

中加科丰价值精选混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	75
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	75
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
7.12 投资组合报告附注	76
§8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
8.2 盈利投资者数量占比	77

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	77
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	77
§9 开放式基金份额变动	77
§10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议	78
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
10.4 基金投资策略的改变	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	78
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	79
10.8 其他重大事件	80
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加科丰价值精选混合型证券投资基金
基金简称	中加科丰价值精选混合
基金主代码	008356
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年05月08日
基金管理人	中加基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	446,278,467.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现资产的长期、稳健增值。
投资策略	本基金通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中债总全价（总值）指数收益率×60%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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		中加基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌	滕菲菲
	联系电话	400-00-95526	4006800000
	电子邮箱	service@bobbns.com	tengfeifei@citicbank.com

客户服务电话	400-00-95526	95558
传真	010-83197627	010-85230024
注册地址	北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	北京市西城区南纬路35号	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	100050	100020
法定代表人	杨琳	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金中期报告置备地点	北京市西城区南纬路35号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日- 2026年06月30日)
本期已实现收益	26,540,978.96
本期利润	24,890,542.65
加权平均基金份额本期利润	0.0611
本期加权平均净值利润率	5.00%
本期基金份额净值增长率	5.15%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)
期末可供分配利润	88,780,554.10
期末可供分配基金份额利润	0.1989
期末基金资产净值	555,650,914.43
期末基金份额净值	1.2451
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)
基金份额累计净值增长率	40.70%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

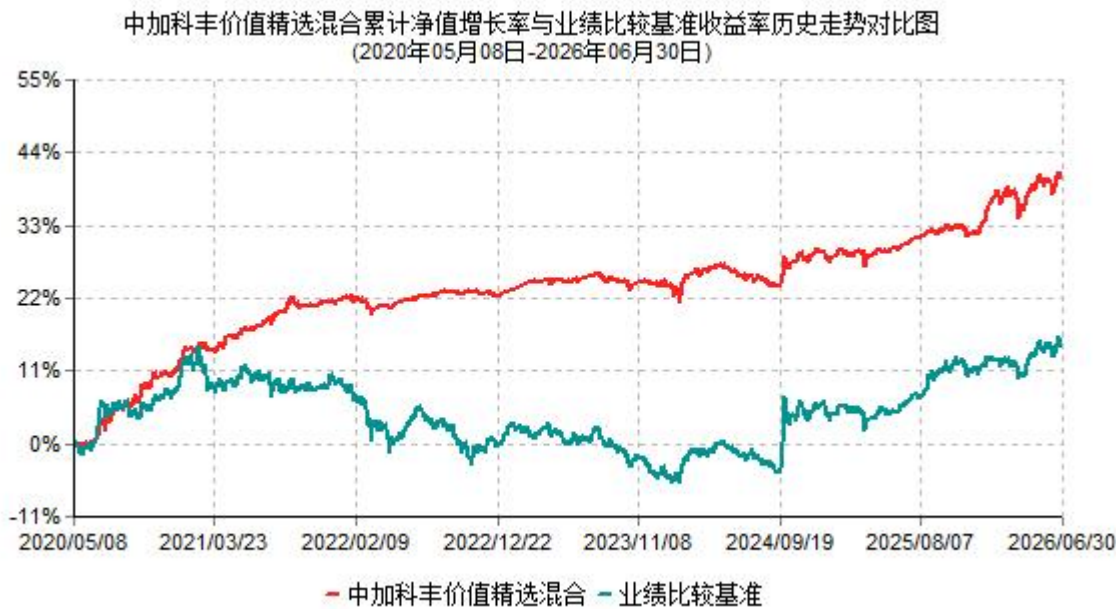
3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生额）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	3.72%	0.37%	5.03%	0.51%	-1.31%	-0.14%
过去六个月	5.15%	0.38%	3.52%	0.46%	1.63%	-0.08%
过去一年	8.18%	0.29%	9.50%	0.41%	-1.32%	-0.12%
过去三年	12.49%	0.25%	15.16%	0.43%	-2.67%	-0.18%
过去五年	19.39%	0.21%	4.53%	0.44%	14.86%	-0.23%
自基金合同 生效起至今	40.70%	0.22%	15.71%	0.45%	24.99%	-0.23%

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



§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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

截至报告期末，本基金管理人共管理83只基金，涵盖股票型基金、债券型基金、混合型基金、货币市场基金以及基金中基金等多种基金类型，为投资者提供丰富的选择。

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		
张楠	本基金基金经理	2026-01-05	-	12	张楠先生，山东大学工学学士，英国伯明翰大学理学硕

					士博士。2006年9月至2014年3月任西交利物浦大学计算机系助理教授。2014年4月至2016年3月任中信证券信息与量化服务（深圳）有限责任公司投资策略研发工程师。2016年4月加入中加基金管理有限公司，现任基金经理。
钟伟	本基金基金经理	2023-02-15	-	16	钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，现任基金经理。

注：1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《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》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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，基金管理人始终将合规经营与基金运作的规范性置于首位。针对监管部门就2023年现场检查发现问题出具的警示函，基金管理人对检查期间所涉责任人员进行追溯问责。基金管理人召开了年中工作会暨合规工作大会，对合规管理工作进行总结部署，持续强化全员合规意识。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司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超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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

固收部分：

2026年上半年，中国债券市场走出一轮震荡走强的超预期行情。10年期国债收益率从年初1.84%附近起步，1月7日上冲至1.90%的全年后逐步回落，5月末至6月初最低触及1.70%一线，6月末收于1.73%附近，上半年累计下行约11bp。分品种看，1年期国债收益率下行22bp至1.12%，30年期下行3bp至2.24%，曲线整体呈现牛陡形态。信用债收益率同步下行，AA级3年期中票下行28bp，信用利差全面压缩，中低等级、长久期压缩幅度更大。

本轮行情的核心驱动力可归结为三个层面。其一，基本面结构性偏弱。上半年GDP同比增长4.7%，但二季度放缓至4.3%，制造业投资、消费和地产链条持续承压，建筑业增加值同比下降4.0%，经济K型分化特征显著。其二，资金面超预期宽松。央行虽未调

降7天逆回购利率（维持1.40%），但银行间实际资金价格持续低于政策利率运行，4至5月DR007月均值分别降至1.35%、1.34%，为债市多头提供了极佳的交易环境。其三，信贷需求疲弱叠加政府债发行节奏偏慢，实体融资缺口转化为债市配置增量，资产荒逻辑贯穿上半年。上半年社融增量20.84万亿元，同比少增2.02万亿元，人民币贷款增速降至5.2%，而企业债券净融资2.07万亿元，同比多增9167亿元，融资结构正在发生趋势性变迁。

节奏上，上半年利率债行情可划分为五个阶段：1月初风险偏好抬升叠加供给担忧，长端急跌；春节前配置盘逢高进场，收益率修复至1.78%附近；两会后经济开门红成色显现叠加美伊冲突引发通胀担忧，收益率再度反弹；4至5月资金面进入超宽松状态，信贷需求走弱与政府债供给放缓共振，收益率二度下行至年内低点；6月央行出手纠偏过低资金价格，买断式逆回购持续缩量，叠加理财预防性赎回扰动，收益率小幅回弹至1.73%一线。陆家嘴论坛宣布创设隔夜逆回购品种、收窄利率走廊宽度，标志着央行货币政策框架从数量型向价格型转型迈出实质性步伐。

上半年债市整体走强，10年期国债收益率累计下行约11bp至1.73%，信用利差全面压缩至历史低位。组合操作上，信用债维持中短久期中高等级配置，以票息收益为底仓核心；利率债方面，二季度资金面超预期宽松阶段适度拉长久期，10年及30年期品种积极参与波段交易增厚收益。6月资金面边际收敛后及时降低久期，控制组合波动。信用结构上坚持分层择券，重点配置强区域城投和央国企产业债，严控弱资质尾部风险。上半年组合净值平稳增长，回撤控制良好。

权益部分：

今年上半年，A股市场呈现大盘震荡上行、成长赛道结构性牛市、市场极致分化的特征。年初在全球降息预期与流动性宽松的背景下，A股市场延续了去年底的上涨行情，商业航天和AI应用等题材活跃，引领“春季躁动”行情。2月底，美伊冲突爆发，中东地缘政治风险冲击，油价上涨引发全球通胀担忧，市场避险情绪浓厚，资金涌向能源与红利板块。A股受此外部利空影响，市场震荡下行。4月份中东地缘冲突局势缓和后市场回暖，CPO和存储率先启动，沪指探底回升。5月份海外存储龙头业绩超预期催化，半导体设备、光通信连续放量，AI科技产业链业绩兑现带动成长板块持续走强。6月份科技主线全面爆发，创业板、科创50指数创下阶段新高乃至历史新高，月末科技板块高潮后出现获利回吐。

本报告期，沪深300指数上涨7.55%，中证500指数上涨20.97%，中证1000上涨15.99%。从市场风格来看，中小盘成长风格相对占优，大盘价值风格承压。

本基金采用量化多因子选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股非常分散。报告期内基金的股票仓位略有降低，力求在较小的回撤幅度下获得稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加科丰价值精选混合基金份额净值为1.2451元，本报告期内，基金份额净值增长率为5.15%，同期业绩比较基准收益率为3.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固收部分：

展望下半年，10年期国债收益率或在1.70%至1.80%区间运行。基本面方面，内需修复偏缓的格局短期难以逆转，通胀温和可控，为货币政策维持宽松基调提供空间，下半年降息降准仍有落地窗口。但需要注意的不确定性在于：一是三季度政府债集中供给可能阶段性分流配置资金；二是资金面已从上半年超宽松向中性略偏松收敛，利率低位下安全边际变薄，交易难度上升；三是机构配置拥挤度较高，利空因素容易被放大。操作层面，组合维持中性久期，以票息收益为组合核心底仓，超长端逢调整布局，密切跟踪未来可能出现的正常调整和三季度财政发力节奏。

权益部分：

在经历了上半年的科技板块的极致抱团后，下半年A股面临“外紧内松”的宏观环境，企业盈利修复与AI产业大趋势仍然会是支撑上涨上行的核心支柱。市场风格料由极致的分化走向以科技为主的更为均衡的风格。市场投资者也会更青睐能在科技浪潮中有业绩支撑的公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组，由分管基金运营的公司领导任估值小组负责人，成员由分管风险合规的公司领导、固定收益部、权益投资部、基金运营部（营销服务部）、风险管理部、法律合规与内控部、集中交易部等部门负责人及业务骨干组成，若估值小组认为必要，可适当增减小组成员，业务骨干由估值小组认定和调整。基金经理可依据专业判断就估值政策标准等议题参与讨论并提出意见建议，但不能参与最终估值决策。估值小组主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响，以及对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中加科丰价值精选混合型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，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

本托管人认为，中加基金管理有限公司在中加科丰价值精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中加基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	11,973,640.18	2,518,777.97
结算备付金		1,172,830.24	192,541.18
存出保证金		72,074.90	6,399.52
交易性金融资产	6.4.7.2	521,871,889.23	466,941,008.57
其中：股票投资		124,792,548.95	131,237,522.13
基金投资		-	-
债券投资		397,079,340.28	335,703,486.44
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	21,000,949.32	-1,965.22
应收清算款		203,014.06	8,453,642.25
应收股利		-	-
应收申购款		41,835.16	129.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		556,336,233.09	478,110,534.14
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	582,221.93
应付赎回款		232.10	1,017.96

应付管理人报酬		270,711.31	241,022.56
应付托管费		45,118.53	40,170.44
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,075.34	8,152.75
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	364,181.38	67,271.14
负债合计		685,318.66	939,856.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	446,278,467.13	402,985,943.86
未分配利润	6.4.7.8	109,372,447.30	74,184,733.50
净资产合计		555,650,914.43	477,170,677.36
负债和净资产总计		556,336,233.09	478,110,534.14

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值为1.2451元，基金份额总额446,278,467.13份。

6.2 利润表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		26,720,905.21	466,588.01
1.利息收入		74,247.52	26,382.60
其中：存款利息收入	6.4.7.9	50,777.08	26,382.60
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		23,470.44	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		28,269,202.60	473,175.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	23,137,555.06	87,606.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,224,387.49	327,909.86
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	907,260.05	57,658.61
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,650,436.31	-37,068.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	27,891.40	4,099.14
减：二、营业总支出		1,830,362.56	331,422.13
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,478,687.47	174,803.09
2.托管费	6.4.10.2.2	246,447.89	29,133.90
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	30,643.43
其中：卖出回购金融资产 支出		-	30,643.43
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		2,236.00	1,432.12
8.其他费用	6.4.7.19	102,991.20	95,409.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,890,542.65	135,165.88

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,890,542.65	135,165.88
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		24,890,542.65	135,165.88

6.3 净资产变动表

会计主体：中加科丰价值精选混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	402,985,943.86	74,184,733.50	477,170,677.36
二、本期期初净资产	402,985,943.86	74,184,733.50	477,170,677.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	43,292,523.27	35,187,713.80	78,480,237.07
（一）、综合收益总额	-	24,890,542.65	24,890,542.65
（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）	43,292,523.27	10,297,171.15	53,589,694.42
其中：1.基金申购款	58,239,529.24	13,654,899.59	71,894,428.83
2.基金赎回款	-14,947,005.97	-3,357,728.44	-18,304,734.41
（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	446,278,467.13	109,372,447.30	555,650,914.43
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	132,123,187.36	18,626,340.18	150,749,527.54
二、本期期初净资产	132,123,187.36	18,626,340.18	150,749,527.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-121,892,948.05	-17,081,367.75	-138,974,315.80
（一）、综合收益总额	-	135,165.88	135,165.88
（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）	-121,892,948.05	-17,216,533.63	-139,109,481.68
其中：1.基金申购款	3,064,170.33	455,561.46	3,519,731.79
2.基金赎回款	-124,957,118.38	-17,672,095.09	-142,629,213.47
（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	10,230,239.31	1,544,972.43	11,775,211.74

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

杨琳

于春玲

于春玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中加科丰价值精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)2019年11月7日证监许可[2019]2221号文准予募集注册,由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式混合型基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

本基金通过中加基金直销中心公开发售,募集期为2020年4月28日起至2020年4月30日。本基金于2020年5月8日成立,成立之日基金实收份额为350,071,562.96份(含利息转份额31,204.87份),发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中加科丰价值精选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具(含同业存单)、债券回购、银行存款、资产支持证券、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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况、2026年度中期的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2026年1月1日至2026年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量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。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2)金融工具的后续计量

初始确认后，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以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(4)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

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。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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份额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。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动(包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额)形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；每一基金份额享有同等分配权；基金可供分配利润为正的情况下，方可进行收益分配；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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《中国证券监督管理委员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、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对证券投资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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公司（“挂牌公司”）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。

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。

(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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	11,973,640.18
等于：本金	11,971,747.86
加：应计利息	1,892.32
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	11,973,640.18

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		124,679,938.06	-	124,792,548.95	112,610.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,100.00	0.90	18,142.42	5,041.52
	银行间市场	391,092,645.60	4,822,697.86	397,061,197.86	1,145,854.40
	合计	391,105,745.60	4,822,698.76	397,079,340.28	1,150,895.92
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		515,785,683.66	4,822,698.76	521,871,889.23	1,263,506.81

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	21,000,949.32	-
合计	21,000,949.32	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	274,846.34
其中：交易所市场	269,372.12
银行间市场	5,474.22
应付利息	-
预提费用-审计费	20,827.67
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,000.00
合计	364,181.38

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	402,985,943.86	402,985,943.86
本期申购	58,239,529.24	58,239,529.24
本期赎回（以“-”号填列）	-14,947,005.97	-14,947,005.97
本期末	446,278,467.13	446,278,467.13

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,781,016.14	20,403,717.36	74,184,733.50
本期期初	53,781,016.14	20,403,717.36	74,184,733.50
本期利润	26,540,978.96	-1,650,436.31	24,890,542.65
本期基金份额交易产生的变动数	8,458,559.00	1,838,612.15	10,297,171.15
其中：基金申购款	11,142,063.75	2,512,835.84	13,654,899.59
基金赎回款	-2,683,504.75	-674,223.69	-3,357,728.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,780,554.10	20,591,893.20	109,372,447.30

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	48,399.53
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,122.93
其他	254.62
合计	50,777.08

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	937,286,181.58
减：卖出股票成本总额	913,292,256.51
减：交易费用	856,370.01
买卖股票差价收入	23,137,555.06

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	4,020,420.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	203,966.85
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	4,224,387.49

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	330,767,794.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	327,818,083.62
减：应计利息总额	2,737,731.86
减：交易费用	8,012.52
买卖债券差价收入	203,966.85

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	907,260.05
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	907,260.05

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-1,650,436.31
——股票投资	-2,690,302.97
——债券投资	1,039,866.66
——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	-1,650,436.31

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	27,891.40
合计	27,891.40

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	20,827.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,258.36
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
其他费用	397.80
合计	102,991.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,478,687.47	174,803.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	442,616.90	13,335.18
应支付基金管理人的净管理费	1,036,070.57	161,467.91

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	246,447.89	29,133.90

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金在本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	2,595,040.10	-
报告期间申购/买入总份额	-	2,595,040.10
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,595,040.10	2,595,040.10
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.58%	25.37%

6.4.10.5.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	11,973,640.18	48,399.53	9,192,786.05	26,132.24

注：本基金的活期存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股锁定	10.11	10.11	15,621	157,928.31	157,928.31	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	707	13,913.76	100,033.43	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	6,694	67,676.34	67,676.34	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	科创板打新限售	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	科创板打新限售	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
301531	春光集团	2026-04-2	6个月	创业板打	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-

		8		新限售						
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股锁定	53.26	58.74	207	11,024.82	12,159.18	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	创业板打新限售	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127114	宣化转债	2026-06-26	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	33	3,300.00	3,300.07	-
118070	南芯转债	2026-06-18	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.01	10	1,000.00	1,000.06	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2026年06月30日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2026年06月30日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、法律合规与内控部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要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，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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。

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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；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，违约风险可能性很小。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	40,434,547.94	190,907,939.73
合计	40,434,547.94	190,907,939.73

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2.未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。
3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	280,756,065.74	-
AAA以下	25,176,617.77	19,918,756.16
未评级	50,712,108.83	124,876,790.55
合计	356,644,792.34	144,795,546.71

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融

资工具。

3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（如有）计息但该利息金额不重大以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。

报告期内，本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,973,640.18	-	-	-	11,973,640.18
结算备付金	1,172,825.06	-	-	5.18	1,172,830.24
存出保证金	72,074.90	-	-	-	72,074.90
交易性金融资产	81,240,961.59	285,369,732.87	30,468,645.82	124,792,548.95	521,871,889.23
买入返售金融资产	21,000,949.32	-	-	-	21,000,949.32
应收清算款	-	-	-	203,014.06	203,014.06
应收申购款	-	-	-	41,835.16	41,835.16
资产总计	115,460,451.05	285,369,732.87	30,468,645.82	125,037,403.35	556,336,233.09
负债					
应付赎回款	-	-	-	232.10	232.10
应付管	-	-	-	270,711.31	270,711.31

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	45,118.53	45,118.53
应交税费	-	-	-	5,075.34	5,075.34
其他负债	-	-	-	364,181.38	364,181.38
负债总计	-	-	-	685,318.66	685,318.66
利率敏感度缺口	115,460,451.05	285,369,732.87	30,468,645.82	124,352,084.69	555,650,914.43
上年度末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,518,777.97	-	-	-	2,518,777.97
结算备付金	192,536.02	-	-	5.16	192,541.18
存出保证金	6,399.52	-	-	-	6,399.52
交易性金融资产	214,966,894.66	120,736,591.78	-	131,237,522.13	466,941,008.57
买入返售金融资产	-1,965.22	-	-	-	-1,965.22
应收清算款	-	-	-	8,453,642.25	8,453,642.25
应收申购款	-	-	-	129.87	129.87
资产总计	217,682,642.95	120,736,591.78	-	139,691,299.41	478,110,534.14

负债					
应付清算款	-	-	-	582,221.93	582,221.93
应付赎回款	-	-	-	1,017.96	1,017.96
应付管理人报酬	-	-	-	241,022.56	241,022.56
应付托管费	-	-	-	40,170.44	40,170.44
应交税费	-	-	-	8,152.75	8,152.75
其他负债	-	-	-	67,271.14	67,271.14
负债总计	-	-	-	939,856.78	939,856.78
利率敏感度缺口	217,682,642.95	120,736,591.78	-	138,751,442.63	477,170,677.36

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率下降25个基点	2,748,308.20	911,849.97
	市场利率上升25个基点	-2,748,308.20	-911,849.97

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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	124,792,548.95	22.46	131,237,522.13	27.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	397,079,340.28	71.46	335,703,486.44	70.35
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	521,871,889.23	93.92	466,941,008.57	97.85

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
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	上年度末
		2026年06月30日	2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	10,093,508.32	7,925,023.99
	业绩比较基准下降5%	-10,093,508.32	-7,925,023.99

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	124,333,252.91	130,299,683.13
第二层次	397,291,102.64	336,641,325.44
第三层次	247,533.68	-
合计	521,871,889.23	466,941,008.57

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度期末：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2026年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	124,792,548.95	22.43
	其中：股票	124,792,548.95	22.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	397,079,340.28	71.37
	其中：债券	397,079,340.28	71.37
	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	21,000,949.32	3.77
	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	13,146,470.42	2.36
8	其他各项资产	316,924.12	0.06
9	合计	556,336,233.09	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	769,731.30	0.14
B	采矿业	2,803,420.60	0.50
C	制造业	85,837,943.22	15.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,932,471.65	0.53
E	建筑业	1,564,369.00	0.28
F	批发和零售业	4,317,640.50	0.78
G	交通运输、仓储和邮政业	1,406,190.68	0.25
H	住宿和餐饮业	30,877.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,092,922.60	2.00
J	金融业	9,079,383.60	1.63
K	房地产业	931,579.00	0.17
L	租赁和商务服务业	1,672,650.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	1,152,249.00	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	952,377.80	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,739.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	108,880.00	0.02
S	综合	111,124.00	0.02
	合计	124,792,548.95	22.46

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600320	振华重工	625,000	2,581,250.00	0.46

2	300857	协创数据	7,200	2,447,280.00	0.44
3	002922	伊戈尔	68,000	2,230,400.00	0.40
4	002396	星网锐捷	103,770	1,989,270.90	0.36
5	001309	德明利	2,100	1,980,090.00	0.36
6	002948	青岛银行	358,300	1,820,164.00	0.33
7	688469	芯联集成-U	161,000	1,708,210.00	0.31
8	002807	江阴银行	440,370	1,633,772.70	0.29
9	600150	中国船舶	48,100	1,625,299.00	0.29
10	600037	歌华有线	255,600	1,602,612.00	0.29
11	300613	富瀚微	19,400	1,553,552.00	0.28
12	300323	华灿光电	74,000	1,509,600.00	0.27
13	002947	恒铭达	19,700	1,498,185.00	0.27
14	301308	江波龙	2,000	1,407,600.00	0.25
15	601677	明泰铝业	82,200	1,364,520.00	0.25
16	300308	中际旭创	1,000	1,270,000.00	0.23
17	600577	精达股份	127,400	1,245,972.00	0.22
18	601899	紫金矿业	48,800	1,226,832.00	0.22
19	600739	辽宁成大	117,500	1,187,925.00	0.21
20	601360	三六零	136,000	1,181,840.00	0.21
21	300034	钢研高纳	67,600	1,158,664.00	0.21
22	600183	生益科技	6,600	1,144,440.00	0.21
23	688158	优刻得-W	29,800	1,095,448.00	0.20
24	603876	鼎胜新材	41,700	1,084,617.00	0.20
25	002250	联化科技	77,400	1,058,058.00	0.19
26	601038	一拖股份	93,300	988,047.00	0.18
27	301489	思泉新材	6,000	987,480.00	0.18
28	300073	当升科技	18,700	898,348.00	0.16
29	688372	伟测科技	4,600	855,600.00	0.15
30	600116	三峡水利	145,000	812,000.00	0.15
31	688213	思特威-W	7,400	792,318.00	0.14
32	603588	高能环境	41,000	787,200.00	0.14

33	002839	张家港行	200,000	780,000.00	0.14
34	688766	普冉股份	1,000	766,600.00	0.14
35	601108	财通证券	87,700	758,605.00	0.14
36	000636	风华高科	10,400	751,296.00	0.14
37	603986	兆易创新	900	733,500.00	0.13
38	300098	高新兴	152,700	700,893.00	0.13
39	300184	力源信息	38,800	680,940.00	0.12
40	002405	四维图新	103,800	671,586.00	0.12
41	601126	四方股份	10,600	669,920.00	0.12
42	002458	益生股份	84,570	657,108.90	0.12
43	603680	今创集团	64,700	634,707.00	0.11
44	601766	中国中车	121,900	633,880.00	0.11
45	600335	国机汽车	129,600	606,528.00	0.11
46	002414	高德红外	45,400	602,004.00	0.11
47	688728	格科微	28,400	597,536.00	0.11
48	300358	楚天科技	74,200	593,600.00	0.11
49	300672	国科微	2,000	590,000.00	0.11
50	603124	江南新材	3,100	579,638.00	0.10
51	600482	中国动力	17,600	577,280.00	0.10
52	002185	华天科技	25,331	565,134.61	0.10
53	000553	安道麦A	105,200	562,820.00	0.10
54	300458	全志科技	13,820	545,337.20	0.10
55	000166	申万宏源	123,800	544,720.00	0.10
56	002768	国恩股份	10,404	541,632.24	0.10
57	002063	远光软件	105,800	539,580.00	0.10
58	002049	紫光国微	5,900	523,625.00	0.09
59	301217	铜冠铜箔	3,100	511,717.00	0.09
60	688111	金山办公	2,400	511,320.00	0.09
61	600884	杉杉股份	37,700	510,835.00	0.09
62	603323	苏农银行	127,450	493,231.50	0.09
63	002838	道恩股份	16,100	492,982.00	0.09

64	300590	移为通信	33,900	486,465.00	0.09
65	002966	苏州银行	67,400	469,104.00	0.08
66	301031	中熔电气	3,900	465,855.00	0.08
67	601995	中金公司	12,800	462,720.00	0.08
68	688275	万润新能	3,600	459,180.00	0.08
69	002493	荣盛石化	42,300	454,725.00	0.08
70	300394	天孚通信	1,500	454,020.00	0.08
71	688220	翱捷科技-U	3,600	447,552.00	0.08
72	000792	盐湖股份	14,700	443,793.00	0.08
73	600395	盘江股份	96,600	440,496.00	0.08
74	001914	招商积余	53,900	439,824.00	0.08
75	002747	埃斯顿	11,700	436,761.00	0.08
76	688390	固德威	4,000	434,040.00	0.08
77	600305	恒顺醋业	68,200	430,342.00	0.08
78	605056	咸亨国际	26,500	424,000.00	0.08
79	002061	浙江交科	127,100	419,430.00	0.08
80	002169	智光电气	28,400	415,776.00	0.07
81	000950	重药控股	82,200	411,822.00	0.07
82	688388	嘉元科技	9,346	411,224.00	0.07
83	600808	马钢股份	161,800	404,500.00	0.07
84	688503	聚和材料	3,000	398,100.00	0.07
85	000682	东方电子	31,400	396,582.00	0.07
86	002738	中矿资源	6,600	389,334.00	0.07
87	688002	睿创微纳	2,500	386,725.00	0.07
88	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.07
89	300953	震裕科技	2,820	377,034.00	0.07
90	601138	工业富联	5,200	375,180.00	0.07
91	600572	康恩贝	95,700	375,144.00	0.07
92	688567	孚能科技	34,800	365,400.00	0.07
93	002497	雅化集团	17,900	364,623.00	0.07
94	000600	建投能源	41,400	362,250.00	0.07

95	301536	星宸科技	2,800	360,388.00	0.06
96	002271	东方雨虹	30,200	358,474.00	0.06
97	300171	东富龙	32,400	358,344.00	0.06
98	603112	华翔股份	21,300	356,349.00	0.06
99	603305	旭升集团	29,100	352,692.00	0.06
100	603118	共进股份	28,600	346,346.00	0.06
101	000933	神火股份	16,200	343,440.00	0.06
102	600372	中航机载	31,600	342,860.00	0.06
103	002245	蔚蓝锂芯	18,268	341,794.28	0.06
104	000938	紫光股份	11,800	340,548.00	0.06
105	000729	燕京啤酒	32,800	332,264.00	0.06
106	688717	艾罗能源	4,000	330,280.00	0.06
107	002010	传化智联	73,600	328,992.00	0.06
108	601059	信达证券	20,200	327,038.00	0.06
109	600875	东方电气	11,300	325,101.00	0.06
110	300298	三诺生物	23,300	325,035.00	0.06
111	603225	新凤鸣	16,300	320,295.00	0.06
112	000539	粤电力A	46,900	319,389.00	0.06
113	000338	潍柴动力	11,500	313,375.00	0.06
114	000703	恒逸石化	23,000	312,110.00	0.06
115	601231	环旭电子	9,600	311,040.00	0.06
116	600072	中船科技	36,400	309,036.00	0.06
117	000951	中国重汽	15,800	308,258.00	0.06
118	601333	广深铁路	108,900	299,475.00	0.05
119	300201	海伦哲	14,100	297,087.00	0.05
120	688525	佰维存储	600	296,838.00	0.05
121	600487	亨通光电	2,700	295,218.00	0.05
122	600929	雪天盐业	64,600	293,284.00	0.05
123	000810	创维数字	21,800	288,850.00	0.05
124	601139	深圳燃气	50,900	288,094.00	0.05
125	300693	盛弘股份	5,900	287,625.00	0.05

126	688331	荣昌生物	2,200	286,572.00	0.05
127	002115	三维通信	27,600	284,280.00	0.05
128	300432	富临精工	14,100	283,269.00	0.05
129	688266	泽璟制药-U	2,400	279,984.00	0.05
130	600961	株冶集团	8,600	278,554.00	0.05
131	600989	宝丰能源	13,700	278,521.00	0.05
132	600489	中金黄金	15,400	277,970.00	0.05
133	600801	华新建材	17,300	269,880.00	0.05
134	600535	天士力	20,300	268,569.00	0.05
135	002284	亚太股份	28,300	268,567.00	0.05
136	601901	方正证券	36,500	262,800.00	0.05
137	603950	长源东谷	3,100	261,733.00	0.05
138	002602	世纪华通	18,300	258,030.00	0.05
139	600502	安徽建工	59,100	257,085.00	0.05
140	301268	铭利达	18,300	255,834.00	0.05
141	603638	艾迪精密	10,900	255,605.00	0.05
142	600623	华谊集团	31,100	250,977.00	0.05
143	301246	宏源药业	9,300	250,170.00	0.05
144	600741	华域汽车	16,000	248,320.00	0.04
145	600331	宏达股份	22,300	245,077.00	0.04
146	301369	联动科技	1,000	245,000.00	0.04
147	688110	东芯股份	1,200	244,440.00	0.04
148	600662	外服控股	60,600	244,218.00	0.04
149	000415	渤海租赁	59,500	242,165.00	0.04
150	000983	山西焦煤	41,600	241,280.00	0.04
151	688097	博众精工	3,800	239,590.00	0.04
152	000657	中钨高新	2,500	239,300.00	0.04
153	300428	立中集团	13,100	238,158.00	0.04
154	600155	华创云信	43,000	237,360.00	0.04
155	002415	海康威视	6,711	229,516.20	0.04
156	600654	中安科	84,900	225,834.00	0.04

157	001248	华润新能源	22,315	225,604.65	0.04
158	600233	圆通速递	14,100	222,075.00	0.04
159	301606	绿联科技	3,600	219,672.00	0.04
160	688531	日联科技	1,200	213,408.00	0.04
161	601880	辽港股份	153,900	212,382.00	0.04
162	603108	润达医疗	23,400	208,260.00	0.04
163	002641	公元股份	53,900	208,054.00	0.04
164	688221	前沿生物-U	9,200	206,080.00	0.04
165	002048	宁波华翔	8,800	202,400.00	0.04
166	603061	金海通	400	200,888.00	0.04
167	600452	涪陵电力	21,400	199,662.00	0.04
168	300223	北京君正	800	199,120.00	0.04
169	000672	上峰材料	8,400	198,912.00	0.04
170	002558	巨人网络	7,200	198,432.00	0.04
171	600216	浙江医药	17,400	198,360.00	0.04
172	002120	韵达股份	30,900	196,524.00	0.04
173	600369	西南证券	48,700	195,774.00	0.04
174	601699	潞安环能	13,700	195,636.00	0.04
175	688127	蓝特光学	2,000	195,200.00	0.04
176	600869	远东股份	5,800	194,126.00	0.03
177	688173	希荻微	10,000	191,400.00	0.03
178	601600	中国铝业	23,200	190,704.00	0.03
179	000967	盈峰环境	18,000	189,540.00	0.03
180	600426	华鲁恒升	7,900	188,968.00	0.03
181	600663	陆家嘴	30,000	188,400.00	0.03
182	002060	广东建工	61,500	186,345.00	0.03
183	002222	福晶科技	2,000	184,560.00	0.03
184	600927	永安期货	14,800	184,260.00	0.03
185	603025	大豪科技	13,400	182,776.00	0.03
186	600361	创新新材	49,700	178,920.00	0.03
187	601068	中铝国际	41,400	178,848.00	0.03

188	600872	中炬高新	10,200	177,072.00	0.03
189	605123	派克新材	1,800	174,618.00	0.03
190	600098	广州发展	29,100	171,981.00	0.03
191	002648	卫星化学	7,300	171,477.00	0.03
192	002202	金风科技	7,100	169,690.00	0.03
193	002004	华邦健康	41,200	161,916.00	0.03
194	002979	雷赛智能	2,900	161,762.00	0.03
195	300773	拉卡拉	10,540	161,262.00	0.03
196	601777	千里科技	19,700	160,752.00	0.03
197	002531	天顺风能	18,600	156,798.00	0.03
198	002487	大金重工	2,700	156,519.00	0.03
199	000708	中信特钢	12,400	156,488.00	0.03
200	300012	华测检测	11,200	155,232.00	0.03
201	600498	烽火通信	2,100	154,560.00	0.03
202	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.03
203	603009	北特科技	3,200	153,504.00	0.03
204	603083	剑桥科技	600	152,922.00	0.03
205	600210	紫江企业	24,600	152,520.00	0.03
206	600686	金龙汽车	13,500	152,415.00	0.03
207	600499	科达制造	11,000	151,800.00	0.03
208	603893	瑞芯微	800	150,688.00	0.03
209	603063	禾望电气	2,800	148,092.00	0.03
210	603858	步长制药	10,100	147,460.00	0.03
211	603699	纽威股份	2,900	145,870.00	0.03
212	300058	蓝色光标	10,600	145,856.00	0.03
213	002821	凯莱英	900	145,800.00	0.03
214	600268	国电南自	12,400	144,088.00	0.03
215	002859	洁美科技	1,300	142,363.00	0.03
216	600601	方正科技	10,200	141,168.00	0.03
217	300677	英科医疗	3,600	141,012.00	0.03
218	601128	常熟银行	24,120	140,378.40	0.03

219	002563	森马服饰	27,200	137,088.00	0.02
220	300132	青松股份	23,500	133,480.00	0.02
221	600570	恒生电子	6,200	131,378.00	0.02
222	002384	东山精密	500	131,175.00	0.02
223	688368	晶丰明源	600	129,912.00	0.02
224	600827	百联股份	17,500	129,675.00	0.02
225	000623	吉林敖东	7,300	129,429.00	0.02
226	301358	湖南裕能	1,700	128,979.00	0.02
227	601179	中国西电	8,400	125,328.00	0.02
228	003022	联泓新科	4,700	121,730.00	0.02
229	002511	中顺洁柔	18,300	121,695.00	0.02
230	688321	微芯生物	4,600	121,118.00	0.02
231	688208	道通科技	4,800	120,912.00	0.02
232	600941	中国移动	1,400	120,582.00	0.02
233	002636	金安国纪	1,000	119,970.00	0.02
234	000680	山推股份	11,900	119,595.00	0.02
235	688400	凌云光	1,800	119,160.00	0.02
236	002668	TCL智家	10,600	117,448.00	0.02
237	301526	国际复材	2,500	116,675.00	0.02
238	002488	金固股份	12,800	114,048.00	0.02
239	002812	恩捷股份	1,700	113,747.00	0.02
240	002475	立讯精密	1,600	112,640.00	0.02
241	688612	威迈斯	3,800	112,442.00	0.02
242	300970	华绿生物	6,080	111,142.40	0.02
243	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.02
244	605376	博迁新材	400	108,520.00	0.02
245	601339	百隆东方	15,800	106,966.00	0.02
246	300769	德方纳米	1,600	106,400.00	0.02
247	000050	深天马A	10,700	106,037.00	0.02
248	603663	三祥新材	1,100	105,930.00	0.02
249	002484	江海股份	1,000	105,000.00	0.02

250	600673	东阳光	3,100	104,098.00	0.02
251	002378	章源钨业	3,100	103,788.00	0.02
252	603279	景津装备	8,600	103,200.00	0.02
253	688167	炬光科技	290	102,720.90	0.02
254	603308	应流股份	1,700	102,680.00	0.02
255	603239	浙江仙通	6,900	102,189.00	0.02
256	688257	新锐股份	1,000	101,900.00	0.02
257	688235	百济神州	400	101,844.00	0.02
258	600018	上港集团	21,400	101,008.00	0.02
259	601607	上海医药	6,500	100,100.00	0.02
260	688820	盛合晶微	707	100,033.43	0.02
261	000935	四川双马	3,800	99,142.00	0.02
262	600230	沧州大化	7,600	98,952.00	0.02
263	002011	盾安环境	9,300	98,673.00	0.02
264	600710	苏美达	10,300	98,468.00	0.02
265	603969	银龙股份	13,500	98,145.00	0.02
266	688166	博瑞医药	2,800	98,028.00	0.02
267	600887	伊利股份	4,000	95,840.00	0.02
268	600129	太极集团	7,000	94,990.00	0.02
269	600251	冠农股份	10,900	94,176.00	0.02
270	600100	同方股份	13,700	93,845.00	0.02
271	688548	广钢气体	1,800	93,780.00	0.02
272	001322	箭牌家居	15,500	93,620.00	0.02
273	600185	珠免集团	20,800	93,600.00	0.02
274	601233	桐昆股份	4,300	93,095.00	0.02
275	002297	博云新材	3,200	92,768.00	0.02
276	600019	宝钢股份	16,900	91,767.00	0.02
277	600641	先导基电	2,300	91,678.00	0.02
278	600633	浙数文化	8,800	89,584.00	0.02
279	600388	龙净环保	6,000	87,300.00	0.02
280	300623	捷捷微电	1,900	85,481.00	0.02

281	600196	复星医药	3,800	85,386.00	0.02
282	600675	中华企业	41,300	85,078.00	0.02
283	600026	中远海能	4,700	84,318.00	0.02
284	000778	新兴铸管	22,500	83,475.00	0.02
285	688375	国博电子	800	83,440.00	0.02
286	600143	金发科技	5,400	83,430.00	0.02
287	002429	兆驰股份	8,000	83,120.00	0.01
288	601061	中信金属	7,700	82,929.00	0.01
289	688045	必易微	1,000	80,780.00	0.01
290	301662	宏工科技	795	80,549.40	0.01
291	603989	艾华集团	1,500	78,750.00	0.01
292	600787	中储股份	18,700	78,166.00	0.01
293	603317	天味食品	6,000	78,060.00	0.01
294	002745	木林森	6,200	77,810.00	0.01
295	000059	华锦股份	20,700	77,625.00	0.01
296	601665	齐鲁银行	13,400	77,318.00	0.01
297	600166	福田汽车	26,500	77,115.00	0.01
298	600332	白云山	3,800	76,152.00	0.01
299	605300	佳禾食品	7,800	76,050.00	0.01
300	688519	南亚新材	200	76,008.00	0.01
301	600109	国金证券	8,600	75,508.00	0.01
302	603966	法兰泰克	9,250	75,387.50	0.01
303	601969	海南矿业	9,500	75,145.00	0.01
304	688049	炬芯科技	1,600	75,056.00	0.01
305	002545	东方铁塔	4,600	74,612.00	0.01
306	002043	兔宝宝	6,700	74,236.00	0.01
307	600645	中源协和	4,300	73,573.00	0.01
308	600707	彩虹股份	4,300	72,627.00	0.01
309	002428	云南锗业	600	72,108.00	0.01
310	600509	天富能源	8,400	70,980.00	0.01
311	603991	领先股份	500	70,575.00	0.01

312	000776	广发证券	3,000	70,200.00	0.01
313	301382	蜂助手	1,500	69,000.00	0.01
314	300604	长川科技	200	68,284.00	0.01
315	600397	江钨装备	2,500	68,075.00	0.01
316	002110	三钢闽光	23,600	67,968.00	0.01
317	000156	华数传媒	10,700	67,517.00	0.01
318	002967	广电计量	3,700	66,785.00	0.01
319	603993	洛阳钼业	3,800	66,690.00	0.01
320	002064	华峰化学	7,000	66,430.00	0.01
321	600995	南网储能	5,400	66,420.00	0.01
322	600282	南钢股份	14,400	66,096.00	0.01
323	300257	开山股份	2,300	65,964.00	0.01
324	600141	兴发集团	1,400	65,758.00	0.01
325	002588	史丹利	8,100	63,990.00	0.01
326	600021	上海电力	4,200	63,294.00	0.01
327	600916	中国黄金	9,200	62,928.00	0.01
328	300489	光智科技	200	62,390.00	0.01
329	002340	格林美	9,400	62,134.00	0.01
330	603160	汇顶科技	1,000	61,710.00	0.01
331	000831	中国稀土	1,100	61,039.00	0.01
332	300142	沃森生物	4,600	59,754.00	0.01
333	002752	昇兴股份	10,800	59,616.00	0.01
333	000883	湖北能源	13,800	59,616.00	0.01
334	605111	新洁能	600	59,484.00	0.01
335	002382	蓝帆医疗	11,600	58,928.00	0.01
336	601200	上海环境	8,900	58,740.00	0.01
337	603336	宏辉果蔬	7,400	58,608.00	0.01
338	600966	博汇纸业	12,200	58,316.00	0.01
339	300003	乐普医疗	4,900	58,065.00	0.01
340	600963	岳阳林纸	19,000	57,760.00	0.01
341	000728	国元证券	7,600	56,924.00	0.01

342	600546	山煤国际	5,100	55,743.00	0.01
343	300134	大富科技	6,500	55,575.00	0.01
344	600717	天津港	14,200	55,238.00	0.01
345	600266	城建发展	14,100	55,131.00	0.01
346	300756	金马游乐	1,640	54,202.00	0.01
347	600637	东方明珠	6,500	54,015.00	0.01
348	001203	大中矿业	1,800	53,910.00	0.01
349	000725	京东方A	6,200	53,816.00	0.01
350	603196	璞源材料	2,200	53,768.00	0.01
351	300395	菲利华	400	53,492.00	0.01
352	000519	中兵红箭	2,500	52,675.00	0.01
353	600682	南京新百	10,200	52,530.00	0.01
354	000589	贵州轮胎	12,800	51,968.00	0.01
355	688001	华兴源创	600	51,420.00	0.01
356	002436	兴森科技	1,000	50,950.00	0.01
357	600259	中稀有有色	500	50,805.00	0.01
358	603486	科沃斯	1,000	50,750.00	0.01
359	601916	浙商银行	19,000	49,970.00	0.01
360	002252	上海莱士	11,500	49,910.00	0.01
361	688088	虹软科技	1,400	49,770.00	0.01
362	002432	九安医疗	700	49,476.00	0.01
363	000027	深圳能源	7,900	48,980.00	0.01
364	600170	上海建工	22,000	48,840.00	0.01
365	300206	理邦仪器	3,900	47,697.00	0.01
366	001389	广合科技	200	47,450.00	0.01
367	600298	安琪酵母	1,300	47,060.00	0.01
368	603615	茶花股份	2,900	46,835.00	0.01
369	603127	昭衍新药	1,200	45,864.00	0.01
370	002916	深南电路	100	45,790.00	0.01
371	600050	中国联通	11,400	45,600.00	0.01
372	000733	振华科技	800	45,312.00	0.01

373	002008	大族激光	300	45,033.00	0.01
374	600528	中铁工业	6,800	44,812.00	0.01
375	601096	宏盛华源	10,300	44,702.00	0.01
376	688779	五矿新能	5,500	44,605.00	0.01
377	600516	方大炭素	7,200	44,424.00	0.01
378	000035	中国天楹	9,100	43,953.00	0.01
379	001236	弘业期货	6,300	43,785.00	0.01
380	600352	浙江龙盛	3,600	43,596.00	0.01
381	300504	天邑股份	2,700	43,551.00	0.01
382	688778	厦钨新能	800	43,520.00	0.01
383	000400	许继电气	2,000	43,400.00	0.01
384	600496	精工钢构	13,800	42,780.00	0.01
385	300054	鼎龙股份	400	42,388.00	0.01
386	600999	招商证券	2,000	42,200.00	0.01
387	002465	海格通信	3,300	42,141.00	0.01
388	600575	淮河能源	13,200	42,108.00	0.01
389	002472	双环传动	1,000	41,510.00	0.01
390	688568	中科星图	1,000	41,470.00	0.01
391	688472	阿特斯	3,800	41,116.00	0.01
392	600667	太极实业	1,400	40,852.00	0.01
393	002837	英维克	510	40,575.60	0.01
394	600105	永鼎股份	600	40,488.00	0.01
395	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
396	600390	五矿资本	8,800	40,128.00	0.01
397	603345	安井食品	500	40,095.00	0.01
398	688059	华锐精密	200	39,942.00	0.01
399	000807	云铝股份	1,800	39,852.00	0.01
400	300369	绿盟科技	7,300	39,712.00	0.01
401	600153	建发股份	5,000	39,650.00	0.01
402	603939	益丰药房	2,200	39,556.00	0.01
403	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01

404	000811	冰轮环境	700	39,354.00	0.01
405	601117	中国化学	5,300	38,955.00	0.01
406	003816	中国广核	9,800	38,318.00	0.01
407	600918	中泰证券	7,200	38,304.00	0.01
408	300715	凯伦股份	2,300	37,858.00	0.01
409	603012	创力集团	4,600	37,720.00	0.01
410	688107	安路科技	800	36,480.00	0.01
411	600522	中天科技	600	36,408.00	0.01
412	688416	恒烁股份	260	36,400.00	0.01
413	000709	河钢股份	18,700	36,278.00	0.01
414	000962	东方钨业	400	36,240.00	0.01
415	000997	新大陆	2,200	35,860.00	0.01
416	301219	腾远钴业	650	35,620.00	0.01
417	300331	苏大维格	500	35,555.00	0.01
418	001286	陕西能源	3,500	35,490.00	0.01
419	002439	启明星辰	2,800	35,420.00	0.01
420	000977	浪潮信息	500	35,000.00	0.01
421	601949	中国出版	7,500	34,875.00	0.01
422	000738	航发控制	1,900	34,751.00	0.01
423	300738	奥飞数据	1,700	34,374.00	0.01
424	600312	平高电气	1,900	33,554.00	0.01
425	600316	洪都航空	1,200	33,528.00	0.01
426	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.01
427	300408	三环集团	200	33,380.00	0.01
428	002034	旺能环境	2,200	33,330.00	0.01
429	601375	中原证券	8,300	33,117.00	0.01
430	600685	中船防务	1,300	33,072.00	0.01
431	688218	江苏北人	600	32,976.00	0.01
432	002073	软控股份	6,400	32,896.00	0.01
433	603014	威高血净	1,000	32,730.00	0.01
434	002460	赣锋锂业	500	32,700.00	0.01

435	688147	微导纳米	200	32,376.00	0.01
436	000563	陕国投A	11,600	32,016.00	0.01
437	600740	山西焦化	10,000	31,900.00	0.01
438	603059	倍加洁	1,300	31,525.00	0.01
439	002701	奥瑞金	7,400	31,524.00	0.01
440	301316	慧博云通	800	31,504.00	0.01
441	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.01
442	603816	顾家家居	1,400	31,304.00	0.01
443	600985	淮北矿业	2,200	30,910.00	0.01
444	600486	扬农化工	600	30,420.00	0.01
445	600380	健康元	3,200	30,144.00	0.01
446	601727	上海电气	4,300	30,100.00	0.01
447	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.01
448	603338	浙江鼎力	700	29,750.00	0.01
449	688549	中巨芯-U	800	29,448.00	0.01
450	301201	诚达药业	800	29,088.00	0.01
451	000987	越秀资本	3,700	28,934.00	0.01
452	600459	贵研铂业	1,000	28,880.00	0.01
453	603818	曲美家居	9,400	27,918.00	0.01
454	603179	新泉股份	560	27,804.00	0.01
455	600578	京能电力	4,300	27,735.00	0.00
456	300503	昊志机电	300	27,690.00	0.00
457	000830	鲁西化工	2,300	27,600.00	0.00
458	600309	万华化学	400	27,364.00	0.00
459	601828	美凯龙	13,400	27,336.00	0.00
460	600460	士兰微	500	27,330.00	0.00
461	601598	中国外运	5,500	27,280.00	0.00
462	002192	融捷股份	300	26,820.00	0.00
463	601611	中国核建	2,400	26,760.00	0.00
464	600690	海尔智家	1,300	26,533.00	0.00
465	002399	海普瑞	2,900	26,042.00	0.00

466	300014	亿纬锂能	400	26,012.00	0.00
467	301371	敷尔佳	1,000	26,000.00	0.00
468	600158	中体产业	3,800	25,612.00	0.00
469	002292	奥飞娱乐	3,900	25,584.00	0.00
470	600497	驰宏锌锗	2,100	25,431.00	0.00
471	603881	数据港	980	24,500.00	0.00
472	300244	迪安诊断	1,300	24,362.00	0.00
473	002134	天津普林	800	24,336.00	0.00
474	601666	平煤股份	3,400	24,310.00	0.00
475	600997	开滦股份	5,100	24,225.00	0.00
476	601618	中国中冶	9,900	24,156.00	0.00
477	000028	国药一致	1,270	24,015.70	0.00
478	688432	有研硅	600	23,982.00	0.00
479	002727	一心堂	2,500	23,975.00	0.00
480	603093	南华期货	1,300	23,595.00	0.00
481	300487	蓝晓科技	400	23,540.00	0.00
482	600490	鹏欣资源	4,000	23,280.00	0.00
483	000932	华菱钢铁	6,700	23,249.00	0.00
484	688116	天奈科技	600	22,920.00	0.00
485	002025	航天电器	300	22,866.00	0.00
486	603915	国茂股份	1,600	22,704.00	0.00
487	000088	盐田港	5,500	22,495.00	0.00
488	601966	玲珑轮胎	2,200	22,418.00	0.00
489	300957	贝泰妮	700	22,057.00	0.00
490	603889	新澳股份	4,280	21,870.80	0.00
491	002444	巨星科技	700	21,770.00	0.00
492	002500	山西证券	4,200	21,672.00	0.00
493	603927	中科软	1,700	21,607.00	0.00
494	002364	中恒电气	400	21,520.00	0.00
495	300776	帝尔激光	100	21,496.00	0.00
496	002056	横店东磁	700	21,336.00	0.00

497	688063	派能科技	400	21,308.00	0.00
498	002624	完美世界	1,700	21,114.00	0.00
499	603233	大参林	1,400	21,042.00	0.00
500	601187	厦门银行	3,000	20,490.00	0.00
501	002926	华西证券	2,500	20,425.00	0.00
502	601778	晶科科技	4,700	20,210.00	0.00
503	301073	君亭酒店	1,100	20,020.00	0.00
504	603711	香飘飘	1,800	19,998.00	0.00
505	601019	山东出版	3,100	19,840.00	0.00
506	601155	新城控股	1,900	19,494.00	0.00
507	603819	神力股份	1,700	19,465.00	0.00
508	002582	好想你	2,300	19,435.00	0.00
509	002412	汉森制药	3,500	19,250.00	0.00
510	603920	世运电路	400	19,216.00	0.00
511	601608	中信重工	4,000	19,080.00	0.00
512	002867	周大生	1,700	18,955.00	0.00
513	002595	豪迈科技	405	18,873.00	0.00
514	300077	国民技术	600	18,810.00	0.00
515	300855	图南股份	600	18,756.00	0.00
516	002437	誉衡药业	6,900	18,630.00	0.00
517	002290	禾盛新材	200	18,374.00	0.00
518	688559	海目星	218	18,294.56	0.00
519	000801	四川九洲	1,400	18,116.00	0.00
520	603833	欧派家居	600	18,066.00	0.00
521	002795	永和智控	2,700	18,063.00	0.00
522	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.00
523	688382	益方生物-U	1,000	18,000.00	0.00
524	600566	济川药业	800	17,752.00	0.00
525	300099	尤洛卡	2,800	17,696.00	0.00
526	000537	绿发电力	2,400	17,544.00	0.00
527	603358	华达科技	400	17,400.00	0.00

528	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.00
529	002335	科华数据	405	17,192.25	0.00
530	300031	宝通科技	600	17,142.00	0.00
531	301075	多瑞医药	300	17,103.00	0.00
532	002798	帝欧水华	3,400	16,966.00	0.00
533	600655	豫园股份	4,100	16,851.00	0.00
534	600189	泉阳泉	2,200	16,566.00	0.00
535	300633	开立医疗	900	16,551.00	0.00
536	600409	三友化工	2,700	16,497.00	0.00
537	002015	协鑫能科	1,000	16,320.00	0.00
538	605020	永和股份	400	16,288.00	0.00
539	002266	浙富控股	3,200	16,192.00	0.00
540	300327	中颖电子	500	16,025.00	0.00
541	600968	海油发展	4,800	15,984.00	0.00
542	002244	滨江集团	2,100	15,960.00	0.00
543	688403	汇成股份	400	15,880.00	0.00
544	000034	神州数码	560	15,540.00	0.00
545	002085	万丰奥威	1,400	15,526.00	0.00
546	300602	飞荣达	300	15,360.00	0.00
547	600728	佳都科技	3,600	15,336.00	0.00
548	300070	碧水源	4,800	15,312.00	0.00
549	600475	华光环能	1,000	15,250.00	0.00
550	603901	永创智能	1,400	15,218.00	0.00
551	300811	铂科新材	160	15,182.40	0.00
552	000089	深圳机场	2,500	15,075.00	0.00
553	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
554	002239	奥特佳	6,000	14,820.00	0.00
555	001227	兰州银行	7,400	14,800.00	0.00
556	600126	杭钢股份	2,400	14,712.00	0.00
557	600366	宁波韵升	1,000	14,680.00	0.00
558	600629	华建集团	1,200	14,532.00	0.00

559	600517	国网英大	3,100	14,508.00	0.00
560	600061	国投资本	2,200	14,410.00	0.00
561	600521	华海药业	1,000	14,400.00	0.00
562	301511	德福科技	100	14,385.00	0.00
563	300699	光威复材	500	14,325.00	0.00
564	600619	海立股份	900	14,265.00	0.00
565	000901	航天科技	800	14,232.00	0.00
566	600977	中国电影	1,100	14,212.00	0.00
567	002536	飞龙股份	300	14,154.00	0.00
568	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
569	600056	中国医药	1,600	14,000.00	0.00
570	605118	力鼎光电	400	13,956.00	0.00
571	601717	中创智领	1,000	13,910.00	0.00
572	301018	申菱环境	120	13,873.20	0.00
573	603328	依顿电子	1,100	13,783.00	0.00
574	300634	彩讯股份	700	13,699.00	0.00
575	301116	益客食品	1,600	13,696.00	0.00
576	001339	智微智能	130	13,296.40	0.00
577	600750	华润江中	600	13,242.00	0.00
578	001313	粤海饲料	1,800	12,762.00	0.00
579	600208	衢州发展	4,500	12,735.00	0.00
580	600724	宁波富达	2,500	12,675.00	0.00
581	300130	新国都	600	12,624.00	0.00
582	000969	安泰科技	500	12,270.00	0.00
583	601577	长沙银行	1,400	12,194.00	0.00
584	603728	鸣志电器	200	12,184.00	0.00
585	001237	惠康科技	207	12,159.18	0.00
586	603162	海通发展	1,344	12,055.68	0.00
587	600783	鲁信创投	600	11,952.00	0.00
588	600587	新华医疗	1,000	11,880.00	0.00
589	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00

590	300049	福瑞医科	300	11,664.00	0.00
591	002831	裕同科技	322	11,450.32	0.00
592	301060	兰卫医学	1,400	11,438.00	0.00
593	600114	东睦股份	300	11,328.00	0.00
594	603707	健友股份	1,600	11,312.00	0.00
595	603589	口子窖	600	11,208.00	0.00
596	600559	老白干酒	1,000	11,200.00	0.00
597	600008	首创环保	4,100	11,152.00	0.00
598	301310	鑫宏业	200	11,048.00	0.00
599	300113	顺网科技	600	10,926.00	0.00
600	301290	东星医疗	400	10,900.00	0.00
601	600339	中油工程	3,500	10,745.00	0.00
602	603596	伯特利	432	10,730.88	0.00
603	002603	以岭药业	700	10,500.00	0.00
604	000927	中国铁物	4,600	10,442.00	0.00
605	600059	古越龙山	1,400	10,248.00	0.00
606	603871	嘉友国际	1,000	10,210.00	0.00
607	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
608	601789	宁波建工	2,500	10,025.00	0.00
609	002062	宏润建设	1,400	10,024.00	0.00
610	600649	城投控股	2,900	10,005.00	0.00
611	600458	时代新材	600	9,930.00	0.00
612	601016	节能风电	2,500	9,700.00	0.00
613	300454	深信服	100	9,620.00	0.00
614	600328	中盐化工	1,600	9,600.00	0.00
615	600171	上海贝岭	300	9,582.00	0.00
616	002755	奥赛康	700	9,534.00	0.00
617	601865	福莱特	900	9,459.00	0.00
618	001301	尚太科技	100	9,351.00	0.00
619	300341	麦克奥迪	700	9,275.00	0.00
620	000922	佳电股份	660	9,213.60	0.00

621	603606	东方电缆	220	9,132.20	0.00
622	300818	耐普矿机	480	9,072.00	0.00
623	600862	中航高科	500	9,015.00	0.00
624	002847	盐津铺子	200	8,920.00	0.00
625	600356	恒丰纸业	1,200	8,892.00	0.00
626	002379	宏桥控股	600	8,862.00	0.00
627	603071	物产环能	800	8,848.00	0.00
628	688349	三一重能	580	8,804.40	0.00
629	002078	太阳纸业	700	8,743.00	0.00
630	603301	振德医疗	100	8,716.00	0.00
631	300026	红日药业	3,000	8,700.00	0.00
632	600198	大唐电信	900	8,685.00	0.00
633	300233	金城医药	700	8,680.00	0.00
634	688289	圣湘生物	600	8,640.00	0.00
635	688182	灿勤科技	200	8,614.00	0.00
636	300002	神州泰岳	1,100	8,591.00	0.00
637	300629	新劲刚	400	8,584.00	0.00
638	600132	重庆啤酒	200	8,260.00	0.00
639	600835	上海机电	400	8,240.00	0.00
640	601975	招商南油	2,200	8,206.00	0.00
641	600461	洪城环境	900	8,154.00	0.00
642	002918	蒙娜丽莎	800	8,040.00	0.00
643	300779	惠城环保	160	8,032.00	0.00
644	002183	怡亚通	1,500	7,995.00	0.00
645	002721	金一文化	3,600	7,992.00	0.00
646	603119	浙江荣泰	120	7,960.80	0.00
647	301551	无线传媒	400	7,892.00	0.00
648	002434	万里扬	1,300	7,865.00	0.00
649	600511	国药股份	300	7,812.00	0.00
650	600104	上汽集团	800	7,808.00	0.00
651	600350	山东高速	700	7,791.00	0.00

652	301091	深城交	500	7,750.00	0.00
653	002283	天润工业	800	7,720.00	0.00
654	002400	省广集团	1,200	7,572.00	0.00
655	600470	六国化工	1,300	7,540.00	0.00
656	000032	深桑达A	300	7,485.00	0.00
657	605090	九丰能源	200	7,434.00	0.00
658	601890	亚星锚链	900	7,353.00	0.00
659	000425	徐工机械	900	7,281.00	0.00
660	600987	航民股份	1,200	7,260.00	0.00
661	601568	北元化工	2,100	7,140.00	0.00
662	000833	粤桂股份	300	7,026.00	0.00
663	000877	天山股份	1,900	6,897.00	0.00
664	000719	中原传媒	600	6,858.00	0.00
665	000061	农产品	1,200	6,720.00	0.00
666	002913	奥士康	100	6,394.00	0.00
667	301510	固高科技	200	6,386.00	0.00
668	600888	新疆众和	400	6,356.00	0.00
669	002151	北斗星通	200	6,350.00	0.00
670	002958	青农商行	2,300	6,302.00	0.00
671	601968	宝钢包装	1,600	6,272.00	0.00
672	301109	军信股份	500	6,230.00	0.00
673	600556	天下秀	1,400	6,188.00	0.00
674	603236	移远通信	120	6,140.40	0.00
675	600433	冠豪高新	1,900	6,099.00	0.00
676	300473	德尔股份	200	6,080.00	0.00
677	600095	湘财股份	800	6,024.00	0.00
678	601921	浙版传媒	900	6,021.00	0.00
679	601083	锦江航运	600	5,964.00	0.00
680	600751	海航科技	2,000	5,820.00	0.00
681	600782	新钢股份	2,300	5,704.00	0.00
682	300680	隆盛科技	250	5,680.00	0.00

683	002051	中工国际	500	5,660.00	0.00
684	301039	中集车辆	800	5,640.00	0.00
685	002969	嘉美包装	400	5,632.00	0.00
686	600120	浙江东方	1,300	5,590.00	0.00
687	000685	中山公用	500	5,580.00	0.00
688	600258	首旅酒店	500	5,460.00	0.00
689	603612	索通发展	300	5,439.00	0.00
690	002171	楚江新材	400	5,428.00	0.00
691	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.00
692	002707	众信旅游	1,100	5,280.00	0.00
693	601952	苏垦农发	700	5,243.00	0.00
694	002267	陕天然气	800	5,232.00	0.00
695	601997	贵阳银行	1,000	5,130.00	0.00
696	603568	伟明环保	320	4,921.60	0.00
697	300917	特发服务	200	4,876.00	0.00
698	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
699	603799	华友钴业	100	4,826.00	0.00
700	603055	台华新材	600	4,674.00	0.00
700	601311	骆驼股份	600	4,674.00	0.00
701	603496	恒为科技	200	4,596.00	0.00
702	300854	中兰环保	240	4,579.20	0.00
703	600094	大名城	1,300	4,498.00	0.00
704	603049	中策橡胶	100	4,481.00	0.00
705	000895	双汇发展	200	4,480.00	0.00
706	603126	中材节能	700	4,410.00	0.00
707	301267	华夏眼科	300	4,377.00	0.00
708	000030	富奥股份	1,100	4,257.00	0.00
709	002643	万润股份	200	4,190.00	0.00
710	300660	江苏雷利	150	4,179.00	0.00
711	600480	凌云股份	500	4,155.00	0.00
712	301106	骏成科技	200	4,148.00	0.00

713	002075	沙钢股份	1,200	4,080.00	0.00
714	301171	易点天下	120	4,075.20	0.00
715	300921	南凌科技	200	4,062.00	0.00
716	603171	税友股份	100	3,985.00	0.00
717	601555	东吴证券	500	3,960.00	0.00
718	002984	森麒麟	300	3,921.00	0.00
719	601512	中新集团	500	3,900.00	0.00
720	002408	齐翔腾达	800	3,752.00	0.00
721	000825	太钢不锈	1,100	3,751.00	0.00
722	002345	潮宏基	400	3,668.00	0.00
723	002757	南兴股份	200	3,610.00	0.00
724	601619	嘉泽新能	800	3,440.00	0.00
725	002539	云图控股	300	3,396.00	0.00
726	603737	三棵树	140	3,374.00	0.00
727	003039	顺控发展	300	3,303.00	0.00
728	000937	冀中能源	820	3,263.60	0.00
729	002170	芭田股份	300	3,258.00	0.00
730	601609	金田股份	300	3,240.00	0.00
731	600184	光电股份	100	3,201.00	0.00
732	300641	正丹股份	200	3,076.00	0.00
733	300682	朗新科技	300	2,970.00	0.00
734	605507	国邦医药	200	2,960.00	0.00
735	301363	美好医疗	160	2,932.80	0.00
736	301125	腾亚精工	200	2,872.00	0.00
737	600186	莲花控股	200	2,800.00	0.00
738	002315	焦点科技	120	2,793.60	0.00
739	301602	超研股份	200	2,748.00	0.00
740	600057	厦门象屿	500	2,710.00	0.00
741	603299	苏盐井神	300	2,637.00	0.00
742	300777	中简科技	100	2,628.00	0.00
743	002402	和而泰	100	2,583.00	0.00

744	605555	德昌股份	200	2,500.00	0.00
745	600256	广汇能源	500	2,470.00	0.00
746	301263	泰恩康	120	2,458.80	0.00
747	001311	多利科技	150	2,419.50	0.00
748	300036	超图软件	200	2,254.00	0.00
749	002705	新宝股份	200	2,216.00	0.00
750	600508	上海能源	300	2,211.00	0.00
751	001218	丽臣实业	100	2,206.00	0.00
752	601069	西部黄金	100	2,200.00	0.00
753	603883	老百姓	200	2,192.00	0.00
754	600718	东软集团	300	2,172.00	0.00
755	300655	晶瑞电材	100	2,142.00	0.00
756	301215	中汽股份	400	2,076.00	0.00
757	000065	北方国际	200	1,966.00	0.00
758	301156	美农生物	180	1,956.60	0.00
759	601112	振石股份	100	1,823.00	0.00
760	002226	江南化工	400	1,796.00	0.00
761	300446	航天智造	100	1,683.00	0.00
762	300752	隆利科技	120	1,616.40	0.00
763	300532	今天国际	240	1,495.20	0.00
764	603477	巨星农牧	100	1,480.00	0.00
765	600757	长江传媒	200	1,462.00	0.00
766	601026	道生天合	100	1,458.00	0.00
767	002960	青鸟智控	160	1,355.20	0.00
768	603693	江苏新能	100	1,259.00	0.00
769	002987	京北方	120	1,167.60	0.00
770	601058	赛轮轮胎	100	1,153.00	0.00
771	002139	拓邦股份	100	952.00	0.00
772	601668	中国建筑	200	868.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600577	精达股份	6,444,849.00	1.35
2	688525	佰维存储	4,649,153.67	0.97
3	300308	中际旭创	4,432,396.00	0.93
4	300857	协创数据	4,257,738.00	0.89
5	300604	长川科技	3,920,403.00	0.82
6	601899	紫金矿业	3,903,947.00	0.82
7	000792	盐湖股份	3,896,694.99	0.82
8	688469	芯联集成-U	3,884,508.10	0.81
9	002738	中矿资源	3,809,571.00	0.80
10	600320	振华重工	3,719,337.00	0.78
11	600183	生益科技	3,705,320.00	0.78
12	001309	德明利	3,567,736.00	0.75
13	000553	安道麦A	3,475,826.00	0.73
14	601108	财通证券	3,472,031.00	0.73
15	002415	海康威视	3,441,224.00	0.72
16	600037	歌华有线	3,410,285.00	0.71
17	603588	高能环境	3,347,880.00	0.70
18	603236	移远通信	3,347,214.00	0.70
19	300073	当升科技	3,307,372.00	0.69
20	688779	五矿新能	3,184,475.25	0.67

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688525	佰维存储	5,514,960.01	1.16

2	300409	道氏技术	5,186,450.00	1.09
3	600577	精达股份	4,864,621.00	1.02
4	002415	海康威视	4,761,160.68	1.00
5	300604	长川科技	4,547,672.00	0.95
6	300857	协创数据	4,458,199.00	0.93
7	600100	同方股份	4,429,075.00	0.93
8	300308	中际旭创	4,200,950.00	0.88
9	002156	通富微电	4,119,846.00	0.86
10	603259	药明康德	4,101,176.00	0.86
11	000050	深天马A	4,058,846.00	0.85
12	002602	世纪华通	4,022,226.00	0.84
13	600183	生益科技	4,007,095.00	0.84
14	002008	大族激光	3,927,921.60	0.82
15	603236	移远通信	3,750,596.00	0.79
16	000792	盐湖股份	3,746,700.00	0.79
17	601108	财通证券	3,714,620.00	0.78
18	002738	中矿资源	3,645,016.00	0.76
19	002004	华邦健康	3,608,986.95	0.76
20	601865	福莱特	3,556,507.00	0.75

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	909,537,586.30
卖出股票收入（成交）总额	937,286,181.58

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照成交单价乘以成交数量填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,024,273.22	1.80

2	央行票据	-	-
3	金融债券	387,036,924.64	69.65
	其中：政策性金融债	81,122,383.55	14.60
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)	18,142.42	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	397,079,340.28	71.46

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	092280069	22华夏银行二级资本 债01	300,000	31,327,890.4 1	5.64
2	092280065	22工行二级资本债03 A	300,000	31,284,540.8 2	5.63
3	232480052	24浦发银行二级资本 债01A	300,000	31,022,164.9 3	5.58
4	2228041	22农业银行二级01	300,000	30,589,684.9 3	5.51
5	250211	25国开11	300,000	30,385,972.6 0	5.47

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内受到国家外汇管理局、中国人民银行处罚。厦门国际银行在报告编制日前一年内受到中国人民银行处罚。浦发银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局、中国人民银行处罚。农业银行、中国银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。华夏银行、工商银行、交通银行、建设银行、兴业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、中国人民银行处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其他主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	72,074.90
2	应收清算款	203,014.06
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,835.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	316,924.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,664	268,196.19	440,186,581.73	98.63%	6,091,885.40	1.37%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	95.68%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	42,432.24	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年05月08日)基金份额总额	350,071,562.96
本报告期期初基金份额总额	402,985,943.86
本报告期基金总申购份额	58,239,529.24
减：本报告期基金总赎回份额	14,947,005.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	446,278,467.13

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人本报告期内重大人事变动情况：无。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况：

2026年6月，经中信银行研究决定，杨璋琪任中信银行运营管理部总经理，不再任中信银行资产托管部总经理职务。

2026年6月，王坚任中信银行资产托管部总经理，待获得基金从业资格并履行备案程序后正式履职。上述事项对中信银行基金业务无影响。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	中加基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月30日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控等
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题，已及时通过完善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	1,846,100,405.26	100.00%	269,372.12	100.00%	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- （1）基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- （2）公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- （3）研究服务实力：研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各项领域，研究报告分析严谨，观点独立、客观；在符合相关法规及执业规范的前提下，能根据公司的特定要求提供专题研究报告；具备较强的服务意识，能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会等；
- （4）交易能力：证券交易的交易委托和成交回报的及时性和有效性。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

- （1）权益投资部根据日常券商研究服务情况提议开立（含首次开立和新增开立）或关闭相关席位，挑选时应考虑在证券交易所都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- （2）总经理办公会负责审批、确定券商席位的首次开立事宜，投资决策委员会负责审批券商除首次开立以外新增及关闭席位事宜；
- （3）券商名单及相应的席位租用安排确定后，权益投资部负责协调办理咨询服务协议或研究服务协议签署等相关事宜，集中交易部负责协调办理正式租用席位协议签署等相关事宜。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	22,534,563.28	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

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

1	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-05
2	中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-08
3	中加科丰价值精选混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-08
4	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-20
5	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-27
6	中加科丰价值精选混合型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-21

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260630	117,584,405.56	0.00	0.00	117,584,405.56	26.35%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加科丰价值精选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加科丰价值精选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加科丰价值精选混合型证券投资基金托管协议》
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

基金管理人处

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日