000	413,100.00	0.25
58	002736	国信证券	36,800	412,160.00	0.25
59	600585	海螺水泥	17,300	411,394.00	0.25
60	002241	歌尔股份	15,700	405,217.00	0.24
61	300502	新易盛	3,500	404,530.00	0.24
62	600219	南山铝业	103,400	404,294.00	0.24
63	002970	锐明技术	8,300	395,329.00	0.24
64	000977	浪潮信息	7,500	389,100.00	0.23
65	601225	陕西煤业	16,600	386,116.00	0.23
66	603577	汇金通	48,200	385,118.00	0.23
67	603799	华友钴业	13,100	383,306.00	0.23
68	300866	安克创新	3,900	380,796.00	0.23
69	600096	云天化	17,000	379,100.00	0.23
70	300498	温氏股份	22,400	369,824.00	0.22
71	600019	宝钢股份	52,700	368,900.00	0.22
72	002128	电投能源	18,800	368,104.00	0.22
73	000509	华塑控股	110,300	367,299.00	0.22
74	300317	珈伟新能	100,000	367,000.00	0.22
75	600941	中国移动	3,100	366,296.00	0.22

76	601618	中国中冶	105,400	347,820.00	0.21
77	000166	申万宏源	64,800	346,680.00	0.21
78	601898	中煤能源	28,100	342,258.00	0.21
79	601390	中国中铁	53,300	340,587.00	0.21
80	601138	工业富联	15,700	337,550.00	0.20
81	688509	正元地信	84,800	336,656.00	0.20
82	002273	水晶光电	15,100	335,522.00	0.20
83	601857	中国石油	37,400	334,356.00	0.20
84	002214	大立科技	29,800	332,270.00	0.20
85	600517	国网英大	60,000	330,600.00	0.20
86	002224	三力士	76,000	328,320.00	0.20
87	002726	龙大美食	41,400	327,888.00	0.20
88	300289	利德曼	66,800	327,320.00	0.20
89	600918	中泰证券	49,600	325,872.00	0.20
90	600999	招商证券	17,000	325,720.00	0.20
91	000039	中集集团	41,700	324,009.00	0.20
92	600663	陆家嘴	32,900	323,736.00	0.20
93	601766	中国中车	38,600	323,468.00	0.20
94	600610	中毅达	75,400	318,942.00	0.19
95	600925	苏能股份	59,600	315,880.00	0.19
96	000800	一汽解放	38,300	314,060.00	0.19
97	002064	华峰化学	37,900	310,022.00	0.19
98	600018	上港集团	50,300	307,836.00	0.19
99	002142	宁波银行	12,600	306,306.00	0.18
100	002546	新联电子	70,700	306,131.00	0.18
101	600998	九州通	59,700	305,664.00	0.18
102	605117	德业股份	3,600	305,280.00	0.18
103	000686	东北证券	38,400	304,896.00	0.18
104	000050	深天马 A	33,700	304,311.00	0.18
105	601009	南京银行	28,400	302,460.00	0.18
106	000701	厦门信达	65,700	300,249.00	0.18

107	601628	中国人寿	7,100	297,632.00	0.18
108	002532	天山铝业	37,500	295,125.00	0.18
109	600031	三一重工	17,600	290,048.00	0.18
110	601528	瑞丰银行	51,100	287,693.00	0.17
111	300033	同花顺	1,000	287,500.00	0.17
112	605166	聚合顺	24,000	287,280.00	0.17
113	688223	晶科能源	39,800	282,978.00	0.17
114	600016	民生银行	68,200	281,666.00	0.17
115	002714	牧原股份	7,200	276,768.00	0.17
116	605080	浙江自然	11,700	274,950.00	0.17
117	002352	顺丰控股	6,800	274,040.00	0.17
118	601168	西部矿业	17,000	273,190.00	0.16
119	601600	中国铝业	37,000	271,950.00	0.16
120	688093	世华科技	13,400	270,546.00	0.16
121	600419	天润乳业	28,800	268,128.00	0.16
122	603173	福斯达	11,600	267,380.00	0.16
123	600271	航天信息	29,300	266,923.00	0.16
124	002745	木林森	30,600	266,832.00	0.16
125	000063	中兴通讯	6,600	266,640.00	0.16
126	002522	浙江众成	68,000	265,880.00	0.16
127	603201	常润股份	15,700	265,487.00	0.16
128	002266	浙富控股	84,500	263,640.00	0.16
129	603508	思维列控	11,000	261,580.00	0.16
130	688588	凌志软件	18,917	261,054.60	0.16
131	300760	迈瑞医疗	1,000	255,000.00	0.15
132	603676	卫信康	25,500	253,725.00	0.15
133	603600	永艺股份	21,300	253,257.00	0.15
134	600403	大有能源	85,500	251,370.00	0.15
135	603129	春风动力	1,600	251,312.00	0.15
136	600537	亿晶光电	81,600	250,512.00	0.15
137	600346	恒力石化	16,300	250,205.00	0.15

138	000338	潍柴动力	18,000	246,600.00	0.15
139	300628	亿联网络	6,300	243,180.00	0.15
140	600968	海油发展	56,700	242,109.00	0.15
141	002550	千红制药	39,000	241,800.00	0.15
142	600691	阳煤化工	108,200	240,204.00	0.14
143	600418	江淮汽车	6,400	240,000.00	0.14
144	600841	动力新科	47,200	239,304.00	0.14
145	600488	津药药业	56,400	239,136.00	0.14
146	600282	南钢股份	50,900	238,721.00	0.14
147	300111	向日葵	73,400	237,816.00	0.14
148	688798	艾为电子	3,400	237,388.00	0.14
149	000607	华媒控股	63,600	235,956.00	0.14
150	601002	晋亿实业	54,200	235,770.00	0.14
151	600731	湖南海利	41,300	235,410.00	0.14
152	300442	润泽科技	4,500	233,820.00	0.14
153	601218	吉鑫科技	70,700	230,482.00	0.14
154	600023	浙能电力	40,700	230,362.00	0.14
155	300259	新天科技	65,100	227,850.00	0.14
156	601388	怡球资源	92,400	227,304.00	0.14
157	002672	东江环保	53,600	226,728.00	0.14
158	002109	兴化股份	71,100	225,387.00	0.14
159	688578	艾力斯	3,750	224,625.00	0.14
160	300110	华仁药业	63,800	224,576.00	0.14
161	600406	国电南瑞	8,900	224,458.00	0.14
162	603601	再升科技	66,600	223,776.00	0.14
163	002111	威海广泰	20,300	223,706.00	0.13
164	600183	生益科技	9,300	223,665.00	0.13
165	601616	广电电气	50,900	223,451.00	0.13
166	600798	宁波海运	73,700	223,311.00	0.13
167	600981	汇鸿集团	86,400	222,912.00	0.13
168	002996	顺博合金	33,470	222,240.80	0.13

169	002263	大东南	89,400	221,712.00	0.13
170	000790	华神科技	56,700	221,130.00	0.13
171	002554	惠博普	87,900	220,629.00	0.13
172	002132	恒星科技	80,100	219,474.00	0.13
173	000751	锌业股份	78,100	219,461.00	0.13
174	688208	道通科技	5,600	219,296.00	0.13
175	600926	杭州银行	15,000	219,150.00	0.13
176	000729	燕京啤酒	18,200	219,128.00	0.13
177	300190	维尔利	62,400	219,024.00	0.13
178	002852	道道全	26,500	218,890.00	0.13
179	600958	东方证券	20,600	217,536.00	0.13
180	003816	中国广核	52,400	216,412.00	0.13
181	601068	中铝国际	49,000	216,090.00	0.13
182	600025	华能水电	22,700	215,877.00	0.13
183	600893	航发动力	5,200	215,540.00	0.13
184	688606	奥泰生物	3,400	215,220.00	0.13
185	002330	得利斯	49,200	215,004.00	0.13
186	603118	共进股份	24,100	214,490.00	0.13
187	688122	西部超导	5,000	214,100.00	0.13
188	000078	海王生物	83,900	213,945.00	0.13
189	002686	亿利达	39,900	213,864.00	0.13
190	603158	腾龙股份	26,400	213,312.00	0.13
191	002688	金河生物	46,600	208,302.00	0.13
192	600383	金地集团	46,900	205,422.00	0.12
193	688009	中国通号	32,800	205,328.00	0.12
194	600428	中远海特	28,100	205,130.00	0.12
195	605118	力鼎光电	11,500	204,815.00	0.12
196	601186	中国铁建	22,300	204,491.00	0.12
197	601099	太平洋	47,600	202,776.00	0.12
198	300724	捷佳伟创	3,200	202,272.00	0.12
199	002563	森马服饰	28,800	202,176.00	0.12

200	002881	美格智能	6,700	200,732.00	0.12
201	688117	圣诺生物	7,800	200,226.00	0.12
202	601518	吉林高速	72,000	200,160.00	0.12
203	002479	富春环保	42,100	199,554.00	0.12
204	002418	康盛股份	81,500	198,860.00	0.12
205	600084	中信尼雅	37,800	198,828.00	0.12
206	000538	云南白药	3,300	197,835.00	0.12
207	002498	汉缆股份	58,000	196,620.00	0.12
208	002609	捷顺科技	23,800	196,588.00	0.12
209	001979	招商蛇口	18,900	193,536.00	0.12
210	603256	宏和科技	23,100	192,885.00	0.12
211	000301	东方盛虹	23,400	192,114.00	0.12
212	600935	华塑股份	76,000	191,520.00	0.12
213	600848	上海临港	18,800	189,880.00	0.11
214	000157	中联重科	26,200	189,426.00	0.11
215	300239	东宝生物	30,000	187,800.00	0.11
216	301165	锐捷网络	2,600	187,720.00	0.11
217	002445	中南文化	76,600	187,670.00	0.11
218	300021	大禹节水	46,100	187,627.00	0.11
219	603169	兰石重装	34,400	187,480.00	0.11
220	600115	中国东航	46,800	187,200.00	0.11
221	601006	大秦铁路	27,500	186,450.00	0.11
222	002544	普天科技	8,700	186,441.00	0.11
223	002625	光启技术	3,900	186,420.00	0.11
224	600196	复星医药	7,500	186,375.00	0.11
225	603699	纽威股份	8,400	186,228.00	0.11
226	002908	德生科技	21,200	185,712.00	0.11
227	601995	中金公司	5,500	185,295.00	0.11
228	601633	长城汽车	7,000	184,310.00	0.11
229	601998	中信银行	26,400	184,272.00	0.11
230	601399	国机重装	59,800	184,184.00	0.11

231	600710	苏美达	19,800	184,140.00	0.11
232	688233	神工股份	7,800	182,910.00	0.11
233	605333	沪光股份	5,600	182,728.00	0.11
234	002236	大华股份	11,400	182,400.00	0.11
235	002500	山西证券	29,000	182,120.00	0.11
236	600176	中国巨石	15,900	181,101.00	0.11
237	600216	浙江医药	11,400	180,804.00	0.11
238	603019	中科曙光	2,500	180,800.00	0.11
239	600758	辽宁能源	52,500	180,600.00	0.11
240	002493	荣盛石化	19,900	180,095.00	0.11
241	688055	龙腾光电	43,600	180,068.00	0.11
242	600066	宇通客车	6,800	179,384.00	0.11
243	603288	海天味业	3,900	179,010.00	0.11
244	300513	恒实科技	19,600	178,948.00	0.11
245	603987	康德莱	24,900	178,782.00	0.11
246	600741	华域汽车	10,100	177,861.00	0.11
247	600892	大晟文化	48,100	177,489.00	0.11
248	300002	神州泰岳	15,300	177,327.00	0.11
249	603697	有友食品	17,400	177,132.00	0.11
250	600029	南方航空	27,200	176,528.00	0.11
251	603893	瑞芯微	1,600	176,096.00	0.11
252	600361	创新新材	45,400	175,244.00	0.11
253	002463	沪电股份	4,400	174,460.00	0.11
254	688408	中信博	2,400	172,800.00	0.10
255	600688	上海石化	57,100	172,442.00	0.10
256	002300	太阳电缆	32,200	171,948.00	0.10
257	603538	美诺华	13,500	171,585.00	0.10
258	002912	中新赛克	6,700	171,453.00	0.10
259	600261	阳光照明	52,400	171,348.00	0.10
260	603595	东尼电子	10,000	170,900.00	0.10
261	600386	北巴传媒	38,200	170,754.00	0.10

262	002391	长青股份	34,000	170,340.00	0.10
263	601162	天风证券	37,700	168,896.00	0.10
264	300972	万辰集团	2,100	168,861.00	0.10
265	002035	华帝股份	23,000	168,820.00	0.10
266	000061	农产品	23,900	167,539.00	0.10
267	688019	安集科技	1,200	167,232.00	0.10
268	600362	江西铜业	8,100	167,184.00	0.10
269	002100	天康生物	25,500	167,025.00	0.10
270	600815	厦工股份	62,900	166,685.00	0.10
271	600662	外服控股	32,700	165,789.00	0.10
272	002284	亚太股份	21,300	164,862.00	0.10
273	002517	恺英网络	12,100	164,681.00	0.10
274	301015	百洋医药	6,800	164,628.00	0.10
275	300685	艾德生物	7,200	164,160.00	0.10
276	601607	上海医药	7,800	163,800.00	0.10
277	300999	金龙鱼	5,000	163,050.00	0.10
278	601137	博威合金	8,000	162,400.00	0.10
279	300140	节能环境	27,000	161,730.00	0.10
280	600649	城投控股	36,100	160,645.00	0.10
281	001332	锡装股份	4,600	160,632.00	0.10
282	601808	中海油服	10,500	160,125.00	0.10
283	603115	海星股份	12,400	160,084.00	0.10
284	688131	皓元医药	4,478	159,864.60	0.10
285	300821	东岳硅材	20,600	159,856.00	0.10
286	601111	中国国航	20,000	158,200.00	0.10
287	002180	纳思达	5,600	157,752.00	0.10
288	688425	铁建重工	35,800	157,520.00	0.10
288	601865	福莱特	8,000	157,520.00	0.10
289	000933	神火股份	9,300	157,170.00	0.09
290	688183	生益电子	4,000	157,040.00	0.09
291	600372	中航机载	12,700	156,591.00	0.09

292	002519	银河电子	26,300	156,222.00	0.09
293	600103	青山纸业	61,000	156,160.00	0.09
294	601279	英利汽车	40,600	155,498.00	0.09
295	300253	卫宁健康	21,700	155,372.00	0.09
296	600028	中国石化	23,200	154,976.00	0.09
297	600578	京能电力	43,900	154,528.00	0.09
298	002228	合兴包装	51,400	154,200.00	0.09
299	300375	鹏翎股份	33,200	153,052.00	0.09
300	000708	中信特钢	13,400	152,894.00	0.09
301	000931	中关村	32,100	152,796.00	0.09
302	600655	豫园股份	23,700	152,391.00	0.09
303	688127	蓝特光学	5,600	151,760.00	0.09
304	300979	华利集团	1,900	149,435.00	0.09
305	600651	飞乐音响	36,000	149,040.00	0.09
306	600101	明星电力	16,900	148,720.00	0.09
307	000783	长江证券	21,600	147,312.00	0.09
308	002311	海大集团	3,000	147,150.00	0.09
309	601231	环旭电子	8,900	146,850.00	0.09
310	605499	东鹏饮料	590	146,626.80	0.09
311	300145	中金环境	39,500	146,545.00	0.09
312	002384	东山精密	5,000	146,000.00	0.09
313	300761	立华股份	7,500	145,950.00	0.09
314	600739	辽宁成大	14,100	145,935.00	0.09
315	002926	华西证券	17,500	145,425.00	0.09
316	002634	棒杰股份	38,600	145,136.00	0.09
317	600928	西安银行	40,200	145,122.00	0.09
317	002252	上海莱士	20,100	145,122.00	0.09
318	002230	科大讯飞	3,000	144,960.00	0.09
319	600266	城建发展	28,400	144,840.00	0.09
320	600989	宝丰能源	8,600	144,824.00	0.09
321	000938	紫光股份	5,200	144,716.00	0.09

322	002797	第一创业	17,300	144,455.00	0.09
323	601212	白银有色	51,900	144,282.00	0.09
324	002734	利民股份	17,800	141,866.00	0.09
325	600438	通威股份	6,400	141,504.00	0.09
326	603811	诚意药业	18,200	140,504.00	0.08
327	002003	伟星股份	9,900	140,283.00	0.08
328	600956	新天绿能	18,600	140,244.00	0.08
329	001289	龙源电力	8,900	139,819.00	0.08
330	600521	华海药业	7,800	139,386.00	0.08
331	000404	长虹华意	18,800	139,120.00	0.08
332	600104	上汽集团	6,700	139,092.00	0.08
333	301267	华夏眼科	7,300	138,992.00	0.08
334	300034	钢研高纳	8,900	138,840.00	0.08
335	300185	通裕重工	53,800	138,266.00	0.08
336	300605	恒锋信息	11,800	138,178.00	0.08
337	600236	桂冠电力	20,300	138,040.00	0.08
338	001914	招商积余	13,000	137,410.00	0.08
339	301258	富士莱	5,800	136,996.00	0.08
340	301185	鸥玛软件	8,000	136,640.00	0.08
341	301301	川宁生物	11,500	136,390.00	0.08
342	000761	本钢板材	42,200	135,040.00	0.08
343	600939	重庆建工	43,800	131,838.00	0.08
344	600063	皖维高新	32,900	131,600.00	0.08
345	002847	盐津铺子	2,100	131,460.00	0.08
346	601106	中国一重	45,100	131,241.00	0.08
347	600827	百联股份	12,000	131,160.00	0.08
348	601717	郑煤机	10,100	131,098.00	0.08
349	002636	金安国纪	16,900	130,806.00	0.08
350	688018	乐鑫科技	600	130,800.00	0.08
351	002446	盛路通信	19,900	130,345.00	0.08
352	603408	建霖家居	10,400	130,312.00	0.08

353	601117	中国化学	15,700	130,153.00	0.08
354	300453	三鑫医疗	17,400	129,804.00	0.08
355	600570	恒生电子	4,600	128,754.00	0.08
356	000807	云铝股份	9,500	128,535.00	0.08
357	300870	欧陆通	1,200	128,136.00	0.08
358	600143	金发科技	14,700	127,008.00	0.08
359	300682	朗新集团	10,400	126,880.00	0.08
359	300674	宇信科技	6,500	126,880.00	0.08
360	002666	德联集团	29,100	126,876.00	0.08
361	000655	金岭矿业	20,600	126,690.00	0.08
362	688550	瑞联新材	4,046	126,599.34	0.08
363	300529	健帆生物	4,300	126,162.00	0.08
364	300708	聚灿光电	10,100	126,149.00	0.08
365	300404	博济医药	14,400	125,712.00	0.08
366	300679	电连技术	2,100	125,370.00	0.08
367	300475	香农芯创	4,400	125,356.00	0.08
368	600188	兖矿能源	8,840	125,262.80	0.08
369	002891	中宠股份	3,500	124,950.00	0.08
370	605305	中际联合	4,400	124,652.00	0.08
371	002948	青岛银行	32,100	124,548.00	0.08
372	002255	海陆重工	22,400	124,544.00	0.08
373	300533	冰川网络	6,300	124,488.00	0.08
374	300777	中简科技	4,400	124,476.00	0.08
375	300389	艾比森	10,300	122,673.00	0.07
376	688772	珠海冠宇	7,600	122,208.00	0.07
377	600332	白云山	4,300	122,206.00	0.07
378	600252	中恒集团	49,500	121,770.00	0.07
379	300515	三德科技	10,200	121,482.00	0.07
380	300246	宝莱特	18,400	121,256.00	0.07
381	300345	华民股份	21,400	120,696.00	0.07
382	600027	华电国际	21,500	120,615.00	0.07

383	600179	安通控股	42,500	120,275.00	0.07
384	300232	洲明科技	17,500	120,225.00	0.07
385	002378	章源钨业	18,500	119,695.00	0.07
386	002635	安洁科技	7,500	119,400.00	0.07
387	301187	欧圣电气	3,500	119,350.00	0.07
388	300641	正丹股份	4,800	119,232.00	0.07
389	600563	法拉电子	1,000	118,920.00	0.07
390	300771	智莱科技	11,200	117,824.00	0.07
391	002793	罗欣药业	30,700	117,274.00	0.07
392	301060	兰卫医学	12,800	116,608.00	0.07
393	000576	甘化科工	16,000	116,160.00	0.07
394	600875	东方电气	7,300	115,997.00	0.07
395	600285	羚锐制药	5,200	115,232.00	0.07
396	000877	天山股份	20,200	114,332.00	0.07
397	002342	巨力索具	35,200	113,696.00	0.07
398	002571	德力股份	27,700	113,570.00	0.07
399	300244	迪安诊断	10,000	113,500.00	0.07
400	301025	读客文化	11,900	113,407.00	0.07
401	600169	太原重工	45,400	113,046.00	0.07
402	600299	安迪苏	9,000	112,950.00	0.07
403	603528	多伦科技	14,300	112,684.00	0.07
404	688311	盟升电子	3,400	112,574.00	0.07
405	002156	通富微电	3,800	112,290.00	0.07
406	300697	电工合金	8,900	112,229.00	0.07
407	300525	博思软件	7,200	112,176.00	0.07
408	601011	宝泰隆	37,200	111,972.00	0.07
409	002250	联化科技	20,300	111,853.00	0.07
410	600722	金牛化工	23,900	111,852.00	0.07
411	300308	中际旭创	900	111,159.00	0.07
412	600729	重庆百货	3,800	111,150.00	0.07
413	002863	今飞凯达	23,900	110,896.00	0.07

414	000892	欢瑞世纪	33,800	110,188.00	0.07
415	605376	博迁新材	3,800	110,010.00	0.07
416	600320	振华重工	28,000	109,760.00	0.07
417	603708	家家悦	9,600	109,344.00	0.07
418	000758	中色股份	22,100	109,174.00	0.07
419	600478	科力远	26,400	109,032.00	0.07
420	002130	沃尔核材	4,300	108,575.00	0.07
421	000528	柳工	9,000	108,540.00	0.07
422	603871	嘉友国际	5,600	108,360.00	0.07
423	600718	东软集团	10,000	107,700.00	0.06
424	600433	冠豪高新	33,900	107,463.00	0.06
425	600653	申华控股	50,200	107,428.00	0.06
426	600309	万华化学	1,500	107,025.00	0.06
427	002414	高德红外	14,400	106,992.00	0.06
428	000951	中国重汽	6,300	106,974.00	0.06
429	300857	协创数据	1,000	106,890.00	0.06
430	002063	远光软件	18,500	106,560.00	0.06
431	000030	富奥股份	20,700	106,191.00	0.06
432	688362	甬矽电子	3,147	105,990.96	0.06
433	000798	中水渔业	14,300	105,963.00	0.06
434	000559	万向钱潮	17,200	105,780.00	0.06
435	300705	九典制药	5,800	104,110.00	0.06
436	002548	金新农	26,200	104,014.00	0.06
437	002579	中京电子	13,100	103,490.00	0.06
438	601298	青岛港	11,300	102,943.00	0.06
439	300065	海兰信	12,500	102,500.00	0.06
440	601698	中国卫通	5,000	102,000.00	0.06
441	300570	太辰光	1,400	101,780.00	0.06
442	600865	百大集团	8,600	101,222.00	0.06
443	603166	福达股份	13,800	100,326.00	0.06
444	600064	南京高科	12,900	100,233.00	0.06

445	000623	吉林敖东	5,800	100,166.00	0.06
446	603920	世运电路	3,400	99,960.00	0.06
447	600617	国新能源	37,000	99,900.00	0.06
448	000898	鞍钢股份	41,600	99,840.00	0.06
449	002678	珠江钢琴	22,200	99,234.00	0.06
450	600248	陕建股份	22,100	99,008.00	0.06
451	300360	炬华科技	5,900	98,943.00	0.06
452	002557	洽洽食品	3,400	98,770.00	0.06
453	300016	北陆药业	15,900	98,580.00	0.06
454	600874	创业环保	16,500	98,505.00	0.06
455	601108	财通证券	12,000	98,040.00	0.06
456	300447	全信股份	6,900	97,773.00	0.06
457	601669	中国电建	17,800	97,188.00	0.06
458	300369	绿盟科技	13,500	97,065.00	0.06
459	000885	城发环境	7,400	97,014.00	0.06
460	600496	精工钢构	32,000	96,640.00	0.06
461	002653	海思科	2,900	96,425.00	0.06
462	601179	中国西电	12,700	96,393.00	0.06
463	002043	兔宝宝	8,100	96,228.00	0.06
464	600073	光明肉业	13,800	95,772.00	0.06
465	603609	禾丰股份	11,100	95,682.00	0.06
466	000921	海信家电	3,300	95,370.00	0.06
467	002595	豪迈科技	1,900	95,361.00	0.06
468	000401	冀东水泥	18,200	95,186.00	0.06
469	300910	瑞丰新材	2,000	95,180.00	0.06
470	002368	太极股份	4,000	94,720.00	0.06
471	688553	汇宇制药	6,200	94,240.00	0.06
471	000541	佛山照明	15,200	94,240.00	0.06
472	600268	国电南自	14,000	94,080.00	0.06
473	002432	九安医疗	2,300	93,794.00	0.06
474	301090	华润材料	13,500	93,690.00	0.06

475	301031	中熔电气	900	93,618.00	0.06
476	603259	药明康德	1,700	93,568.00	0.06
477	600350	山东高速	9,100	93,548.00	0.06
478	002991	甘源食品	1,000	93,520.00	0.06
479	600886	国投电力	5,600	93,072.00	0.06
480	301050	雷电微力	1,800	92,844.00	0.06
481	601018	宁波港	24,100	92,785.00	0.06
482	300888	稳健医疗	2,200	92,576.00	0.06
483	688312	燕麦科技	3,000	92,400.00	0.06
484	003005	竞业达	3,400	92,208.00	0.06
485	300455	航天智装	7,100	92,016.00	0.06
486	688209	英集芯	5,200	91,884.00	0.06
487	603378	亚士创能	14,300	91,806.00	0.06
488	688313	仕佳光子	5,600	91,784.00	0.06
489	301376	致欧科技	4,800	91,776.00	0.06
490	603392	万泰生物	1,300	91,598.00	0.06
491	601958	金钼股份	9,000	90,540.00	0.05
492	603101	汇嘉时代	9,700	90,501.00	0.05
493	002385	大北农	20,900	90,497.00	0.05
494	688779	五矿新能	17,000	90,440.00	0.05
495	300696	爱乐达	5,800	90,074.00	0.05
496	600237	铜峰电子	13,700	89,735.00	0.05
497	300645	正元智慧	6,100	89,609.00	0.05
498	000428	华天酒店	27,900	89,280.00	0.05
499	301218	华是科技	4,100	89,093.00	0.05
500	000517	荣安地产	39,900	88,977.00	0.05
501	600681	百川能源	25,300	88,550.00	0.05
502	300604	长川科技	2,000	88,260.00	0.05
503	301180	万祥科技	5,700	88,179.00	0.05
504	601375	中原证券	20,400	88,128.00	0.05
505	688586	江航装备	9,200	88,044.00	0.05

506	000703	恒逸石化	14,000	87,920.00	0.05
507	300827	上能电气	2,000	87,800.00	0.05
508	000728	国元证券	10,500	87,780.00	0.05
509	600390	五矿资本	13,600	87,720.00	0.05
510	600819	耀皮玻璃	16,300	87,531.00	0.05
511	000020	深华发 A	7,000	86,940.00	0.05
512	300512	中亚股份	12,700	86,487.00	0.05
513	688658	悦康药业	6,000	86,460.00	0.05
514	002218	拓日新能	21,700	86,149.00	0.05
515	001965	招商公路	6,100	85,095.00	0.05
516	605366	宏柏新材	15,700	85,094.00	0.05
517	300832	新产业	1,200	85,020.00	0.05
518	300770	新媒股份	2,100	84,861.00	0.05
519	002533	金杯电工	8,600	84,624.00	0.05
520	600039	四川路桥	11,600	84,448.00	0.05
521	603297	永新光学	900	84,438.00	0.05
522	002661	克明食品	8,300	83,498.00	0.05
523	601008	连云港	21,800	83,494.00	0.05
524	300800	力合科技	8,000	83,440.00	0.05
525	601228	广州港	24,500	83,055.00	0.05
526	600011	华能国际	12,200	82,594.00	0.05
527	601066	中信建投	3,200	82,400.00	0.05
528	600191	华资实业	11,900	82,348.00	0.05
529	000631	顺发恒业	28,000	82,320.00	0.05
530	600837	海通证券	7,400	82,288.00	0.05
531	000966	长源电力	17,100	81,225.00	0.05
532	605138	盛泰集团	14,700	81,144.00	0.05
533	688079	美迪凯	9,359	81,048.94	0.05
534	601825	沪农商行	9,500	80,845.00	0.05
535	601963	重庆银行	8,700	80,736.00	0.05
536	000897	津滨发展	34,000	80,580.00	0.05

537	000782	恒申新材	17,600	80,256.00	0.05
538	601799	星宇股份	600	80,088.00	0.05
539	600076	康欣新材	38,500	80,080.00	0.05
540	600905	三峡能源	18,200	79,534.00	0.05
541	601003	柳钢股份	28,400	78,384.00	0.05
542	002060	广东建工	21,400	78,324.00	0.05
543	600126	杭钢股份	16,300	77,914.00	0.05
544	601226	华电科工	11,500	77,740.00	0.05
545	688508	芯朋微	1,800	77,346.00	0.05
546	603008	喜临门	4,600	77,096.00	0.05
547	603707	健友股份	5,800	76,966.00	0.05
548	600246	万通发展	10,300	76,735.00	0.05
549	002421	达实智能	22,300	76,489.00	0.05
550	603659	璞泰来	4,800	76,368.00	0.05
551	600255	鑫科材料	22,300	76,266.00	0.05
552	000959	首钢股份	24,900	75,945.00	0.05
553	002212	天融信	11,700	75,465.00	0.05
554	600491	龙元建设	20,100	75,174.00	0.05
555	688238	和元生物	15,200	75,088.00	0.05
556	300587	天铁股份	17,100	75,069.00	0.05
557	000681	视觉中国	3,600	74,952.00	0.05
558	603986	兆易创新	700	74,760.00	0.05
559	000825	太钢不锈	21,200	73,776.00	0.04
560	600366	宁波韵升	10,000	73,600.00	0.04
561	688278	特宝生物	1,000	73,370.00	0.04
562	600037	歌华有线	9,800	73,108.00	0.04
563	603109	神驰机电	4,100	72,775.00	0.04
564	002082	万邦德	11,300	72,659.00	0.04
565	603369	今世缘	1,600	72,368.00	0.04
566	603599	广信股份	6,000	72,300.00	0.04
567	603712	七一二	3,700	72,039.00	0.04

568	300684	中石科技	3,200	71,776.00	0.04
569	603936	博敏电子	8,500	71,570.00	0.04
570	002461	珠江啤酒	7,200	71,208.00	0.04
571	601801	皖新传媒	9,700	71,198.00	0.04
572	603338	浙江鼎力	1,100	70,972.00	0.04
573	603886	元祖股份	4,900	70,658.00	0.04
574	600420	国药现代	5,900	70,446.00	0.04
575	688543	国科军工	1,400	70,168.00	0.04
576	600160	巨化股份	2,900	69,948.00	0.04
577	002203	海亮股份	6,500	69,875.00	0.04
578	603055	台华新材	6,300	69,804.00	0.04
579	600269	赣粤高速	12,400	69,564.00	0.04
580	300903	科翔股份	8,700	69,513.00	0.04
581	002817	黄山胶囊	11,100	69,486.00	0.04
582	600177	雅戈尔	7,800	69,420.00	0.04
583	300408	三环集团	1,800	69,318.00	0.04
584	300699	光威复材	2,000	69,300.00	0.04
585	600489	中金黄金	5,700	68,571.00	0.04
586	002540	亚太科技	11,100	68,376.00	0.04
587	002608	江苏国信	8,900	68,263.00	0.04
588	000967	盈峰环境	13,700	68,089.00	0.04
589	300241	瑞丰光电	12,400	68,076.00	0.04
590	002367	康力电梯	9,900	68,013.00	0.04
591	000429	粤高速 A	4,600	67,620.00	0.04
592	601918	新集能源	9,400	67,492.00	0.04
593	002723	小崧股份	9,700	67,415.00	0.04
594	002399	海普瑞	6,300	67,347.00	0.04
595	601678	滨化股份	17,900	67,304.00	0.04
596	688789	宏华数科	1,013	67,242.94	0.04
597	600879	航天电子	7,500	67,200.00	0.04
598	002410	广联达	5,700	67,032.00	0.04

599	002911	佛燃能源	5,300	66,992.00	0.04
600	301389	隆扬电子	4,000	66,880.00	0.04
601	600369	西南证券	14,300	66,781.00	0.04
602	688033	天宜上佳	11,600	66,700.00	0.04
603	000034	神州数码	1,900	66,595.00	0.04
604	300249	依米康	5,200	66,456.00	0.04
605	300274	阳光电源	900	66,447.00	0.04
606	600642	申能股份	7,000	66,430.00	0.04
607	603229	奥翔药业	6,600	65,934.00	0.04
608	300035	中科电气	4,400	65,780.00	0.04
609	000153	丰原药业	10,700	65,591.00	0.04
610	000001	平安银行	5,600	65,520.00	0.04
611	600435	北方导航	6,700	65,392.00	0.04
612	601377	兴业证券	10,400	65,104.00	0.04
613	000156	华数传媒	8,900	64,080.00	0.04
614	603228	景旺电子	2,300	64,032.00	0.04
614	000016	深康佳 A	11,600	64,032.00	0.04
615	300394	天孚通信	700	63,952.00	0.04
616	600468	百利电气	13,600	63,920.00	0.04
617	601608	中信重工	15,200	63,840.00	0.04
618	603766	隆鑫通用	7,000	63,700.00	0.04
619	688171	纬德信息	3,800	63,574.00	0.04
620	600256	广汇能源	9,400	63,262.00	0.04
621	300787	海能实业	4,700	63,074.00	0.04
622	688172	燕东微	3,141	62,977.05	0.04
623	002760	凤形股份	3,700	62,900.00	0.04
624	601083	锦江航运	6,600	62,832.00	0.04
625	688472	阿特斯	5,000	62,800.00	0.04
626	000423	东阿阿胶	1,000	62,720.00	0.04
627	688533	上声电子	1,800	62,676.00	0.04
628	600526	菲达环保	13,900	62,411.00	0.04

629	002768	国恩股份	2,700	62,289.00	0.04
630	000426	兴业银锡	5,600	62,272.00	0.04
631	601158	重庆水务	12,700	62,230.00	0.04
632	600229	城市传媒	8,900	62,033.00	0.04
633	002437	誉衡药业	24,900	62,001.00	0.04
634	601615	明阳智能	4,900	61,789.00	0.04
635	301317	鑫磊股份	3,100	61,659.00	0.04
636	603998	方盛制药	5,900	61,478.00	0.04
637	300181	佐力药业	4,000	61,440.00	0.04
638	603565	中谷物流	6,200	60,760.00	0.04
639	603162	海通发展	6,600	60,720.00	0.04
640	300113	顺网科技	3,600	60,516.00	0.04
641	000534	万泽股份	4,700	60,489.00	0.04
642	002562	兄弟科技	14,200	60,350.00	0.04
643	002422	科伦药业	2,000	59,860.00	0.04
644	601869	长飞光纤	2,000	59,780.00	0.04
645	605188	国光连锁	7,800	59,592.00	0.04
646	601069	西部黄金	5,200	59,540.00	0.04
647	000488	晨鸣纸业	19,500	59,475.00	0.04
648	300593	新雷能	5,300	59,360.00	0.04
649	002841	视源股份	1,600	59,056.00	0.04
650	603279	景津装备	3,300	59,004.00	0.04
651	301358	湖南裕能	1,300	58,916.00	0.04
652	301155	海力风电	1,100	58,641.00	0.04
653	300124	汇川技术	1,000	58,580.00	0.04
654	000999	华润三九	1,320	58,528.80	0.04
655	300638	广和通	2,900	58,435.00	0.04
656	603187	海容冷链	5,200	58,188.00	0.04
657	002306	中科云网	20,200	58,176.00	0.04
658	301290	东星医疗	2,500	58,100.00	0.04
659	600354	敦煌种业	9,800	58,016.00	0.04

660	301309	万得凯	2,400	58,008.00	0.04
661	688195	腾景科技	1,443	57,979.74	0.03
662	002935	天奥电子	3,600	57,960.00	0.03
663	002412	汉森制药	9,600	57,696.00	0.03
664	600339	中油工程	16,000	57,280.00	0.03
665	002238	天威视讯	7,100	57,013.00	0.03
666	688579	山大地纬	6,200	56,978.00	0.03
667	002613	北玻股份	14,100	56,964.00	0.03
668	688598	金博股份	2,694	56,735.64	0.03
669	688002	睿创微纳	1,200	56,412.00	0.03
670	002456	欧菲光	4,700	56,306.00	0.03
671	300053	航宇微	4,300	56,287.00	0.03
672	000529	广弘控股	9,500	56,050.00	0.03
673	300170	汉得信息	4,500	55,800.00	0.03
674	300192	科德教育	3,500	55,650.00	0.03
675	300172	中电环保	11,000	55,550.00	0.03
676	600790	轻纺城	14,800	55,500.00	0.03
677	601866	中远海发	21,000	54,810.00	0.03
678	688337	普源精电	1,400	54,600.00	0.03
679	600750	江中药业	2,400	54,480.00	0.03
680	603106	恒银科技	6,900	54,303.00	0.03
681	603617	君禾股份	7,400	54,242.00	0.03
682	000037	深南电A	6,800	54,128.00	0.03
683	600595	中孚实业	19,100	54,053.00	0.03
684	600906	财达证券	7,600	53,960.00	0.03
685	300558	贝达药业	1,000	53,930.00	0.03
686	300790	宇瞳光学	2,800	53,452.00	0.03
687	002301	齐心集团	7,500	53,325.00	0.03
688	002907	华森制药	4,100	53,300.00	0.03
689	688479	友车科技	3,000	53,250.00	0.03
690	600795	国电电力	11,600	53,128.00	0.03

691	000572	海马汽车	12,700	53,086.00	0.03
692	000520	凤凰航运	11,300	52,884.00	0.03
693	301236	软通动力	900	52,839.00	0.03
694	601969	海南矿业	7,400	52,466.00	0.03
695	300434	金石亚药	6,300	51,975.00	0.03
696	301370	国科恒泰	4,800	51,840.00	0.03
697	300659	中孚信息	3,200	51,808.00	0.03
698	601860	紫金银行	18,100	51,585.00	0.03
699	688409	富创精密	1,000	51,570.00	0.03
700	300082	奥克股份	8,200	51,414.00	0.03
701	688300	联瑞新材	797	51,326.80	0.03
702	300267	尔康制药	18,400	51,152.00	0.03
703	000768	中航西飞	1,800	50,832.00	0.03
704	300652	雷迪克	1,700	50,524.00	0.03
705	300767	震安科技	5,600	50,512.00	0.03
706	002701	奥瑞金	8,900	50,463.00	0.03
707	300418	昆仑万维	1,300	50,024.00	0.03
708	688289	圣湘生物	2,200	49,940.00	0.03
709	605196	华通线缆	4,200	49,056.00	0.03
710	000736	中交地产	5,700	49,020.00	0.03
711	688270	臻镭科技	1,400	49,000.00	0.03
712	002270	华明装备	2,900	48,981.00	0.03
713	600612	老凤祥	900	48,843.00	0.03
714	688057	金达莱	4,400	48,840.00	0.03
714	002850	科达利	500	48,840.00	0.03
715	601999	出版传媒	7,700	48,279.00	0.03
716	000066	中国长城	3,300	48,081.00	0.03
717	688205	德科立	526	47,866.00	0.03
718	301078	孩子王	4,200	47,796.00	0.03
719	603195	公牛集团	675	47,412.00	0.03
720	300342	天银机电	2,900	47,067.00	0.03

721	600996	贵广网络	5,500	47,025.00	0.03
722	603997	继峰股份	4,100	46,945.00	0.03
723	688048	长光华芯	1,200	46,788.00	0.03
724	688148	芳源股份	9,200	45,540.00	0.03
725	603529	爱玛科技	1,100	45,122.00	0.03
726	002585	双星新材	8,400	44,856.00	0.03
727	601065	江盐集团	5,100	44,727.00	0.03
728	002655	共达电声	3,500	44,555.00	0.03
729	688114	华大智造	950	44,450.50	0.03
730	300365	恒华科技	7,200	44,208.00	0.03
731	688016	心脉医疗	400	43,940.00	0.03
732	601800	中国交建	4,200	43,890.00	0.03
733	000407	胜利股份	12,800	43,776.00	0.03
734	002707	众信旅游	5,900	43,601.00	0.03
735	603358	华达科技	1,300	43,420.00	0.03
736	605123	派克新材	800	43,008.00	0.03
737	002415	海康威视	1,400	42,980.00	0.03
738	688616	西力科技	4,129	42,900.31	0.03
739	600436	片仔癀	200	42,900.00	0.03
740	600528	中铁工业	5,300	42,718.00	0.03
741	603272	联翔股份	3,100	42,656.00	0.03
742	300737	科顺股份	8,400	42,588.00	0.03
743	600820	隧道股份	5,900	42,421.00	0.03
744	300048	合康新能	8,400	42,336.00	0.03
745	300423	昇辉科技	6,100	42,212.00	0.03
746	301239	普瑞眼科	900	42,210.00	0.03
747	601568	北元集团	10,000	42,000.00	0.03
748	002663	普邦股份	21,100	41,989.00	0.03
749	688200	华峰测控	400	41,800.00	0.03
750	600379	宝光股份	4,400	41,668.00	0.03
751	300377	赢时胜	1,500	41,340.00	0.02

752	688099	晶晨股份	600	41,208.00	0.02
753	600641	万业企业	2,800	40,936.00	0.02
754	603612	索通发展	3,000	40,530.00	0.02
755	688766	普冉股份	400	40,504.00	0.02
756	601989	中国重工	8,400	40,404.00	0.02
757	688296	和达科技	3,600	40,392.00	0.02
758	002690	美亚光电	2,700	40,014.00	0.02
759	300045	华力创通	1,900	39,691.00	0.02
760	603678	火炬电子	1,300	39,650.00	0.02
761	300933	中辰股份	4,700	39,292.00	0.02
762	601061	中信金属	5,400	39,204.00	0.02
763	601326	秦港股份	11,600	38,860.00	0.02
764	688188	柏楚电子	200	38,850.00	0.02
765	002237	恒邦股份	3,800	38,380.00	0.02
766	688167	炬光科技	600	38,220.00	0.02
767	301052	果麦文化	1,500	38,160.00	0.02
768	003025	思进智能	2,700	38,043.00	0.02
769	003011	海象新材	2,500	38,000.00	0.02
770	600602	云赛智联	2,400	37,968.00	0.02
771	002985	北摩高科	1,600	37,600.00	0.02
772	002916	深南电路	300	37,500.00	0.02
773	688106	金宏气体	2,200	37,422.00	0.02
774	688281	华秦科技	400	37,240.00	0.02
775	603113	金能科技	6,600	37,158.00	0.02
775	300314	戴维医疗	3,300	37,158.00	0.02
776	603558	健盛集团	3,400	36,584.00	0.02
777	688050	爱博医疗	400	36,412.00	0.02
778	600959	江苏有线	10,800	36,180.00	0.02
779	300782	卓胜微	400	35,880.00	0.02
780	600017	日照港	11,200	35,840.00	0.02
781	605319	无锡振华	1,700	35,785.00	0.02

782	001227	兰州银行	14,500	35,670.00	0.02
783	601311	骆驼股份	4,300	35,647.00	0.02
784	603505	金石资源	1,500	35,610.00	0.02
785	002206	海利得	8,300	35,607.00	0.02
786	600583	海油工程	6,500	35,555.00	0.02
787	601156	东航物流	2,100	35,427.00	0.02
788	002812	恩捷股份	1,100	35,189.00	0.02
789	688301	奕瑞科技	368	35,169.76	0.02
790	688136	科兴制药	1,600	34,976.00	0.02
791	002401	中远海科	2,200	34,936.00	0.02
792	002946	新乳业	2,400	34,824.00	0.02
793	001283	豪鹏科技	600	34,734.00	0.02
794	301004	嘉益股份	300	34,695.00	0.02
795	000596	古井贡酒	200	34,660.00	0.02
796	600449	宁夏建材	2,300	34,546.00	0.02
797	600648	外高桥	2,900	34,539.00	0.02
798	002984	森麒麟	1,400	34,524.00	0.02
799	600618	氯碱化工	3,500	34,510.00	0.02
800	000672	上峰水泥	4,500	34,425.00	0.02
801	002683	广东宏大	1,300	34,424.00	0.02
802	688426	康为世纪	1,200	34,332.00	0.02
803	003000	劲仔食品	2,500	34,250.00	0.02
804	603236	移远通信	500	34,220.00	0.02
804	600511	国药股份	1,000	34,220.00	0.02
805	600094	大名城	9,400	34,216.00	0.02
806	603322	超讯通信	900	34,200.00	0.02
807	603890	春秋电子	2,900	34,075.00	0.02
808	600057	厦门象屿	5,200	33,748.00	0.02
809	601339	百隆东方	6,200	33,728.00	0.02
810	002056	横店东磁	2,600	33,696.00	0.02
811	688326	经纬恒润	400	33,640.00	0.02

812	603337	杰克股份	1,100	33,506.00	0.02
813	002637	赞宇科技	3,400	33,490.00	0.02
814	002468	申通快递	3,300	33,429.00	0.02
815	002560	通达股份	4,900	33,418.00	0.02
816	002483	润邦股份	6,400	33,344.00	0.02
817	000060	中金岭南	7,100	33,299.00	0.02
818	002390	信邦制药	7,300	33,215.00	0.02
819	002859	洁美科技	1,600	33,200.00	0.02
820	002778	中晟高科	1,900	33,174.00	0.02
821	600323	瀚蓝环境	1,400	33,068.00	0.02
822	002202	金风科技	3,200	33,056.00	0.02
823	600021	上海电力	3,600	33,012.00	0.02
824	000957	中通客车	3,000	33,000.00	0.02
825	000680	山推股份	3,400	32,980.00	0.02
826	601702	华峰铝业	1,800	32,976.00	0.02
827	600861	北京人力	1,700	32,895.00	0.02
828	600862	中航高科	1,300	32,838.00	0.02
829	000422	湖北宜化	2,600	32,812.00	0.02
830	000887	中鼎股份	2,500	32,800.00	0.02
831	002973	侨银股份	3,100	32,798.00	0.02
832	600308	华泰股份	9,000	32,760.00	0.02
833	605337	李子园	2,900	32,741.00	0.02
834	600487	亨通光电	1,900	32,718.00	0.02
835	300841	康华生物	600	32,712.00	0.02
836	600584	长电科技	800	32,688.00	0.02
837	603979	金诚信	900	32,670.00	0.02
838	002265	建设工业	1,400	32,578.00	0.02
839	600141	兴发集团	1,500	32,550.00	0.02
840	000969	安泰科技	2,900	32,335.00	0.02
841	600814	杭州解百	3,900	32,331.00	0.02
842	000690	宝新能源	7,200	32,256.00	0.02

843	000797	中国武夷	11,600	32,132.00	0.02
844	002469	三维化学	4,400	32,120.00	0.02
845	600873	梅花生物	3,200	32,096.00	0.02
846	603598	引力传媒	1,900	32,091.00	0.02
847	688248	南网科技	1,000	32,090.00	0.02
848	000560	我爱我家	10,500	32,025.00	0.02
849	300226	上海钢联	1,400	32,018.00	0.02
850	601113	华鼎股份	8,200	31,980.00	0.02
851	000735	罗牛山	4,800	31,968.00	0.02
852	600888	新疆众和	4,500	31,950.00	0.02
853	688091	上海谊众	800	31,936.00	0.02
854	002032	苏泊尔	600	31,926.00	0.02
855	600166	福田汽车	12,700	31,877.00	0.02
856	300350	华鹏飞	5,900	31,860.00	0.02
857	600885	宏发股份	1,000	31,820.00	0.02
858	002459	晶澳科技	2,300	31,625.00	0.02
859	600673	东阳光	2,800	31,612.00	0.02
860	002372	伟星新材	2,500	31,575.00	0.02
861	600132	重庆啤酒	500	31,510.00	0.02
862	000848	承德露露	3,500	31,395.00	0.02
863	600557	康缘药业	2,300	31,326.00	0.02
864	301028	东亚机械	2,900	31,291.00	0.02
865	002830	名雕股份	2,500	31,225.00	0.02
866	002062	宏润建设	6,100	31,171.00	0.02
867	002632	道明光学	3,500	31,150.00	0.02
868	300945	曼卡龙	2,700	31,023.00	0.02
869	300822	贝仕达克	1,500	30,975.00	0.02
870	688349	三一重能	1,000	30,880.00	0.02
871	300942	易瑞生物	3,600	30,852.00	0.02
872	603301	振德医疗	1,400	30,786.00	0.02
873	600961	株冶集团	3,900	30,693.00	0.02

874	002430	杭氧股份	1,400	30,520.00	0.02
875	603025	大豪科技	2,000	30,500.00	0.02
876	600667	太极实业	4,400	30,448.00	0.02
877	301321	翰博高新	2,100	30,240.00	0.02
878	603103	横店影视	2,100	30,219.00	0.02
879	600853	龙建股份	7,500	30,000.00	0.02
880	000032	深桑达 A	1,700	29,988.00	0.02
881	300219	鸿利智汇	4,000	29,960.00	0.02
882	688110	东芯股份	1,200	29,880.00	0.02
882	001696	宗申动力	1,200	29,880.00	0.02
883	301039	中集车辆	3,300	29,865.00	0.02
884	688085	三友医疗	1,400	29,666.00	0.02
885	600789	鲁抗医药	3,100	29,605.00	0.02
886	002600	领益智造	3,700	29,600.00	0.02
887	002895	川恒股份	1,200	29,520.00	0.02
888	002106	莱宝高科	2,700	29,457.00	0.02
889	688306	均普智能	3,800	29,450.00	0.02
890	002262	恩华药业	1,200	29,220.00	0.02
891	300015	爱尔眼科	2,200	29,150.00	0.02
892	002444	巨星科技	900	29,115.00	0.02
893	300752	隆利科技	1,700	28,900.00	0.02
894	002549	凯美特气	4,700	28,811.00	0.02
895	002134	天津普林	1,500	28,800.00	0.02
896	300803	指南针	300	28,785.00	0.02
897	301127	天源环保	1,900	28,766.00	0.02
898	300024	机器人	1,600	28,720.00	0.02
899	688403	汇成股份	3,200	28,672.00	0.02
900	002890	弘宇股份	2,900	28,594.00	0.02
901	300440	运达科技	3,600	28,512.00	0.02
902	600616	金枫酒业	5,000	28,500.00	0.02
903	600664	哈药股份	6,900	28,497.00	0.02

904	601077	渝农商行	4,700	28,435.00	0.02
905	603296	华勤技术	400	28,380.00	0.02
906	301320	豪江智能	1,900	28,329.00	0.02
907	002320	海峡股份	4,300	28,165.00	0.02
908	301106	骏成科技	1,000	28,160.00	0.02
909	603915	国茂股份	2,400	28,128.00	0.02
910	603933	睿能科技	1,800	27,972.00	0.02
911	002936	郑州银行	13,300	27,930.00	0.02
912	600258	首旅酒店	1,900	27,873.00	0.02
913	300772	运达股份	2,100	27,804.00	0.02
914	301120	新特电气	2,800	27,748.00	0.02
915	601015	陕西黑猫	8,300	27,722.00	0.02
916	605296	神农集团	1,000	27,700.00	0.02
917	603516	淳中科技	500	27,640.00	0.02
918	600604	市北高新	5,800	27,608.00	0.02
919	300233	金城医药	2,300	27,600.00	0.02
920	600970	中材国际	2,900	27,492.00	0.02
921	002572	索菲亚	1,600	27,488.00	0.02
922	688178	万德斯	2,200	27,478.00	0.02
923	600099	林海股份	3,100	27,280.00	0.02
923	300303	聚飞光电	4,000	27,280.00	0.02
924	000786	北新建材	900	27,279.00	0.02
925	300550	和仁科技	1,800	27,270.00	0.02
926	603330	天洋新材	4,300	27,262.00	0.02
927	688008	澜起科技	400	27,160.00	0.02
928	603989	艾华集团	1,800	27,144.00	0.02
929	000715	中兴商业	3,900	27,105.00	0.02
930	002831	裕同科技	1,000	27,100.00	0.02
931	688119	中钢洛耐	6,937	27,054.30	0.02
932	600173	卧龙地产	6,800	26,928.00	0.02
933	300291	百纳千成	5,300	26,659.00	0.02

934	603693	江苏新能	2,700	26,595.00	0.02
935	601187	厦门银行	4,700	26,508.00	0.02
936	601022	宁波远洋	3,300	26,499.00	0.02
937	603323	苏农银行	5,000	26,450.00	0.02
938	600872	中炬高新	1,200	26,424.00	0.02
939	301062	上海艾录	2,000	26,200.00	0.02
940	600851	海欣股份	4,500	26,100.00	0.02
940	002488	金固股份	2,500	26,100.00	0.02
941	688052	纳芯微	200	26,060.00	0.02
942	600467	好当家	11,200	25,872.00	0.02
943	603737	三棵树	600	25,560.00	0.02
944	002223	鱼跃医疗	700	25,543.00	0.02
945	600300	维维股份	7,900	25,438.00	0.02
946	300406	九强生物	1,900	25,384.00	0.02
947	600422	昆药集团	1,600	25,360.00	0.02
948	600509	天富能源	3,900	25,233.00	0.02
949	000048	京基智农	1,400	25,200.00	0.02
950	300627	华测导航	600	25,080.00	0.02
951	601515	东峰集团	6,300	25,074.00	0.02
952	688319	欧林生物	2,361	25,026.60	0.02
953	000930	中粮科技	4,500	24,975.00	0.02
954	600551	时代出版	2,900	24,969.00	0.02
955	600180	瑞茂通	5,800	24,940.00	0.02
956	300230	永利股份	5,600	24,920.00	0.02
957	000059	华锦股份	5,200	24,908.00	0.02
958	000965	天保基建	8,300	24,900.00	0.02
959	300383	光环新网	1,700	24,803.00	0.01
960	301526	国际复材	6,700	24,790.00	0.01
961	002376	新北洋	3,800	24,776.00	0.01
962	300252	金信诺	2,300	24,748.00	0.01
963	603065	宿迁联盛	3,400	24,718.00	0.01

964	300426	唐德影视	2,500	24,675.00	0.01
965	600329	达仁堂	800	24,640.00	0.01
966	300257	开山股份	2,700	24,624.00	0.01
967	000968	蓝焰控股	3,700	24,605.00	0.01
968	002162	悦心健康	7,100	24,566.00	0.01
969	300661	圣邦股份	300	24,534.00	0.01
970	002567	唐人神	4,800	24,480.00	0.01
971	002476	宝莫股份	5,800	24,476.00	0.01
972	603801	志邦家居	1,900	24,339.00	0.01
973	000963	华东医药	700	24,220.00	0.01
974	601901	方正证券	2,900	24,157.00	0.01
975	300552	万集科技	700	24,045.00	0.01
976	601665	齐鲁银行	4,300	24,037.00	0.01
977	000603	盛达资源	2,000	23,980.00	0.01
978	603063	禾望电气	1,200	23,952.00	0.01
979	600363	联创光电	500	23,940.00	0.01
980	688389	普门科技	1,600	23,824.00	0.01
981	600301	华锡有色	1,400	23,814.00	0.01
982	600171	上海贝岭	600	23,808.00	0.01
983	300072	海新能科	6,700	23,785.00	0.01
984	600531	豫光金铅	3,700	23,754.00	0.01
985	601012	隆基绿能	1,500	23,565.00	0.01
986	002174	游族网络	2,500	23,375.00	0.01
987	300139	晓程科技	1,600	23,344.00	0.01
988	300304	云意电气	2,900	23,200.00	0.01
989	600486	扬农化工	400	23,148.00	0.01
990	688088	虹软科技	600	23,136.00	0.01
991	300485	赛升药业	3,300	23,133.00	0.01
992	300639	凯普生物	3,900	23,127.00	0.01
993	600703	三安光电	1,900	23,123.00	0.01
994	603866	桃李面包	3,500	23,100.00	0.01

995	688630	芯碁微装	400	23,088.00	0.01
996	600095	湘财股份	3,200	23,040.00	0.01
997	000856	冀东装备	3,300	22,770.00	0.01
997	000598	兴蓉环境	3,000	22,770.00	0.01
998	600773	西藏城投	2,100	22,638.00	0.01
998	600201	生物股份	3,300	22,638.00	0.01
999	000029	深深房A	1,500	22,590.00	0.01
100 0	300248	新开普	2,300	22,287.00	0.01
100 1	600452	涪陵电力	2,100	22,239.00	0.01
100 2	300364	中文在线	900	22,077.00	0.01
100 3	300066	三川智慧	5,600	22,064.00	0.01
100 4	002920	德赛西威	200	22,022.00	0.01
100 5	600483	福能股份	2,200	21,934.00	0.01
100 6	688400	凌云光	1,000	21,920.00	0.01
100 7	002966	苏州银行	2,700	21,897.00	0.01
100 8	300634	彩讯股份	1,000	21,800.00	0.01
100 9	002058	威尔泰	2,000	21,460.00	0.01
101 0	300459	汤姆猫	3,700	21,238.00	0.01
101 1	000791	甘肃能源	3,500	21,105.00	0.01
101 2	600694	大商股份	800	21,096.00	0.01
101 3	300451	创业慧康	4,700	21,056.00	0.01

101 4	688152	麒麟信安	400	20,816.00	0.01
101 5	000626	远大控股	3,600	20,700.00	0.01
101 6	300298	三诺生物	800	20,648.00	0.01
101 7	301503	智迪科技	600	20,592.00	0.01
101 8	688568	中科星图	400	20,412.00	0.01
101 9	300151	昌红科技	1,200	20,400.00	0.01
101 9	002061	浙江交科	5,000	20,400.00	0.01
102 0	000718	苏宁环球	8,600	20,296.00	0.01
102 1	301136	招标股份	1,700	20,128.00	0.01
102 2	300206	理邦仪器	1,800	20,124.00	0.01
102 3	600757	长江传媒	2,100	20,097.00	0.01
102 4	603628	清源股份	1,600	19,968.00	0.01
102 5	601059	信达证券	1,300	19,474.00	0.01
102 6	002508	老板电器	900	19,287.00	0.01
102 7	603882	金域医学	700	19,271.00	0.01
102 8	688307	中润光学	800	19,200.00	0.01
102 9	002340	格林美	2,900	18,937.00	0.01
103 0	688776	国光电气	400	18,932.00	0.01

103 1	002048	宁波华翔	1,500	18,930.00	0.01
103 2	603197	保隆科技	500	18,875.00	0.01
103 3	600984	建设机械	5,900	18,821.00	0.01
103 4	301265	华新环保	2,100	18,816.00	0.01
103 5	600661	昂立教育	1,600	18,752.00	0.01
103 6	600133	东湖高新	2,000	18,700.00	0.01
103 7	601126	四方股份	1,100	18,656.00	0.01
103 8	002851	麦格米特	300	18,438.00	0.01
103 9	688726	拉普拉斯	557	18,414.42	0.01
104 0	603398	沐邦高科	800	18,408.00	0.01
104 1	002590	万安科技	1,500	18,330.00	0.01
104 2	002261	拓维信息	1,000	18,310.00	0.01
104 3	688166	博瑞医药	600	18,120.00	0.01
104 4	000913	钱江摩托	1,000	18,010.00	0.01
104 5	300643	万通智控	1,500	17,940.00	0.01
104 6	603072	天和磁材	1,454	17,884.20	0.01
104 7	002676	顺威股份	3,000	17,880.00	0.01
104 8	000026	飞亚达	1,700	17,629.00	0.01

1049	688175	高凌信息	1,000	17,230.00	0.01
1050	300476	胜宏科技	400	16,836.00	0.01
1051	300636	同和药业	2,100	16,737.00	0.01
1052	603386	骏亚科技	1,500	16,680.00	0.01
1053	600976	健民集团	400	16,672.00	0.01
1054	002318	久立特材	700	16,387.00	0.01
1055	688432	有研硅	1,448	16,362.40	0.01
1056	603198	迎驾贡酒	300	16,182.00	0.01
1057	600548	深高速	1,200	16,176.00	0.01
1058	002099	海翔药业	3,100	15,996.00	0.01
1059	688092	爱科科技	760	15,580.00	0.01
1060	601567	三星医疗	500	15,380.00	0.01
1061	301003	江苏博云	700	15,281.00	0.01
1062	002923	润都股份	1,600	15,264.00	0.01
1063	603171	税友股份	500	15,250.00	0.01
1064	002832	比音勒芬	700	14,987.00	0.01
1065	601222	林洋能源	2,100	14,847.00	0.01
1066	300762	上海瀚讯	700	14,721.00	0.01

106 7	603056	德邦股份	1,000	14,330.00	0.01
106 8	688526	科前生物	1,000	14,290.00	0.01
106 9	601990	南京证券	1,600	13,856.00	0.01
107 0	603833	欧派家居	200	13,788.00	0.01
107 1	688615	合合信息	83	13,759.74	0.01
107 2	688125	安达智能	344	13,440.08	0.01
107 3	688196	卓越新能	400	13,436.00	0.01
107 4	688721	龙图光罩	236	13,416.60	0.01
107 5	001313	粤海饲料	1,500	13,110.00	0.01
107 6	603938	三孚股份	1,196	12,928.76	0.01
107 7	603786	科博达	200	12,360.00	0.01
107 8	601916	浙商银行	4,200	12,222.00	0.01
107 9	600446	金证股份	700	12,068.00	0.01
108 0	301189	奥尼电子	500	12,025.00	0.01
108 1	002346	柘中股份	1,200	11,832.00	0.01
108 2	688123	聚辰股份	200	11,704.00	0.01
108 3	002337	赛象科技	2,300	11,431.00	0.01
108 4	600052	东望时代	2,500	11,300.00	0.01

108 5	002148	北纬科技	1,700	11,237.00	0.01
108 6	300359	全通教育	2,100	11,046.00	0.01
108 7	002044	美年健康	2,300	10,557.00	0.01
108 8	002771	真视通	600	10,548.00	0.01
108 9	601668	中国建筑	1,700	10,200.00	0.01
109 0	301201	诚达药业	500	10,090.00	0.01
109 1	301439	泓淋电力	700	9,625.00	0.01
109 2	002835	同为股份	500	9,600.00	0.01
109 3	000042	中洲控股	2,100	9,387.00	0.01
109 4	600536	中国软件	200	9,338.00	0.01
109 5	300058	蓝色光标	1,000	9,280.00	0.01
109 6	001391	国货航	1,345	9,146.00	0.01
109 7	601019	山东出版	800	9,080.00	0.01
109 8	002402	和而泰	500	9,055.00	0.01
109 9	002127	南极电商	2,000	8,800.00	0.01
110 0	603660	苏州科达	1,300	8,723.00	0.01
110 1	300373	扬杰科技	200	8,704.00	0.01
110 2	600746	江苏索普	1,200	8,412.00	0.01

110 3	003022	联泓新科	600	8,262.00	0.00
110 4	603225	新凤鸣	700	7,791.00	0.00
110 5	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
110 6	688239	航宇科技	200	7,460.00	0.00
110 7	688710	益诺思	216	7,253.28	0.00
110 8	688193	仁度生物	200	7,150.00	0.00
110 9	300671	富满微	200	7,108.00	0.00
111 0	300036	超图软件	400	6,792.00	0.00
111 1	603194	中力股份	149	4,191.37	0.00
111 2	603207	小方制药	154	4,104.10	0.00
111 3	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
111 4	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
111 5	603091	众鑫股份	66	2,932.38	0.00
111 6	603391	力聚热能	58	2,398.30	0.00
111 7	688329	艾隆科技	162	2,217.78	0.00
111 8	603285	键邦股份	92	2,080.12	0.00
111 9	603310	巍华新材	79	1,418.05	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	7,496,049.00	4.52
2	300750	宁德时代	4,681,180.00	2.82
3	601318	中国平安	4,288,118.00	2.59
4	600900	长江电力	3,504,917.00	2.11
5	000333	美的集团	3,289,012.00	1.98
6	600036	招商银行	3,268,148.00	1.97
7	000651	格力电器	3,249,645.00	1.96
8	601899	紫金矿业	2,828,321.00	1.71
9	600887	伊利股份	2,773,214.00	1.67
10	601166	兴业银行	2,682,690.00	1.62
11	300760	迈瑞医疗	2,673,482.00	1.61
12	000725	京东方A	2,559,560.00	1.54
13	600030	中信证券	2,501,619.60	1.51
14	000858	五粮液	2,450,635.00	1.48
15	601398	工商银行	2,334,940.00	1.41
16	600690	海尔智家	2,282,148.00	1.38
17	601138	工业富联	2,201,664.00	1.33
18	002475	立讯精密	2,114,989.39	1.28
19	601288	农业银行	2,092,606.00	1.26
20	601688	华泰证券	2,084,534.00	1.26

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,036,194.00	2.44

2	300750	宁德时代	2,668,488.00	1.61
3	601318	中国平安	2,552,199.00	1.54
4	000651	格力电器	2,428,199.00	1.47
5	300760	迈瑞医疗	2,375,412.00	1.43
6	600036	招商银行	2,049,255.00	1.24
7	600900	长江电力	2,040,200.00	1.23
8	601166	兴业银行	2,009,305.00	1.21
9	000333	美的集团	1,942,952.00	1.17
10	600690	海尔智家	1,836,534.00	1.11
11	000858	五粮液	1,822,237.00	1.10
12	601138	工业富联	1,799,746.00	1.09
13	601601	中国太保	1,782,856.00	1.08
14	601600	中国铝业	1,763,800.00	1.06
15	600030	中信证券	1,754,070.00	1.06
16	600887	伊利股份	1,702,049.00	1.03
17	600183	生益科技	1,564,843.00	0.94
18	000725	京东方A	1,536,979.00	0.93
19	601766	中国中车	1,509,788.00	0.91
20	601899	紫金矿业	1,507,788.00	0.91

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	768,832,958.53
卖出股票收入（成交）总额	639,808,235.35

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)	16,562.46	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,562.46	0.01

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	123249	英搏转债	58	8,485.71	0.01
2	127107	领益转债	64	8,076.75	0.00

注:本基金本报告期末仅持有两只债券。

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 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行（证券代码：600036）、中信证券（证券代码：600030）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2024年06月24日，招商银行（证券代码：600036）发行人招商银行股份有限公司因未能有效穿透识别底层资产、信息披露不规范被国家金融监督管理总局罚款350万元。

2024年12月20日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因经纪业务管理存在不足、场外衍生品业务管理存在不足被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2024年08月23日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的公司选取的上市标准含净利润标准但上市当年即亏损被北京证券交易所采取出具警示函并记入证券期货市场诚信档案。

2024年08月05日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的公司选取的上市标准含净利润标准但上市当年即亏损被中国证券监督管理委员会贵州监管局出具警示函的措施并记入证券期货市场诚信档案。

2024年05月08日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因在持续督导履职过程中对关联关系核查不充分、对真实性核查不充分、对业务单据审核中未关注到运输合同与船舱计量报告对应的船运公司存在明显差异等被广东证监局出具警示函。

2024年04月30日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因未对发行人关联交易情况进行充分核查、发表的核查意见不准确被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2024年04月30日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因配合客户以定增套利为目的提供融券服务被中国证券监督管理委员会合计没收违法所得1,910,680.83元并处以23,250,000元罚款。

2024年04月12日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因相关主体违反限制性规定转让中核钛白2023年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规被中国证券监督管理委员会立案。

2024年01月05日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的可转债项目发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上被中国证券监督管理委员会采取出具警示函的行政监督管理措施。

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

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	262,026.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262,026.16

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
泓德智选启航混合A	1,775	65,103.13	12,855,233.04	11.12%	102,702,816.90	88.88%
泓德智选启航混合C	752	36,798.93	398,453.09	1.44%	27,274,341.31	98.56%
合计	2,503	57,223.67	13,253,686.13	9.25%	129,977,158.21	90.75%

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	泓德智选启航混合A	420,047.16	0.36%
	泓德智选启航混合C	6,167.82	0.02%
	合计	426,214.98	0.30%

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德智选启航混合A	泓德智选启航混合C
基金合同生效日(2024年03月19日)基金份额总额	128,991,605.26	91,469,558.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	180,960,744.27	32,498,744.88
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	194,394,299.59	96,295,508.95
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	115,558,049.94	27,672,794.40

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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40,000.00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无受稽查或处罚等情况。

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	
东莞	2	864,284,793.42	61.38%	208,533.20	44.38%	-

证券						
恒泰证券	2	543,847,197.21	38.62%	261,314.28	55.62%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择长江证券、恒泰证券、东莞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
东莞证券	67,904.87	66.79%	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	33,768.70	33.21%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	泓德智选启航混合型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-31
2	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启航混合型证券投资基金增加中信建投证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-01
3	泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
4	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
5	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启航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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-17
6	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启航混合型证券投资基金增加申万宏源证券有限公司等机构为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
7	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-07-18
8	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-10-11

9	泓德基金管理有限公司关于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	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-06
10	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、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-07
11	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、上海证券报、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航混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德智选启航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德智选启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。

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

泓德基金管理有限公司
二〇二五年三月二十八日