

泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	79
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	80
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	80
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	80
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	80
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
7.12 投资组合报告附注	80
§8 基金份额持有人信息	81
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81

8.2 盈利投资者数量占比	81
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	81
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	82
§9 开放式基金份额变动	82
§10 重大事件揭示	82
10.1 基金份额持有人大会决议	82
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	82
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	82
10.4 基金投资策略的改变	82
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
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	83
10.8 其他重大事件	86
§11 影响投资者决策的其他重要信息	87
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	87
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§12 备查文件目录	88
12.1 备查文件目录	88
12.2 存放地点	88
12.3 查阅方式	88

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓信混合
基金主代码	002801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月01日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	128,889,401.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，力争为投资者带来稳健的投资回报。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，从宏观经济环境、国家政策导向、产业转型与变革等多个角度，积极挖掘新经济环境下的投资机遇，精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。对于债券投资策略，本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。同时，本基金将本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高

	于债券型基金、货币市场基金。
--	----------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	郭明
	联系电话	010-59850151	010-66105799
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59850195	010-66105798
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区 北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告置备地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日 - 2026年06月30日)
本期已实现收益	40,156,506.95
本期利润	49,939,960.90
加权平均基金份额本期利润	0.4354
本期加权平均净值利润率	19.90%
本期基金份额净值增长率	21.80%
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	177,883,714.17
期末可供分配基金份额利润	1.3801
期末基金资产净值	309,533,313.10
期末基金份额净值	2.4015
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	198.87%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
----	--------------	---------------------	--------------------	---------------------------	-----	-----

过去三个月	18.32%	1.45%	16.72%	1.48%	1.60%	-0.03%
过去六个月	21.80%	1.42%	18.97%	1.49%	2.83%	-0.07%
过去一年	48.55%	1.20%	46.60%	1.28%	1.95%	-0.08%
过去三年	70.75%	1.32%	52.52%	1.31%	18.23%	0.01%
过去五年	24.38%	1.27%	37.82%	1.07%	-13.44%	0.20%
过去七年	187.93%	1.28%	69.08%	0.97%	118.85%	0.31%
过去十年	198.27%	1.19%	98.62%	0.86%	99.65%	0.33%
自基金合同生效起至今	198.87%	1.18%	98.80%	0.86%	100.07%	0.32%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

根据《泓德基金管理有限公司关于修改泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准的公告》，本基金自2023年12月22日起变更业绩比较基准。原业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。变更后的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

基准指数的构建原则如下：

- （1）中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场中中小市值公司的整体状况。
- （2）中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。
- （3）由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

泓德基金始终以“为客户创造价值”为己任，坚持长期价值投资理念，发挥主动投资管理优势，致力于为广大投资者提供专业、优质、高效的资产管理服务，力争成为受人尊重的资产管理机构。

公司已建立科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳定专业的投资研究团队，专业高效的市场服务体系，稳健的运营保障体系。公司已覆盖从公募到专户，从主动权益投资、量化投资到固定收益投资，从低风险到中、高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等主流基金品种，产品谱系不断完善，满足居民日益多元的财富管理需求。

未来公司将继续秉持投资者利益至上的初心，不断精进，推动公司高质量发展。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
李子昂	本基金的基金经理、 智能投资部副总监	2023- 10-26	-	12年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未出现超过该证券当日成交量的5%的情况。本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股主要指数呈现出上涨趋势，但个股出现较大分化，第二季度的科技行情带动了成长股的大幅上涨，同时红利、价值、现金流等风格被持续压制，成长价值的剪刀差被进一步放大。上半年，量化产品的整体超额波动较大，快速的风格切换和极致的一九行情给量化策略带来了较多困难，我们在策略上做了均衡配置，没有在市值和成长上做过多暴露，超额收益经历了年初的低谷后也得到了稳健修复。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德泓信混合基金份额净值为2.4015元，本报告期内，基金份额净值增长率为21.80%，同期业绩比较基准收益率为18.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7月以来，市场再次出现大幅反转，受Meta出售算力消息刺激和韩国市场大跌影响，电子、通信等热门板块出现显著回调，红利类资产触底反弹，同时也引发了市场对于AI泡沫和科技股牛市终结的讨论。从已实现的AI编程到未来的具身智能，AI技术依然在快速发展，当然技术的进步也不是一蹴而就的，二级市场受资金面和流动性影响总会产生或大或小的波动并呈现出一定的周期性，我们应该理性去看待这种波动。宏观方面，上半年GDP同比增长4.7%，符合全年GDP增长目标区间，但内需压力较大，二季度，投资大幅下滑，地产投资依旧拖累较大，消费明显回落，只有出口依旧保持韧性。与宏观经济总体平稳形成对比的是微观体感的差异，大家感受到的是居民就业的压力、收入的压力，企业订单的压力，但背后反映的是我国经济新旧动能的转换，以高端制造、数字经济、现代服务为代表的新动能对经济增长的贡献率超过了4成。聚焦在产品上，我们希望持续开发多元化的Alpha策略，努力适应较为多变的市场环境，力争为投资者创造更好收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序,设立基金估值委员会,估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有多年证券、基金从业经验,熟悉相关法律法规,具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值原则和方法的讨论,但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任,当存有异议时,托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释,通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议,由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定,本基金本报告期内未实施利润分配。

本基金截至2026年06月30日,期末可供分配利润为177,883,714.17元,其中:未分配利润已实现部分为177,883,714.17元,未分配利润未实现部分为2,760,197.70元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2026年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：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	24,540,925.19	29,637,817.96
结算备付金		1,136,382.76	654,690.07
存出保证金		47,268.41	26,628.85
交易性金融资产	6.4.7.2	285,450,240.43	204,947,100.02
其中：股票投资		285,394,274.51	204,847,748.75
基金投资		-	-
债券投资		55,965.92	99,351.27
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		33,324.33	-
应收股利		-	-

应收申购款		122,326.63	545,630.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		311,330,467.75	235,811,867.65
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		-	4,905,945.63
应付赎回款		1,342,797.07	6,465,684.74
应付管理人报酬		187,512.00	137,252.23
应付托管费		35,158.49	25,734.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	231,687.09	148,419.02
负债合计		1,797,154.65	11,683,036.40
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	128,889,401.23	113,674,951.16
未分配利润	6.4.7.8	180,643,911.87	110,453,880.09
净资产合计		309,533,313.10	224,128,831.25
负债和净资产总计		311,330,467.75	235,811,867.65

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值2.4015元，基金份额总额128,889,401.23份。

6.2 利润表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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		51,226,829.48	17,073,826.85
1.利息收入		40,266.60	18,294.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	40,266.60	18,294.71
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）		41,089,935.39	11,869,948.89
其中：股票投资收益	6.4.7.10	39,404,472.62	10,305,869.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	64,874.87	8,316.11
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,620,587.90	1,555,763.32
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.14	9,783,453.95	5,131,261.46
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.15	313,173.54	54,321.79

号填列)			
减：二、营业总支出		1,286,868.58	798,105.70
1.管理人报酬		995,937.94	587,851.65
2.托管费		186,738.35	110,222.19
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.16	104,192.29	100,031.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		49,939,960.90	16,275,721.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		49,939,960.90	16,275,721.15
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		49,939,960.90	16,275,721.15

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：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	113,674,951.16	110,453,880.09	224,128,831.25
二、本期期初净资产	113,674,951.16	110,453,880.09	224,128,831.25

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,214,450.07	70,190,031.78	85,404,481.85
（一）、综合收益总额	-	49,939,960.90	49,939,960.90
（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）	15,214,450.07	20,250,070.88	35,464,520.95
其中：1.基金申购款	67,524,222.77	82,619,719.33	150,143,942.10
2.基金赎回款	-52,309,772.70	-62,369,648.45	-114,679,421.15
（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	128,889,401.23	180,643,911.87	309,533,313.10
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	109,344,442.46	49,842,279.84	159,186,722.30
二、本期期初净资产	109,344,442.46	49,842,279.84	159,186,722.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,685,735.42	6,678,263.98	-11,007,471.44
（一）、综合收益总额	-	16,275,721.15	16,275,721.15
（二）、本期基金	-17,685,735.42	-9,597,457.17	-27,283,192.59

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	10,435,889.16	5,341,626.59	15,777,515.75
2.基金赎回款	-28,121,624.58	-14,939,083.76	-43,060,708.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	91,658,707.04	56,520,543.82	148,179,250.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓

王德晓

王玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2016]967号《关于准予泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型，自基金合同生效之日起至18个月后对应日的前一个工作日（含该日）止的期间内采用封闭式运作方式，如不存在该对应日的，顺延至下一工作日，封闭期结束后转为开放式运作，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集847,529,845.47元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第699号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为847,544,853.76份，其中认购资金利息折合15,008.29份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、中期票据、债券回购和银行存款、同业存单等固定收益类投资工具，股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为0%-100%；转为开放式运作后股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%。本基金如果投资股指期货、国债期货，则在封闭期内，每个交易日日终扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于交易保证金一倍的现金；转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》《证券投资基金会计核算业务指引》《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年1月1日至2026年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027年12月31日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

- (4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。
- (5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	24,540,925.19
等于：本金	24,538,582.25
加：应计利息	2,342.94
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	24,540,925.19

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		269,201,377.24	-	285,394,274.51	16,192,897.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	42,500.00	2.77	55,965.92	13,463.15
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	42,500.00	2.77	55,965.92	13,463.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		269,243,877.24	2.77	285,450,240.43	16,206,360.42

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,875.62
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	145,500.79

其中：交易所市场	145,500.79
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	83,310.68
合计	231,687.09

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	113,674,951.16	113,674,951.16
本期申购	67,524,222.77	67,524,222.77
本期赎回（以“-”号填列）	-52,309,772.70	-52,309,772.70
本期末	128,889,401.23	128,889,401.23

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	117,661,380.10	-7,207,500.01	110,453,880.09
本期期初	117,661,380.10	-7,207,500.01	110,453,880.09
本期利润	40,156,506.95	9,783,453.95	49,939,960.90
本期基金份额交易产生的变动数	20,065,827.12	184,243.76	20,250,070.88
其中：基金申购款	82,367,101.01	252,618.32	82,619,719.33
基金赎回款	-62,301,273.89	-68,374.56	-62,369,648.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	177,883,714.17	2,760,197.70	180,643,911.87

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	37,411.52
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	1,665.90
其他	1,189.18
合计	40,266.60

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	707,586,743.16
减：卖出股票成本总额	667,467,251.92
减：交易费用	715,018.62
买卖股票差价收入	39,404,472.62

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	24.34
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	64,850.53
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	64,874.87

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	157,902.87
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	93,000.00
减：应计利息总额	46.02
减：交易费用	6.32
买卖债券差价收入	64,850.53

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,620,587.90
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,620,587.90

6.4.7.14 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	9,783,453.95
——股票投资	9,813,917.62

——债券投资	-30,463.67
——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	9,783,453.95

6.4.7.15 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	310,311.94
基金转换费收入	2,861.60
合计	313,173.54

6.4.7.16 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	23,803.31
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,281.61
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	104,192.29

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
李娇	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	995,937.94	587,851.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	170,905.42	25,152.46
应支付基金管理人的净管理费	825,032.52	562,699.19

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬＝前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	186,738.35	110,222.19

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	159,232.49	0.12%	310,948.60	0.27%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	24,540,925.19	37,411.52	11,416,110.23	14,521.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（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
301666	大普微	2026-04-08	6个月以上	限售股	46.08	463.33	340	15,667.20	157,532.20	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月以上	限售股	81.88	1,584.33	56	4,585.28	88,722.48	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月以上	新股未上市且限售	10.11	10.11	8,557	86,511.27	86,511.27	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月以	限售股	9.47	70.14	721	6,827.87	50,570.94	-

			上							
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月以上	限售股	19.68	141.49	349	6,868.32	49,380.01	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月以上	限售股	69.66	160.06	233	16,230.78	37,293.98	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个交易日	新股未上市	10.11	10.11	3,666	37,063.26	37,063.26	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月以上	限售股	17.52	35.92	1,017	17,817.84	36,530.64	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月以上	限售股	40.98	308.19	118	4,835.64	36,366.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月以上	限售股	26.28	172.09	187	4,914.36	32,180.83	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月以上	限售股	92.18	463.15	62	5,715.16	28,715.30	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6个月以上	限售股	22.68	47.61	478	10,841.04	22,757.58	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月以上	限售股	7.82	20.74	1,028	8,038.96	21,320.72	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月以上	限售股	13.30	51.56	264	3,511.20	13,611.84	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月以	限售股	24.68	86.80	142	3,504.56	12,325.60	-

			上							
301687	新广益	2025-12-24	6个月以上	限售股	21.93	77.78	150	3,289.50	11,667.00	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月以上	限售股	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月以上	限售股	58.00	112.16	84	4,872.00	9,421.44	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月以上	限售股	13.91	32.47	280	3,894.80	9,091.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月以上	限售股	27.19	31.31	239	6,498.41	7,483.09	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月以上	限售股	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月以上	限售股	30.38	38.99	168	5,103.84	6,550.32	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月以上	限售股	55.95	57.10	99	5,539.05	5,652.90	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月以上	限售股	53.26	58.74	96	5,112.96	5,639.04	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月以上	限售股	11.18	17.59	227	2,537.86	3,992.93	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月以	限售股	21.88	25.52	64	1,400.32	1,633.28	-

			上							
603284	林平发展	2026-02-03	6个月以上	限售股	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月以上	限售股	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月以上	限售股	18.38	16.78	83	1,525.54	1,392.74	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月以上	限售股	33.49	33.93	41	1,373.09	1,391.13	-

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
113704	春风转债	2026-06-11	17个交易日	新债未上市	100.00	100.00	110	11,000.00	11,000.51	-
118072	鼎通转债	2026-06-25	16个交易日	新债未上市	100.00	100.00	50	5,000.00	5,000.15	-
111025	圣泉转债	2026-06-26	17个交易日	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.03	-
118071	华峰转债	2026-06-24	17个交易日	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000524	岭南控股	2026-06-24	重大资产重组	8.95	2026-07-08	9.85	20,600	185,058.00	184,370.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	832.00	2026-07-13	890.99	200	110,692.00	166,400.00	-

注：本基金截至2026年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基

金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他信用良好的境内商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(若有)占基金资产净值的比例为0.02%(上年度末：0.04%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人 对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产占基金资产净值比例、单一证券占基金资产净值比例及 7 日可变现资产价值等流动性指标均符合法律法规的要求。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	24,540,925.19	-	-	-	24,540,925.19
结算备付金	1,136,382.76	-	-	-	1,136,382.76
存出保证金	47,268.41	-	-	-	47,268.41
交易性金融资产	-	-	55,965.92	285,394,274.51	285,450,240.43
应收清算款	-	-	-	33,324.33	33,324.33
应收申购款	-	-	-	122,326.63	122,326.63
资产总计	25,724,576.36	-	55,965.92	285,549,925.47	311,330,467.75
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,342,797.07	1,342,797.07
应付管理人报酬	-	-	-	187,512.00	187,512.00
应付托管费	-	-	-	35,158.49	35,158.49
其他负债	-	-	-	231,687.09	231,687.09
负债总计	-	-	-	1,797,154.65	1,797,154.65
利率敏感度缺口	25,724,576.36	-	55,965.92	283,752,770.82	309,533,313.10
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	29,637,817.96	-	-	-	29,637,817.96
结算备付金	654,690.07	-	-	-	654,690.07
存出保证金	26,628.85	-	-	-	26,628.85
交易性金融资产	-	-	99,351.27	204,847,748.75	204,947,100.02
应收申购款	-	-	-	545,630.75	545,630.75
资产总计	30,319,136.88	-	99,351.27	205,393,379.50	235,811,867.65
负债					
应付清算款	-	-	-	4,905,945.63	4,905,945.63
应付赎回款	-	-	-	6,465,684.74	6,465,684.74
应付管理人报酬	-	-	-	137,252.23	137,252.23
应付托管费	-	-	-	25,734.78	25,734.78
其他负债	-	-	-	148,419.02	148,419.02
负债总计	-	-	-	11,683,036.40	11,683,036.40
利率敏感度缺口	30,319,136.88	-	99,351.27	193,710,343.10	224,128,831.25

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（不包括可转债和可交换债）公允价值占基金资产净值的比例为0%(上年度末：0%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	285,394,274.51	92.20	204,847,748.75	91.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	55,965.92	0.02	99,351.27	0.04
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	285,450,240.43	92.22	204,947,100.02	91.44

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	14,313,470.29	10,639,976.60
	业绩比较基准下降5%	-14,313,470.29	-10,639,976.60

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	284,285,387.20	203,961,947.08
第二层次	493,345.24	587,858.76
第三层次	671,507.99	397,294.18
合计	285,450,240.43	204,947,100.02

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	285,394,274.51	91.67
	其中：股票	285,394,274.51	91.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	55,965.92	0.02
	其中：债券	55,965.92	0.02
	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	25,677,307.95	8.25
8	其他各项资产	202,919.37	0.07
9	合计	311,330,467.75	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,561,575.40	0.50
B	采矿业	9,123,086.72	2.95
C	制造业	215,744,077.09	69.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,957,080.53	0.63
E	建筑业	1,925,087.00	0.62
F	批发和零售业	7,434,421.20	2.40
G	交通运输、仓储和邮政业	2,883,232.46	0.93
H	住宿和餐饮业	118,734.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,528,774.16	5.99
J	金融业	14,065,059.50	4.54
K	房地产业	1,457,778.00	0.47
L	租赁和商务服务业	2,954,554.65	0.95
M	科学研究和技术服务业	3,135,042.40	1.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,946,804.40	0.95
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	376,943.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	1,114,864.00	0.36
S	综合	67,160.00	0.02
	合计	285,394,274.51	92.20

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资
---	------	------	-------	---------	------

号					产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	2,700	3,429,000.00	1.11
2	603986	兆易创新	3,300	2,689,500.00	0.87
3	002636	金安国纪	18,800	2,255,436.00	0.73
4	300502	新易盛	3,588	2,177,916.00	0.70
5	300054	鼎龙股份	17,300	1,833,281.00	0.59
6	301536	星宸科技	13,800	1,776,198.00	0.57
7	688002	睿创微纳	10,400	1,608,776.00	0.52
8	300223	北京君正	6,200	1,543,180.00	0.50
9	300857	协创数据	4,460	1,515,954.00	0.49
10	301377	鼎泰高科	2,600	1,432,340.00	0.46
11	300604	长川科技	4,000	1,365,680.00	0.44
12	688257	新锐股份	12,920	1,316,548.00	0.43
13	688498	源杰科技	670	1,263,620.00	0.41
14	688059	华锐精密	6,247	1,247,588.37	0.40
15	688090	瑞松科技	11,620	1,236,949.00	0.40
16	603061	金海通	2,405	1,207,839.10	0.39
17	300972	万辰集团	6,900	1,196,529.00	0.39
18	300975	商络电子	23,100	1,195,425.00	0.39
19	002842	翔鹭钨业	24,600	1,185,720.00	0.38
20	688025	杰普特	2,439	1,146,330.00	0.37
21	605289	罗曼股份	7,880	1,142,600.00	0.37
22	688378	奥来德	18,053	1,119,286.00	0.36
23	688629	华丰科技	5,800	1,087,558.00	0.35
24	300408	三环集团	6,500	1,084,850.00	0.35
25	300434	金石亚药	96,400	1,082,572.00	0.35
26	601899	紫金矿业	42,600	1,070,964.00	0.35
27	300475	香农芯创	3,500	1,050,000.00	0.34
28	688525	佰维存储	2,000	989,460.00	0.32
29	688127	蓝特光学	10,068	982,636.80	0.32

30	603125	常青科技	29,900	978,926.00	0.32
31	688456	有研粉材	7,000	977,200.00	0.32
32	002384	东山精密	3,700	970,695.00	0.31
33	688519	南亚新材	2,553	970,242.12	0.31
34	688008	澜起科技	3,114	965,028.60	0.31
35	300613	富瀚微	12,000	960,960.00	0.31
36	002645	华宏科技	34,800	957,348.00	0.31
37	600176	中国巨石	13,100	954,728.00	0.31
38	002266	浙富控股	187,700	949,762.00	0.31
39	001339	智微智能	9,130	933,816.40	0.30
40	300567	精测电子	2,900	921,040.00	0.30
41	300184	力源信息	52,400	919,620.00	0.30
42	600487	亨通光电	8,400	918,456.00	0.30
43	688582	芯动联科	14,000	910,000.00	0.29
44	688146	中船特气	2,600	909,974.00	0.29
45	301031	中熔电气	7,458	890,858.10	0.29
46	301358	湖南裕能	11,700	887,679.00	0.29
47	603711	香飘飘	79,200	879,912.00	0.28
48	688630	芯碁微装	1,600	879,024.00	0.28
49	601233	桐昆股份	40,600	878,990.00	0.28
50	688308	欧科亿	4,800	872,688.00	0.28
51	600030	中信证券	30,200	867,646.00	0.28
52	301500	飞南资源	32,700	851,835.00	0.28
53	605117	德业股份	7,960	845,192.80	0.27
54	600961	株冶集团	25,800	835,662.00	0.27
55	688155	先惠技术	10,200	825,078.00	0.27
56	000933	神火股份	38,600	818,320.00	0.26
57	600150	中国船舶	24,200	817,718.00	0.26
58	000725	京东方 A	94,200	817,656.00	0.26
59	300570	太辰光	3,300	814,143.00	0.26
60	300953	震裕科技	6,080	812,896.00	0.26

61	603259	药明康德	6,500	809,315.00	0.26
62	688400	凌云光	12,200	807,640.00	0.26
63	603444	吉比特	2,200	788,524.00	0.25
64	301329	信音电子	31,900	774,851.00	0.25
65	002493	荣盛石化	71,600	769,700.00	0.25
66	688766	普冉股份	1,000	766,600.00	0.25
67	300590	移为通信	53,200	763,420.00	0.25
68	688409	富创精密	2,453	751,231.25	0.24
69	002956	西麦食品	36,180	751,096.80	0.24
70	301371	敷尔佳	28,800	748,800.00	0.24
71	002281	光迅科技	2,900	745,126.00	0.24
72	688690	纳微科技	16,800	740,880.00	0.24
73	002709	天赐材料	14,400	740,592.00	0.24
74	002154	报喜鸟	207,200	737,632.00	0.24
75	001316	润贝航科	21,820	719,623.60	0.23
76	000612	焦作万方	67,600	715,884.00	0.23
77	688633	星球石墨	24,000	713,520.00	0.23
78	000426	兴业银锡	21,600	711,936.00	0.23
79	600183	生益科技	4,100	710,940.00	0.23
80	601995	中金公司	19,600	708,540.00	0.23
81	002371	北方华创	800	707,648.00	0.23
82	603345	安井食品	8,800	705,672.00	0.23
83	603317	天味食品	54,100	703,841.00	0.23
84	301308	江波龙	1,000	703,800.00	0.23
85	000623	吉林敖东	39,600	702,108.00	0.23
86	000686	东北证券	83,100	698,040.00	0.23
87	300037	新宙邦	7,400	687,090.00	0.22
88	601688	华泰证券	33,300	686,646.00	0.22
89	300394	天孚通信	2,260	684,056.80	0.22
90	002079	苏州固锟	45,500	683,865.00	0.22
91	603390	通达电气	65,100	679,644.00	0.22

92	300438	鹏辉能源	8,100	671,085.00	0.22
93	603225	新凤鸣	34,000	668,100.00	0.22
94	300511	雪榕生物	131,500	661,445.00	0.21
95	001314	亿道信息	10,700	661,260.00	0.21
96	001309	德明利	700	660,030.00	0.21
97	002378	章源钨业	19,600	656,208.00	0.21
98	000807	云铝股份	29,600	655,344.00	0.21
99	603031	安孚科技	12,235	651,513.75	0.21
100	300672	国科微	2,200	649,000.00	0.21
101	002993	奥海科技	9,000	644,490.00	0.21
102	000776	广发证券	27,100	634,140.00	0.20
103	600522	中天科技	10,300	625,004.00	0.20
104	300476	胜宏科技	1,800	623,574.00	0.20
105	300870	欧陆通	1,800	622,242.00	0.20
106	002606	大连电瓷	46,300	620,883.00	0.20
107	001332	锡装股份	15,620	613,397.40	0.20
108	000039	中集集团	75,600	613,116.00	0.20
109	688188	柏楚电子	5,734	611,817.80	0.20
110	301608	博实结	12,160	611,161.60	0.20
111	000551	创元科技	29,400	606,522.00	0.20
112	300283	温州宏丰	29,500	606,225.00	0.20
113	000100	TCL科技	102,600	597,132.00	0.19
114	300731	科创新源	10,080	588,268.80	0.19
115	600109	国金证券	66,900	587,382.00	0.19
116	300373	扬杰科技	3,700	581,751.00	0.19
117	000975	山金国际	33,900	576,300.00	0.19
118	002463	沪电股份	3,700	565,360.00	0.18
119	600685	中船防务	22,000	559,680.00	0.18
120	688111	金山办公	2,600	553,930.00	0.18
121	000703	恒逸石化	40,300	546,871.00	0.18
122	601211	国泰海通	29,900	544,180.00	0.18

123	603979	金诚信	9,200	543,076.00	0.18
124	688347	华虹宏力	1,600	538,080.00	0.17
125	002916	深南电路	1,150	526,585.00	0.17
126	301068	大地海洋	22,100	525,980.00	0.17
127	002653	海思科	7,900	524,086.00	0.17
128	003019	宸展光电	16,100	524,055.00	0.17
129	688668	鼎通科技	1,400	522,620.00	0.17
130	002414	高德红外	39,377	522,139.02	0.17
131	600482	中国动力	15,900	521,520.00	0.17
132	688717	艾罗能源	6,278	518,374.46	0.17
133	002409	雅克科技	2,300	516,350.00	0.17
134	688628	优利德	5,200	514,488.00	0.17
135	002796	世嘉科技	12,500	509,750.00	0.16
136	002738	中矿资源	8,600	507,314.00	0.16
137	001203	大中矿业	16,900	506,155.00	0.16
138	002558	巨人网络	18,300	504,348.00	0.16
139	000408	藏格矿业	7,200	499,104.00	0.16
140	001389	广合科技	2,100	498,225.00	0.16
141	600319	亚星化学	79,600	495,908.00	0.16
142	601699	潞安环能	34,700	495,516.00	0.16
143	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.16
144	301606	绿联科技	8,000	488,160.00	0.16
145	300033	同花顺	2,020	486,820.00	0.16
146	002818	富森美	46,400	482,096.00	0.16
147	000050	深天马 A	48,400	479,644.00	0.15
148	688503	聚和材料	3,600	477,720.00	0.15
149	300390	天华新能	5,100	476,901.00	0.15
150	002926	华西证券	58,300	476,311.00	0.15
151	688223	晶科能源	100,200	475,950.00	0.15
152	688678	福立旺	19,600	473,732.00	0.15
153	300187	永清环保	93,300	471,165.00	0.15

154	301200	大族数控	1,300	468,845.00	0.15
155	688291	金橙子	8,000	467,840.00	0.15
156	688699	明微电子	5,600	458,920.00	0.15
157	688392	骄成超声	2,000	454,360.00	0.15
158	603699	纽威股份	9,000	452,700.00	0.15
159	002841	视源股份	13,100	452,343.00	0.15
160	000792	盐湖股份	14,900	449,831.00	0.15
161	301316	慧博云通	11,400	448,932.00	0.15
162	001266	宏英智能	9,100	446,810.00	0.14
163	002475	立讯精密	6,300	443,520.00	0.14
164	002832	比音勒芬	21,400	441,696.00	0.14
165	688692	达梦数据	1,800	439,722.00	0.14
166	301345	涛涛车业	1,900	438,900.00	0.14
167	002120	韵达股份	69,000	438,840.00	0.14
168	000783	长江证券	45,000	438,750.00	0.14
169	688536	思瑞浦	1,200	436,908.00	0.14
170	301297	富乐德	7,100	434,804.00	0.14
171	605376	博迁新材	1,600	434,080.00	0.14
172	601138	工业富联	6,000	432,900.00	0.14
173	002429	兆驰股份	41,600	432,224.00	0.14
174	002134	天津普林	14,200	431,964.00	0.14
175	688627	精智达	600	429,000.00	0.14
176	001979	招商蛇口	66,400	426,952.00	0.14
177	603993	洛阳钼业	24,300	426,465.00	0.14
178	300679	电连技术	7,100	425,929.00	0.14
179	002111	威海广泰	47,300	425,700.00	0.14
180	300454	深信服	4,400	423,280.00	0.14
181	301086	鸿富瀚	2,020	422,745.60	0.14
182	000589	贵州轮胎	103,000	418,180.00	0.14
183	300681	英搏尔	14,600	417,852.00	0.13
184	603379	三美股份	5,500	417,395.00	0.13

185	002432	九安医疗	5,900	417,012.00	0.13
186	601061	中信金属	38,700	416,799.00	0.13
187	300782	卓胜微	3,800	416,404.00	0.13
188	688578	艾力斯	3,800	414,960.00	0.13
189	001337	四川黄金	11,300	414,258.00	0.13
190	002838	道恩股份	13,500	413,370.00	0.13
191	300835	龙磁科技	1,800	413,082.00	0.13
192	301212	联盛化学	17,600	410,960.00	0.13
193	301285	鸿日达	3,700	408,221.00	0.13
194	002948	青岛银行	80,200	407,416.00	0.13
195	000681	视觉中国	20,400	406,776.00	0.13
196	600704	物产中大	86,100	406,392.00	0.13
197	603260	合盛硅业	8,400	405,384.00	0.13
198	002648	卫星化学	17,200	404,028.00	0.13
199	002025	航天电器	5,300	403,966.00	0.13
200	301246	宏源药业	15,000	403,500.00	0.13
201	600999	招商证券	19,100	403,010.00	0.13
202	688191	智洋创新	11,280	402,696.00	0.13
203	002216	三全食品	34,400	396,632.00	0.13
204	300586	美联新材	25,300	395,692.00	0.13
205	600506	统一股份	28,360	393,920.40	0.13
206	603629	利通电子	2,200	393,382.00	0.13
207	603162	海通发展	43,800	392,886.00	0.13
208	002545	东方铁塔	24,200	392,524.00	0.13
209	688166	博瑞医药	11,200	392,112.00	0.13
210	002532	天山铝业	36,500	391,645.00	0.13
211	300487	蓝晓科技	6,625	389,881.25	0.13
212	688368	晶丰明源	1,800	389,736.00	0.13
213	603168	莎普爱思	81,700	385,624.00	0.12
214	688349	三一重能	25,320	384,357.60	0.12
215	601009	南京银行	38,800	383,732.00	0.12

216	002930	宏川智慧	41,500	381,800.00	0.12
217	000960	锡业股份	8,800	375,672.00	0.12
218	001218	丽臣实业	17,000	375,020.00	0.12
219	000657	中钨高新	3,900	373,308.00	0.12
220	688396	华润微	3,800	370,690.00	0.12
221	688041	海光信息	1,000	370,300.00	0.12
222	688372	伟测科技	1,989	369,954.00	0.12
223	002273	水晶光电	10,400	368,992.00	0.12
224	688172	燕东微	4,400	368,104.00	0.12
225	600301	华锡有色	6,000	367,920.00	0.12
226	301538	骏鼎达	7,300	367,701.00	0.12
227	605016	百龙创园	14,200	367,070.00	0.12
228	000060	中金岭南	48,400	366,388.00	0.12
229	002810	山东赫达	14,800	365,560.00	0.12
230	300073	当升科技	7,600	365,104.00	0.12
231	688301	奕瑞科技	2,920	362,080.00	0.12
232	600346	恒力石化	20,400	361,284.00	0.12
233	301387	光大同创	3,900	360,438.00	0.12
234	300115	长盈精密	12,900	360,426.00	0.12
235	301202	朗威股份	10,800	359,964.00	0.12
236	301180	万祥科技	28,700	359,611.00	0.12
237	002487	大金重工	6,200	359,414.00	0.12
238	603329	上海雅仕	40,000	359,200.00	0.12
239	603026	石大胜华	4,000	357,480.00	0.12
240	301016	雷尔伟	25,260	352,882.20	0.11
241	601600	中国铝业	42,800	351,816.00	0.11
242	688037	芯源微	800	351,240.00	0.11
243	300689	澄天伟业	5,000	350,900.00	0.11
244	688568	中科星图	8,400	348,348.00	0.11
245	603897	长城科技	10,700	347,322.00	0.11
246	002379	宏桥控股	23,500	347,095.00	0.11

247	000032	深桑达 A	13,900	346,805.00	0.11
248	600739	辽宁成大	34,000	343,740.00	0.11
249	688233	神工股份	1,600	343,072.00	0.11
250	300426	华智数媒	67,600	342,056.00	0.11
251	301383	天键股份	14,300	341,770.00	0.11
252	300620	光库科技	900	340,380.00	0.11
253	688700	东威科技	3,800	339,720.00	0.11
254	301369	联动科技	1,380	338,100.00	0.11
255	688095	福昕软件	5,682	337,681.26	0.11
256	688009	中国通号	70,800	337,008.00	0.11
257	300822	贝仕达克	28,800	336,960.00	0.11
258	003816	中国广核	85,900	335,869.00	0.11
259	300274	阳光电源	2,100	333,942.00	0.11
260	603129	春风动力	1,300	332,540.00	0.11
261	002724	海洋王	68,400	331,740.00	0.11
262	300968	格林精密	34,300	330,652.00	0.11
263	688772	珠海冠宇	16,822	330,215.86	0.11
264	300977	深圳瑞捷	21,400	329,988.00	0.11
265	000001	平安银行	32,800	329,640.00	0.11
266	601939	建设银行	34,200	329,346.00	0.11
267	688777	中控技术	2,800	329,000.00	0.11
268	603195	公牛集团	8,400	328,860.00	0.11
269	600909	华安证券	29,600	328,856.00	0.11
270	688182	灿勤科技	7,600	327,332.00	0.11
271	688550	瑞联新材	5,652	326,968.20	0.11
272	600036	招商银行	9,200	326,600.00	0.11
273	600547	山东黄金	14,100	325,569.00	0.11
274	301116	益客食品	38,000	325,280.00	0.11
275	002027	分众传媒	67,200	325,248.00	0.11
276	300014	亿纬锂能	5,000	325,150.00	0.11
277	301487	盟固利	16,900	323,635.00	0.10

278	603336	宏辉果蔬	40,800	323,136.00	0.10
279	603179	新泉股份	6,500	322,725.00	0.10
280	603839	安正时尚	55,900	322,543.00	0.10
281	688120	华海清科	1,000	322,180.00	0.10
282	601838	成都银行	18,200	322,140.00	0.10
283	002192	融捷股份	3,600	321,840.00	0.10
284	688252	天德钰	13,400	321,600.00	0.10
285	603508	思维列控	15,000	320,400.00	0.10
286	688256	寒武纪	200	319,110.00	0.10
287	600988	赤峰黄金	12,100	318,472.00	0.10
288	688981	中芯国际	2,000	317,640.00	0.10
289	002859	洁美科技	2,900	317,579.00	0.10
290	300406	九强生物	28,900	315,877.00	0.10
291	300154	瑞凌股份	41,800	314,336.00	0.10
292	688279	峰昭科技	1,400	314,216.00	0.10
293	002439	启明星辰	24,800	313,720.00	0.10
294	301261	恒工精密	4,000	312,400.00	0.10
295	002283	天润工业	32,300	311,695.00	0.10
296	301109	军信股份	25,000	311,500.00	0.10
297	688593	新相微	8,000	311,360.00	0.10
298	600801	华新建材	19,900	310,440.00	0.10
299	601336	新华保险	5,200	310,232.00	0.10
300	301102	兆讯传媒	36,103	308,680.65	0.10
301	688167	炬光科技	870	308,162.70	0.10
302	300763	锦浪科技	3,400	307,190.00	0.10
303	603600	永艺股份	34,600	306,902.00	0.10
304	301051	信濠光电	15,800	306,520.00	0.10
305	002080	中材科技	3,400	306,000.00	0.10
306	688580	伟思医疗	5,736	305,556.72	0.10
307	300365	恒华科技	66,700	305,486.00	0.10
308	600251	冠农股份	35,300	304,992.00	0.10

309	688248	南网科技	4,400	304,392.00	0.10
310	000973	佛塑科技	21,100	302,785.00	0.10
311	300418	昆仑万维	7,500	302,700.00	0.10
312	603063	禾望电气	5,700	301,473.00	0.10
313	300661	圣邦股份	2,100	301,308.00	0.10
314	600064	南京高科	42,000	299,460.00	0.10
315	003010	若羽臣	12,320	299,376.00	0.10
316	300696	爱乐达	11,500	299,345.00	0.10
317	002096	易普力	33,900	297,642.00	0.10
318	603175	超颖电子	3,300	293,997.00	0.09
319	300868	杰美特	2,000	293,420.00	0.09
320	603920	世运电路	6,100	293,044.00	0.09
321	002396	星网锐捷	15,230	291,959.10	0.09
322	603256	宏和科技	1,100	291,863.00	0.09
323	300504	天邑股份	18,000	290,340.00	0.09
324	000825	太钢不锈	85,000	289,850.00	0.09
325	301216	万凯新材	12,600	289,674.00	0.09
326	688615	合合信息	2,560	289,536.00	0.09
327	002752	昇兴股份	52,400	289,248.00	0.09
328	600768	宁波富邦	19,300	289,114.00	0.09
329	603766	隆鑫通用	24,200	288,706.00	0.09
330	003031	中瓷电子	1,600	288,480.00	0.09
331	688150	莱特光电	4,200	288,204.00	0.09
332	300011	鼎汉技术	46,800	284,544.00	0.09
333	300921	南凌科技	14,000	284,340.00	0.09
334	300823	建科智能	19,400	282,852.00	0.09
335	600369	西南证券	70,300	282,606.00	0.09
336	600517	国网英大	60,300	282,204.00	0.09
337	301328	维峰电子	3,960	281,952.00	0.09
338	300890	翔丰华	8,500	281,945.00	0.09
339	688148	芳源股份	32,800	281,424.00	0.09

340	688787	海天瑞声	2,093	281,403.85	0.09
341	603799	华友钴业	5,800	279,908.00	0.09
342	688012	中微公司	596	279,226.00	0.09
343	002803	吉宏股份	10,800	279,072.00	0.09
344	600989	宝丰能源	13,700	278,521.00	0.09
345	300548	长芯博创	1,000	278,000.00	0.09
346	301196	唯科科技	2,210	277,178.20	0.09
347	300738	奥飞数据	13,700	277,014.00	0.09
348	002028	思源电气	1,600	276,800.00	0.09
349	601231	环旭电子	8,500	275,400.00	0.09
350	002271	东方雨虹	23,200	275,384.00	0.09
351	300750	宁德时代	700	275,107.00	0.09
352	603156	养元饮品	5,600	274,792.00	0.09
353	600037	歌华有线	43,800	274,626.00	0.09
354	600765	中航重机	21,200	273,904.00	0.09
355	300909	汇创达	4,700	273,634.00	0.09
356	300529	健帆生物	17,740	273,196.00	0.09
357	301268	铭利达	19,500	272,610.00	0.09
358	688510	航亚科技	11,400	272,232.00	0.09
359	688778	厦钨新能	5,000	272,000.00	0.09
360	300393	中来股份	37,300	271,917.00	0.09
361	688786	悦安新材	5,880	270,950.40	0.09
362	002138	顺络电子	3,700	270,470.00	0.09
363	603808	歌力思	35,600	269,492.00	0.09
364	603882	金域医学	11,900	267,512.00	0.09
365	300444	双杰电气	21,900	267,399.00	0.09
366	002774	快意电梯	18,800	267,148.00	0.09
367	002182	宝武镁业	17,100	266,247.00	0.09
368	301195	北路智控	9,800	265,580.00	0.09
369	301106	骏成科技	12,800	265,472.00	0.09
370	688318	财富趋势	3,720	265,273.20	0.09

371	601628	中国人寿	7,500	265,125.00	0.09
372	002461	珠江啤酒	35,000	264,950.00	0.09
373	002436	兴森科技	5,200	264,940.00	0.09
374	688183	生益电子	2,000	264,800.00	0.09
375	300363	博腾股份	16,300	264,712.00	0.09
376	688733	壹石通	6,400	264,640.00	0.09
377	600549	厦门钨业	3,100	264,120.00	0.09
378	605189	富春染织	21,900	263,895.00	0.09
379	688228	开普云	3,400	262,956.00	0.08
380	300458	全志科技	6,660	262,803.60	0.08
381	300136	信维通信	2,200	262,350.00	0.08
382	300873	海晨股份	7,700	260,029.00	0.08
383	603308	应流股份	4,300	259,720.00	0.08
384	601069	西部黄金	11,800	259,600.00	0.08
385	688082	盛美上海	600	259,200.00	0.08
386	002947	恒铭达	3,400	258,570.00	0.08
387	002500	山西证券	50,000	258,000.00	0.08
388	688683	莱尔科技	6,800	257,856.00	0.08
389	605111	新洁能	2,600	257,764.00	0.08
390	002395	双象股份	21,500	257,140.00	0.08
391	002582	好想你	30,300	256,035.00	0.08
392	002008	大族激光	1,700	255,187.00	0.08
393	300876	蒙泰高新	17,740	254,214.20	0.08
394	300724	捷佳伟创	3,600	254,160.00	0.08
395	600390	五矿资本	55,100	251,256.00	0.08
396	002913	奥士康	3,900	249,366.00	0.08
397	688489	三未信安	10,980	249,246.00	0.08
398	688531	日联科技	1,400	248,976.00	0.08
399	688362	甬矽电子	2,581	248,808.40	0.08
400	301280	珠城科技	4,900	247,793.00	0.08
401	000709	河钢股份	126,500	245,410.00	0.08

402	301382	蜂助手	5,300	243,800.00	0.08
403	600498	烽火通信	3,300	242,880.00	0.08
404	301526	国际复材	5,200	242,684.00	0.08
405	688385	复旦微电	3,400	242,386.00	0.08
406	300801	泰和科技	7,500	242,250.00	0.08
407	300164	通源石油	30,200	241,600.00	0.08
408	600941	中国移动	2,800	241,164.00	0.08
409	301188	力诺药包	3,600	240,840.00	0.08
410	600141	兴发集团	5,100	239,547.00	0.08
411	688545	兴福电子	1,800	239,508.00	0.08
412	688209	英集芯	8,200	238,456.00	0.08
413	002643	万润股份	11,300	236,735.00	0.08
414	300970	华绿生物	12,950	236,726.00	0.08
415	300919	中伟新材	5,400	236,250.00	0.08
416	002517	恺英网络	14,500	235,625.00	0.08
417	001358	兴欣新材	9,100	235,144.00	0.08
418	000404	长虹华意	29,900	235,014.00	0.08
419	300891	惠云钛业	37,000	234,210.00	0.08
420	301307	美利信	3,100	233,399.00	0.08
421	601212	白银有色	45,500	231,140.00	0.07
422	300628	亿联网络	6,800	229,976.00	0.07
423	000893	亚钾国际	5,600	228,984.00	0.07
424	002353	杰瑞股份	1,500	228,750.00	0.07
425	000938	紫光股份	7,900	227,994.00	0.07
426	300395	菲利华	1,700	227,341.00	0.07
427	600329	达仁堂	6,100	227,042.00	0.07
428	002821	凯莱英	1,400	226,800.00	0.07
429	688757	胜科纳米	3,400	226,780.00	0.07
430	688371	菲沃泰	5,800	226,142.00	0.07
431	688472	阿特斯	20,600	222,892.00	0.07
432	002142	宁波银行	7,500	222,675.00	0.07

433	000810	创维数字	16,800	222,600.00	0.07
434	601038	一拖股份	21,000	222,390.00	0.07
435	002259	升达林业	58,300	220,957.00	0.07
436	002718	友邦吊顶	2,000	220,500.00	0.07
437	300602	飞荣达	4,300	220,160.00	0.07
438	002897	意华股份	2,500	219,950.00	0.07
439	603025	大豪科技	16,100	219,604.00	0.07
440	605007	五洲特纸	16,400	219,596.00	0.07
441	301607	富特科技	4,200	219,450.00	0.07
442	301021	英诺激光	1,800	219,420.00	0.07
443	600285	羚锐制药	11,300	218,994.00	0.07
444	603588	高能环境	11,400	218,880.00	0.07
445	300127	银河磁体	7,800	218,010.00	0.07
446	300765	石药创新	8,000	217,840.00	0.07
447	601997	贵阳银行	42,400	217,512.00	0.07
448	002851	麦格米特	1,300	217,334.00	0.07
449	002170	芭田股份	20,000	217,200.00	0.07
450	603341	龙旗科技	5,100	216,699.00	0.07
451	603933	睿能科技	9,600	216,480.00	0.07
452	601949	中国出版	46,500	216,225.00	0.07
453	302132	中航成飞	3,700	215,784.00	0.07
454	688719	爱科赛博	2,800	215,600.00	0.07
455	301356	天振股份	8,200	215,414.00	0.07
456	603013	亚普股份	13,600	214,744.00	0.07
457	001367	海森药业	11,600	213,788.00	0.07
458	600262	北方股份	10,800	213,732.00	0.07
459	601101	昊华能源	20,200	213,312.00	0.07
460	688249	晶合集成	3,600	212,508.00	0.07
461	688222	成都先导	6,600	211,926.00	0.07
462	600746	江苏索普	40,500	211,815.00	0.07
463	301535	浙江华远	15,734	211,150.28	0.07

464	601318	中国平安	4,400	210,056.00	0.07
465	301248	杰创智能	2,500	209,825.00	0.07
466	600598	北大荒	19,300	209,212.00	0.07
467	300388	节能国祯	33,900	209,163.00	0.07
468	301589	诺瓦星云	1,400	208,572.00	0.07
469	002466	天齐锂业	3,400	208,488.00	0.07
470	688103	国力电子	2,800	208,348.00	0.07
471	688388	嘉元科技	4,730	208,120.00	0.07
472	301018	申菱环境	1,800	208,098.00	0.07
473	603931	格林达	3,500	207,900.00	0.07
474	601108	财通证券	24,000	207,600.00	0.07
475	301237	和顺科技	2,800	207,424.00	0.07
476	000923	河钢资源	16,700	207,247.00	0.07
477	688556	高测股份	15,600	207,168.00	0.07
478	300959	线上线下	1,400	206,934.00	0.07
479	000519	中兵红箭	9,800	206,486.00	0.07
480	000685	中山公用	18,500	206,460.00	0.07
481	688168	安博通	3,000	206,250.00	0.07
482	688200	华峰测控	392	205,839.20	0.07
483	688099	晶晨股份	2,000	205,800.00	0.07
484	002511	中顺洁柔	30,900	205,485.00	0.07
485	300867	圣元环保	11,300	204,756.00	0.07
486	002557	洽洽食品	11,400	204,744.00	0.07
487	601360	三六零	23,500	204,215.00	0.07
488	603083	剑桥科技	800	203,896.00	0.07
489	301397	溯联股份	6,300	203,868.00	0.07
490	301201	诚达药业	5,600	203,616.00	0.07
491	600601	方正科技	14,700	203,448.00	0.07
492	301093	华兰股份	1,500	203,445.00	0.07
493	300752	隆利科技	15,100	203,397.00	0.07
494	300843	胜蓝股份	1,300	203,125.00	0.07

495	600153	建发股份	25,600	203,008.00	0.07
496	001359	平安电工	1,610	201,652.50	0.07
497	002402	和而泰	7,800	201,474.00	0.07
498	301395	仁信新材	15,300	201,195.00	0.06
499	300939	秋田微	2,900	200,680.00	0.06
500	301602	超研股份	14,600	200,604.00	0.06
501	002458	益生股份	25,720	199,844.40	0.06
502	002115	三维通信	19,400	199,820.00	0.06
503	000778	新兴铸管	53,800	199,598.00	0.06
504	000630	铜陵有色	31,100	197,796.00	0.06
505	300779	惠城环保	3,940	197,788.00	0.06
506	300751	迈为股份	700	197,722.00	0.06
507	688398	赛特新材	7,600	196,916.00	0.06
508	002922	伊戈尔	6,000	196,800.00	0.06
509	600985	淮北矿业	14,000	196,700.00	0.06
510	301662	宏工科技	1,940	196,560.80	0.06
511	301165	锐捷网络	2,440	196,298.00	0.06
512	603819	神力股份	17,100	195,795.00	0.06
513	688390	固德威	1,800	195,318.00	0.06
514	600714	金瑞矿业	9,500	195,035.00	0.06
515	301578	辰奕智能	9,560	194,928.40	0.06
516	000166	申万宏源	44,300	194,920.00	0.06
517	688299	长阳科技	11,600	193,836.00	0.06
518	600029	南方航空	37,300	193,214.00	0.06
519	603019	中科曙光	1,800	193,014.00	0.06
520	688001	华兴源创	2,251	192,910.70	0.06
521	688408	中信博	6,000	192,900.00	0.06
522	300733	西菱动力	16,100	192,395.00	0.06
523	300151	昌红科技	7,700	192,115.00	0.06
524	002918	蒙娜丽莎	19,100	191,955.00	0.06
525	000034	神州数码	6,860	190,365.00	0.06

526	601198	东兴证券	14,000	190,260.00	0.06
527	300382	斯莱克	8,200	189,502.00	0.06
528	603380	易德龙	4,200	189,378.00	0.06
529	600104	上汽集团	19,400	189,344.00	0.06
530	301026	浩通科技	9,300	188,046.00	0.06
531	000935	四川双马	7,200	187,848.00	0.06
532	688375	国博电子	1,800	187,740.00	0.06
533	300856	科思股份	17,500	186,550.00	0.06
534	002531	天顺风能	22,100	186,303.00	0.06
535	601872	招商轮船	10,600	186,242.00	0.06
536	301191	菲菱科思	1,640	186,222.00	0.06
537	600309	万华化学	2,700	184,707.00	0.06
538	301279	金道科技	8,500	184,705.00	0.06
539	002415	海康威视	5,400	184,680.00	0.06
540	000988	华工科技	1,000	184,610.00	0.06
541	000524	岭南控股	20,600	184,370.00	0.06
542	600663	陆家嘴	29,300	184,004.00	0.06
543	605008	长鸿高科	16,500	183,315.00	0.06
544	300976	达瑞电子	2,300	183,195.00	0.06
545	300684	中石科技	3,000	183,000.00	0.06
546	600026	中远海能	10,200	182,988.00	0.06
547	600918	中泰证券	34,200	181,944.00	0.06
548	605218	伟时电子	11,000	181,830.00	0.06
549	603070	万控智造	14,400	181,152.00	0.06
550	688348	昱能科技	5,200	180,856.00	0.06
551	601825	沪农商行	24,100	180,509.00	0.06
552	002655	共达电声	3,900	179,400.00	0.06
553	301386	未来电器	8,700	179,307.00	0.06
554	688061	灿瑞科技	3,600	178,812.00	0.06
555	002683	广东宏大	6,100	178,669.00	0.06
556	002484	江海股份	1,700	178,500.00	0.06

557	600483	福能股份	17,400	177,306.00	0.06
558	605168	三人行	3,500	177,240.00	0.06
559	601225	陕西煤业	8,700	177,045.00	0.06
560	603496	恒为科技	7,700	176,946.00	0.06
561	600061	国投资本	27,000	176,850.00	0.06
562	603355	莱克电气	6,700	176,746.00	0.06
563	300910	瑞丰新材	6,300	176,652.00	0.06
564	600050	中国联通	44,100	176,400.00	0.06
565	300543	朗科智能	24,400	175,924.00	0.06
566	301376	致欧科技	9,900	175,428.00	0.06
567	000059	华锦股份	46,600	174,750.00	0.06
568	002155	湖南黄金	7,300	174,251.00	0.06
569	002660	茂硕电源	26,700	173,550.00	0.06
570	688819	天能股份	7,800	173,160.00	0.06
571	601816	京沪高铁	38,200	173,046.00	0.06
572	300432	富临精工	8,600	172,774.00	0.06
573	600259	中稀有有色	1,700	172,737.00	0.06
574	301636	泽润新能	4,100	172,651.00	0.06
575	688776	国光电气	2,800	171,752.00	0.06
576	601898	中煤能源	14,100	171,738.00	0.06
577	300625	三雄极光	18,900	171,612.00	0.06
578	603166	福达股份	12,800	171,136.00	0.06
579	002850	科达利	900	170,370.00	0.06
580	300787	海能实业	18,600	169,632.00	0.05
581	603950	长源东谷	2,000	168,860.00	0.05
582	300772	运达股份	13,700	168,510.00	0.05
583	603533	掌阅科技	8,300	168,407.00	0.05
584	301199	迈赫股份	9,600	167,424.00	0.05
585	603568	伟明环保	10,880	167,334.40	0.05
586	600764	中国海防	9,600	167,328.00	0.05
587	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.05

588	300982	苏文电能	11,000	166,210.00	0.05
589	002335	科华数据	3,915	166,191.75	0.05
590	603306	华懋科技	1,600	165,904.00	0.05
591	301056	森赫股份	14,800	165,760.00	0.05
592	301362	民爆光电	900	165,528.00	0.05
593	603658	安图生物	5,700	165,414.00	0.05
594	002355	兴民智通	38,400	165,120.00	0.05
595	601998	中信银行	23,800	164,934.00	0.05
596	000534	万泽股份	6,000	164,160.00	0.05
597	600118	中国卫星	2,000	164,100.00	0.05
598	605011	杭州热电	10,600	163,876.00	0.05
599	601166	兴业银行	9,800	162,288.00	0.05
600	002056	横店东磁	5,300	161,544.00	0.05
601	002534	西子洁能	8,700	161,385.00	0.05
602	301550	斯菱智驱	1,760	160,916.80	0.05
603	301215	中汽股份	31,000	160,890.00	0.05
604	300677	英科医疗	4,100	160,597.00	0.05
605	300922	天秦装备	10,600	160,590.00	0.05
606	603577	汇金通	17,000	160,140.00	0.05
607	301548	崇德科技	1,800	159,786.00	0.05
608	601601	中国太保	5,600	159,712.00	0.05
609	300573	兴齐眼药	3,900	158,964.00	0.05
610	688579	地纬智能	20,800	157,872.00	0.05
611	002034	旺能环境	10,400	157,560.00	0.05
612	301666	大普微	340	157,532.20	0.05
613	688332	中科蓝讯	1,000	157,500.00	0.05
614	688529	豪森智能	10,000	157,300.00	0.05
615	688598	金博股份	3,179	157,201.55	0.05
616	603289	泰瑞机器	19,400	156,558.00	0.05
617	605339	南侨食品	13,100	156,414.00	0.05
618	688119	中钢洛耐	32,800	155,800.00	0.05

619	688010	福光股份	3,200	155,616.00	0.05
620	300174	元力股份	5,300	154,866.00	0.05
621	600613	神奇制药	34,700	154,068.00	0.05
622	301050	雷电微力	4,600	153,824.00	0.05
623	300553	集智股份	2,500	153,475.00	0.05
624	001322	箭牌家居	25,400	153,416.00	0.05
625	600919	江苏银行	14,200	153,076.00	0.05
626	600469	风神股份	28,100	152,864.00	0.05
627	300882	万胜智能	9,200	152,536.00	0.05
628	301009	可靠股份	18,500	151,145.00	0.05
629	002615	哈尔斯	21,900	151,110.00	0.05
630	301172	君逸数码	5,800	150,510.00	0.05
631	601319	中国人保	22,200	150,072.00	0.05
632	603538	美诺华	4,600	149,730.00	0.05
633	603737	三棵树	6,200	149,420.00	0.05
634	688019	安集科技	440	149,362.40	0.05
635	300817	双飞集团	9,500	148,200.00	0.05
636	002242	九阳股份	18,800	147,768.00	0.05
637	603659	璞泰来	5,100	147,543.00	0.05
638	002380	科远智慧	4,300	146,974.00	0.05
639	600352	浙江龙盛	12,100	146,531.00	0.05
640	600158	中体产业	21,700	146,258.00	0.05
641	301277	新天地	16,700	146,125.00	0.05
642	300753	爱朋医疗	7,700	145,761.00	0.05
643	003018	金富科技	1,900	144,837.00	0.05
644	603228	景旺电子	2,000	144,820.00	0.05
645	601728	中国电信	27,900	144,801.00	0.05
646	688709	成都华微	3,800	144,742.00	0.05
647	301100	风光股份	10,400	144,560.00	0.05
648	000967	盈峰环境	13,700	144,261.00	0.05
649	601118	海南橡胶	29,300	144,156.00	0.05

650	000830	鲁西化工	12,000	144,000.00	0.05
651	688596	正帆科技	1,800	142,308.00	0.05
652	300735	光弘科技	6,200	140,988.00	0.05
653	002671	龙泉股份	37,900	140,609.00	0.05
654	300624	万兴科技	2,700	140,049.00	0.05
655	601126	四方股份	2,200	139,040.00	0.04
656	301389	隆扬电子	1,600	138,864.00	0.04
657	601156	东航物流	8,600	138,632.00	0.04
658	688336	三生国健	2,610	138,591.00	0.04
659	001217	华尔泰	16,400	138,252.00	0.04
660	600345	长江通信	2,100	137,571.00	0.04
661	688088	虹软科技	3,863	137,329.65	0.04
662	600325	华发股份	59,300	136,983.00	0.04
663	688433	华曙高科	1,600	136,960.00	0.04
664	000058	深赛格	22,200	136,308.00	0.04
665	300229	拓尔思	9,800	135,436.00	0.04
666	000555	神州信息	13,100	134,930.00	0.04
667	688588	凌志软件	14,800	134,532.00	0.04
668	300781	因赛集团	5,100	134,436.00	0.04
669	002064	华峰化学	14,000	132,860.00	0.04
670	000029	深深房A	6,000	132,300.00	0.04
671	603605	珀莱雅	2,200	131,824.00	0.04
672	601665	齐鲁银行	22,800	131,556.00	0.04
673	000848	承德露露	17,700	130,980.00	0.04
674	301095	广立微	1,100	129,855.00	0.04
675	002852	道道全	18,300	129,747.00	0.04
676	301187	欧圣电气	9,000	128,790.00	0.04
677	600489	中金黄金	7,100	128,155.00	0.04
678	300383	光环新网	10,300	128,132.00	0.04
679	002506	协鑫集成	39,900	126,882.00	0.04
680	000017	深中华A	20,700	126,684.00	0.04

681	002624	完美世界	10,100	125,442.00	0.04
682	300489	光智科技	400	124,780.00	0.04
683	600219	南山铝业	31,200	124,488.00	0.04
684	001248	华润新能源	12,223	123,574.53	0.04
685	300140	节能环境	24,800	123,256.00	0.04
686	688520	神州细胞	3,600	123,156.00	0.04
687	300676	华大基因	3,500	122,710.00	0.04
688	600511	国药股份	4,700	122,388.00	0.04
689	002745	木林森	9,700	121,735.00	0.04
690	002923	润都股份	12,800	121,088.00	0.04
691	000905	厦门港务	15,600	121,056.00	0.04
692	300514	友讯达	12,900	120,615.00	0.04
693	002152	广电运通	12,800	120,064.00	0.04
694	600497	驰宏锌锗	9,900	119,889.00	0.04
695	600754	锦江酒店	6,600	118,734.00	0.04
696	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.04
697	603858	步长制药	8,100	118,260.00	0.04
698	300805	电声股份	16,200	117,450.00	0.04
699	300496	中科创达	1,900	117,401.00	0.04
700	688232	新点软件	6,600	117,348.00	0.04
700	600316	洪都航空	4,200	117,348.00	0.04
701	000877	天山股份	32,300	117,249.00	0.04
702	603688	石英股份	1,400	115,654.00	0.04
703	301392	汇成真空	400	115,456.00	0.04
704	300248	新开普	14,900	114,879.00	0.04
705	688475	萤石网络	4,200	114,870.00	0.04
706	600295	鄂尔多斯	10,700	114,704.00	0.04
707	600722	金牛化工	14,100	114,492.00	0.04
708	600563	法拉电子	600	114,480.00	0.04
709	600595	中孚实业	20,300	114,086.00	0.04
710	301338	凯格精机	700	114,023.00	0.04

711	603682	锦和商管	15,300	113,220.00	0.04
712	600292	电投水电	9,400	113,176.00	0.04
713	002970	锐明技术	2,100	112,203.00	0.04
714	603816	顾家家居	5,000	111,800.00	0.04
715	600208	衢州发展	39,500	111,785.00	0.04
716	601865	福莱特	10,600	111,406.00	0.04
717	002772	众兴菌业	9,700	110,192.00	0.04
718	603728	鸣志电器	1,800	109,656.00	0.04
719	301498	乖宝宠物	2,700	109,593.00	0.04
720	002129	TCL中环	9,100	109,382.00	0.04
721	003043	华亚智能	1,100	109,329.00	0.04
722	601869	长飞光纤	200	109,180.00	0.04
723	605358	立昂微	1,400	108,640.00	0.04
724	603678	火炬电子	1,300	107,900.00	0.03
725	688507	索辰科技	400	107,872.00	0.03
726	601567	三星电气	7,200	107,568.00	0.03
727	300709	精研科技	1,900	106,875.00	0.03
728	002996	顺博合金	18,100	106,790.00	0.03
729	300139	晓程科技	2,900	105,995.00	0.03
730	300748	金力永磁	3,400	104,890.00	0.03
731	001221	悍高集团	2,600	104,572.00	0.03
732	601717	中创智领	7,500	104,325.00	0.03
733	600392	盛和资源	3,500	104,195.00	0.03
734	300985	致远新能	2,700	103,950.00	0.03
735	000552	甘肃能化	46,400	103,936.00	0.03
736	600288	大恒科技	7,800	103,740.00	0.03
737	301281	科源制药	2,100	103,530.00	0.03
738	603297	永新光学	700	102,865.00	0.03
739	002905	金逸影视	15,200	102,600.00	0.03
740	301052	果麦文化	4,600	102,212.00	0.03
741	688235	百济神州	400	101,844.00	0.03

742	000598	兴蓉环境	15,800	101,436.00	0.03
743	600637	东方明珠	12,200	101,382.00	0.03
744	300951	博硕科技	2,000	101,000.00	0.03
745	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.03
746	300806	斯迪克	900	100,800.00	0.03
747	603267	鸿远电子	1,300	100,724.00	0.03
748	600160	巨化股份	1,900	100,719.00	0.03
749	300249	依米康	6,500	100,100.00	0.03
750	300442	润泽科技	1,200	99,684.00	0.03
751	000949	新乡化纤	15,700	99,538.00	0.03
752	002156	通富微电	1,300	98,631.00	0.03
753	600418	江淮汽车	3,800	98,154.00	0.03
754	002460	赣锋锂业	1,500	98,100.00	0.03
755	301251	威尔高	1,820	96,969.60	0.03
756	002824	和胜股份	2,800	96,824.00	0.03
757	603087	甘李药业	1,700	96,492.00	0.03
758	301003	江苏博云	1,800	96,300.00	0.03
759	601399	国机重装	27,400	95,900.00	0.03
760	600660	福耀玻璃	1,900	95,836.00	0.03
761	002601	龙佰集团	5,800	95,584.00	0.03
762	688281	华秦科技	1,902	95,537.46	0.03
763	601858	中国科传	5,500	95,205.00	0.03
764	000959	首钢股份	27,100	95,121.00	0.03
765	000932	华菱钢铁	27,400	95,078.00	0.03
766	601228	广州港	33,400	94,188.00	0.03
767	688685	迈信林	1,708	93,769.20	0.03
768	300700	岱勒新材	4,400	93,632.00	0.03
769	300559	佳发教育	9,100	93,093.00	0.03
770	688768	容知日新	1,800	92,772.00	0.03
771	301002	崧盛股份	2,400	92,640.00	0.03
772	688410	山外山	6,400	91,904.00	0.03

773	688035	德邦科技	1,000	91,800.00	0.03
774	300433	蓝思科技	1,700	91,222.00	0.03
775	603936	博敏电子	3,400	90,814.00	0.03
776	601099	太平洋	26,900	90,653.00	0.03
777	688599	天合光能	6,400	90,368.00	0.03
778	603186	华正新材	400	90,120.00	0.03
779	300633	开立医疗	4,900	90,111.00	0.03
780	601618	中国中冶	36,900	90,036.00	0.03
781	000576	甘化科工	13,700	90,009.00	0.03
782	688153	唯捷创芯	2,800	89,936.00	0.03
783	002297	博云新材	3,100	89,869.00	0.03
784	301568	思泰克	800	89,280.00	0.03
785	301631	壹连科技	1,240	89,106.40	0.03
786	688808	联讯仪器	56	88,722.48	0.03
787	301160	翔楼新材	1,900	88,635.00	0.03
788	301239	普瑞眼科	2,900	88,305.00	0.03
789	300491	通合科技	2,300	87,837.00	0.03
790	603000	人民网	5,900	87,261.00	0.03
791	301365	矩阵股份	2,300	87,193.00	0.03
792	600583	海油工程	17,300	87,019.00	0.03
793	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.03
794	000878	云南铜业	5,400	85,752.00	0.03
795	603501	豪威集团	900	85,365.00	0.03
796	601577	长沙银行	9,800	85,358.00	0.03
797	300563	神宇股份	3,000	85,170.00	0.03
798	002299	圣农发展	5,600	84,896.00	0.03
799	688425	铁建重工	21,000	84,420.00	0.03
800	688253	英诺特	1,400	84,392.00	0.03
801	600655	豫园股份	20,300	83,433.00	0.03
802	688205	德科立	400	83,276.00	0.03
803	300183	东软载波	7,800	81,510.00	0.03

804	603833	欧派家居	2,700	81,297.00	0.03
805	000983	山西焦煤	13,900	80,620.00	0.03
806	301305	朗坤科技	2,800	79,856.00	0.03
807	300001	特锐德	2,100	79,443.00	0.03
808	600885	宏发股份	2,300	79,327.00	0.03
809	600380	健康元	8,400	79,128.00	0.03
810	300881	盛德鑫泰	2,100	78,645.00	0.03
811	600335	国机汽车	16,800	78,624.00	0.03
812	600716	凤凰股份	23,300	78,288.00	0.03
813	601818	光大银行	27,000	78,030.00	0.03
814	688255	凯尔达	2,800	77,840.00	0.03
815	603786	科博达	1,900	77,729.00	0.03
816	002244	滨江集团	10,200	77,520.00	0.03
817	600925	苏能股份	19,300	77,393.00	0.03
818	601186	中国铁建	13,000	77,350.00	0.02
819	600098	广州发展	13,000	76,830.00	0.02
820	002294	信立泰	2,400	76,536.00	0.02
821	002202	金风科技	3,200	76,480.00	0.02
822	601988	中国银行	13,300	76,076.00	0.02
823	601137	博威合金	3,400	75,922.00	0.02
824	601117	中国化学	10,300	75,705.00	0.02
825	688658	悦康药业	5,800	74,588.00	0.02
826	600177	雅戈尔	9,800	73,794.00	0.02
827	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.02
828	688617	惠泰医疗	400	72,624.00	0.02
829	688558	国盛智科	2,200	72,292.00	0.02
830	688267	中触媒	3,640	71,708.00	0.02
831	603589	口子窖	3,800	70,984.00	0.02
832	000021	深科技	1,100	70,697.00	0.02
833	603680	今创集团	7,200	70,632.00	0.02
834	002443	金洲管道	7,400	70,522.00	0.02

835	603867	新化股份	2,100	70,329.00	0.02
836	002131	利欧股份	14,800	70,300.00	0.02
837	000977	浪潮信息	1,000	70,000.00	0.02
838	603885	吉祥航空	6,800	69,972.00	0.02
839	688276	百克生物	5,000	69,700.00	0.02
840	000828	东莞控股	7,400	69,264.00	0.02
841	300017	网宿科技	5,300	68,953.00	0.02
842	603650	彤程新材	700	68,586.00	0.02
843	600299	安迪苏	8,700	68,295.00	0.02
844	603338	浙江鼎力	1,600	68,000.00	0.02
845	002756	永兴材料	1,200	67,968.00	0.02
846	600938	中国海油	2,500	67,875.00	0.02
847	688208	道通科技	2,684	67,609.96	0.02
848	600673	东阳光	2,000	67,160.00	0.02
849	301580	爱迪特	1,040	66,903.20	0.02
850	301057	汇隆新材	2,900	66,700.00	0.02
851	300828	锐新科技	3,300	66,627.00	0.02
852	002472	双环传动	1,600	66,416.00	0.02
853	002130	沃尔核材	3,500	66,360.00	0.02
854	601918	新集能源	7,700	66,143.00	0.02
855	301221	光庭信息	2,240	66,102.40	0.02
856	002670	国盛证券	6,000	66,000.00	0.02
857	301489	思泉新材	400	65,832.00	0.02
858	603806	福斯特	3,900	65,481.00	0.02
859	600256	广汇能源	13,200	65,208.00	0.02
859	002483	润邦股份	13,200	65,208.00	0.02
860	300003	乐普医疗	5,500	65,175.00	0.02
861	603400	华之杰	1,200	64,824.00	0.02
862	300616	尚品宅配	6,200	64,604.00	0.02
863	002945	华林证券	4,800	64,464.00	0.02
864	600602	云赛智联	4,000	64,320.00	0.02

865	601666	平煤股份	8,900	63,635.00	0.02
866	600348	华阳股份	8,300	63,495.00	0.02
867	605198	安德利	1,000	63,360.00	0.02
868	000937	冀中能源	15,800	62,884.00	0.02
869	600282	南钢股份	13,700	62,883.00	0.02
870	603298	杭叉集团	2,600	62,036.00	0.02
871	300285	国瓷材料	600	61,908.00	0.02
872	603290	斯达半导	400	61,176.00	0.02
873	601608	中信重工	12,800	61,056.00	0.02
874	600872	中炬高新	3,500	60,760.00	0.02
875	002284	亚太股份	6,400	60,736.00	0.02
876	300905	宝丽迪	1,200	60,720.00	0.02
877	688677	海泰新光	600	60,678.00	0.02
878	000027	深圳能源	9,700	60,140.00	0.02
879	300991	创益通	1,700	59,857.00	0.02
880	601598	中国外运	11,800	58,528.00	0.02
881	002410	广联达	7,100	57,936.00	0.02
882	301121	紫建电子	1,800	57,636.00	0.02
883	300711	广哈通信	3,500	57,400.00	0.02
884	300310	宜通世纪	13,700	57,129.00	0.02
885	600391	航发科技	1,700	56,865.00	0.02
886	000733	振华科技	1,000	56,640.00	0.02
887	688484	南芯科技	1,000	56,490.00	0.02
888	600066	宇通客车	2,100	56,301.00	0.02
889	000883	湖北能源	13,000	56,160.00	0.02
890	688239	航宇科技	937	56,060.71	0.02
891	603160	汇顶科技	900	55,539.00	0.02
892	600906	财达证券	7,400	55,204.00	0.02
893	600562	国睿科技	2,600	55,172.00	0.02
894	601019	山东出版	8,600	55,040.00	0.02
895	688682	霍莱沃	1,400	54,460.00	0.02

896	002887	绿茵生态	5,200	54,444.00	0.02
897	300474	景嘉微	900	54,432.00	0.02
898	002403	爱仕达	6,100	54,412.00	0.02
899	301611	珂玛科技	300	54,021.00	0.02
900	301301	川宁生物	6,800	53,992.00	0.02
901	300450	先导智能	1,300	52,936.00	0.02
902	600189	泉阳泉	7,000	52,710.00	0.02
903	301265	华新科技	1,900	52,345.00	0.02
904	688331	荣昌生物	400	52,104.00	0.02
905	600166	福田汽车	17,800	51,798.00	0.02
906	688449	联芸科技	600	51,786.00	0.02
906	600737	中粮糖业	4,200	51,786.00	0.02
907	002595	豪迈科技	1,100	51,260.00	0.02
908	000738	航发控制	2,800	51,212.00	0.02
909	601333	广深铁路	18,600	51,150.00	0.02
910	002857	三晖电气	2,900	50,953.00	0.02
911	605589	圣泉集团	800	50,856.00	0.02
912	603373	安邦护卫	1,400	50,736.00	0.02
913	300146	汤臣倍健	5,600	50,624.00	0.02
914	688818	电科蓝天	721	50,570.94	0.02
915	000831	中国稀土	900	49,941.00	0.02
916	002126	银轮股份	1,000	49,800.00	0.02
917	600113	浙江东日	1,500	49,770.00	0.02
918	600699	均胜电子	2,300	49,703.00	0.02
919	300656	民德电子	1,300	49,517.00	0.02
920	688820	盛合晶微	349	49,380.01	0.02
921	002773	康弘药业	2,400	49,080.00	0.02
922	002736	国信证券	4,900	48,951.00	0.02
923	600998	九州通	10,400	48,776.00	0.02
924	600612	老凤祥	1,500	48,225.00	0.02
925	605499	东鹏饮料	390	48,137.70	0.02

926	688726	拉普拉斯	904	47,776.40	0.02
927	301595	太力科技	1,200	47,520.00	0.02
928	603326	我乐家居	7,700	47,432.00	0.02
929	300213	佳讯飞鸿	7,800	47,268.00	0.02
930	600011	华能国际	6,200	47,058.00	0.02
931	002265	建设工业	2,700	46,980.00	0.02
932	600694	大商股份	3,520	46,569.60	0.02
933	002290	禾盛新材	500	45,935.00	0.01
934	301600	慧翰股份	500	45,700.00	0.01
935	300840	酷特智能	2,200	45,386.00	0.01
936	601799	星宇股份	500	45,310.00	0.01
937	600004	白云机场	6,200	45,012.00	0.01
938	000301	东方盛虹	3,900	44,655.00	0.01
939	300957	贝泰妮	1,400	44,114.00	0.01
940	002074	国轩高科	1,600	44,016.00	0.01
941	600707	彩虹股份	2,600	43,914.00	0.01
942	002573	清新环境	14,800	43,512.00	0.01
943	601139	深圳燃气	7,600	43,016.00	0.01
944	600415	小商品城	4,200	42,672.00	0.01
945	300199	翰宇药业	1,900	41,952.00	0.01
946	002340	格林美	6,300	41,643.00	0.01
947	603296	华勤技术	560	41,591.20	0.01
948	600009	上海机场	1,800	41,580.00	0.01
949	002397	梦洁股份	10,800	41,256.00	0.01
950	600535	天士力	3,100	41,013.00	0.01
951	600021	上海电力	2,700	40,689.00	0.01
952	603233	大参林	2,700	40,581.00	0.01
953	600566	济川药业	1,800	39,942.00	0.01
954	600095	湘财股份	5,300	39,909.00	0.01
955	603319	美湖股份	1,200	39,852.00	0.01
956	301590	优优绿能	300	39,435.00	0.01

957	603116	红蜻蜓	6,900	39,192.00	0.01
958	603893	瑞芯微	200	37,672.00	0.01
959	301682	宏明电子	233	37,293.98	0.01
960	688712	北芯生命	1,017	36,530.64	0.01
961	688635	长进光子	118	36,366.42	0.01
962	300911	亿田智能	1,700	36,125.00	0.01
963	002939	长城证券	4,300	35,862.00	0.01
964	301173	毓恬冠佳	1,200	35,652.00	0.01
965	600486	扬农化工	700	35,490.00	0.01
966	601991	大唐发电	5,000	35,400.00	0.01
967	688758	赛分科技	1,600	35,216.00	0.01
968	688234	天岳先进	200	34,702.00	0.01
969	600008	首创环保	12,700	34,544.00	0.01
970	605318	法狮龙	300	33,858.00	0.01
971	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.01
972	002195	岩山科技	5,100	33,354.00	0.01
973	688179	阿拉丁	1,200	33,252.00	0.01
974	600038	中直股份	1,300	32,877.00	0.01
975	688813	泰金新能	187	32,180.83	0.01
976	300803	指南针	350	32,084.50	0.01
977	002831	裕同科技	900	32,004.00	0.01
978	601021	春秋航空	700	31,906.00	0.01
979	600688	上海石化	10,800	31,644.00	0.01
980	601677	明泰铝业	1,900	31,540.00	0.01
981	603077	和邦生物	13,500	31,320.00	0.01
982	600032	浙江新能	4,400	31,020.00	0.01
983	600035	楚天高速	8,900	29,993.00	0.01
984	000728	国元证券	4,000	29,960.00	0.01
985	001365	天海电子	794	29,294.59	0.01
986	688785	恒运昌	62	28,715.30	0.01
987	600970	中材国际	3,700	26,381.00	0.01

988	003021	兆威机电	300	26,205.00	0.01
989	300916	朗特智能	1,100	25,707.00	0.01
990	601958	金钼股份	900	25,299.00	0.01
991	600871	石化油服	12,400	25,172.00	0.01
992	000088	盐田港	6,100	24,949.00	0.01
993	688220	翱捷科技	200	24,864.00	0.01
994	300251	光线传媒	2,200	24,398.00	0.01
995	001212	中旗新材	500	23,690.00	0.01
996	000559	万向钱潮	1,800	23,274.00	0.01
997	300281	金明精机	3,800	22,914.00	0.01
998	001696	宗申动力	1,100	22,891.00	0.01
999	688781	视涯科技	478	22,757.58	0.01
100 0	000423	东阿阿胶	500	22,680.00	0.01
100 1	688710	益诺思	332	22,310.40	0.01
100 2	688278	特宝生物	400	21,760.00	0.01
100 3	601965	中国汽研	1,800	21,528.00	0.01
100 4	688213	思特威	200	21,414.00	0.01
100 5	001257	盛龙股份	1,028	21,320.72	0.01
100 6	002044	美年健康	4,200	21,126.00	0.01
100 7	600027	华电国际	4,700	20,915.00	0.01
100 8	600132	重庆啤酒	500	20,650.00	0.01
100 9	601456	国联民生	2,300	20,332.00	0.01
101 0	603596	伯特利	792	19,673.28	0.01

101 1	002318	久立特材	800	19,120.00	0.01
101 2	600977	中国电影	1,400	18,088.00	0.01
101 3	600578	京能电力	2,800	18,060.00	0.01
101 4	601000	唐山港	4,200	17,430.00	0.01
101 5	300627	华测导航	600	17,040.00	0.01
101 6	301468	博盈特焊	390	16,266.90	0.01
101 7	000729	燕京啤酒	1,600	16,208.00	0.01
101 8	600062	华润双鹤	1,000	16,040.00	0.01
101 9	601236	红塔证券	2,300	15,686.00	0.01
102 0	000951	中国重汽	800	15,608.00	0.01
102 1	300866	安克创新	140	14,630.00	0.00
102 2	600816	建元信托	5,700	13,908.00	0.00
102 3	688187	时代电气	200	13,732.00	0.00
102 4	301531	春光集团	264	13,611.84	0.00
102 5	300144	宋城演艺	2,200	12,782.00	0.00
102 6	301696	三瑞智能	142	12,325.60	0.00
102 7	301687	新广益	150	11,667.00	0.00
102 8	600848	上海临港	1,400	10,486.00	0.00

102 9	688805	健信超导	219	10,286.43	0.00
103 0	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
103 1	301680	固德电材	84	9,421.44	0.00
103 2	301599	理奇智能	280	9,091.60	0.00
103 3	688192	迪哲医药	200	7,986.00	0.00
103 4	601808	中海油服	700	7,567.00	0.00
103 5	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
103 6	301609	山大电力	210	6,974.10	0.00
103 7	001393	维通利	168	6,550.32	0.00
103 8	002608	江苏国信	900	6,210.00	0.00
103 9	688816	易思维	99	5,652.90	0.00
104 0	001237	惠康科技	96	5,639.04	0.00
104 1	688561	奇安信	200	4,796.00	0.00
104 2	301539	宏鑫科技	361	4,729.10	0.00
104 3	603004	鼎龙科技	195	4,697.55	0.00
104 4	601112	振石股份	227	3,992.93	0.00
104 5	603418	友升股份	53	2,341.01	0.00
104 6	603406	天富龙	68	1,764.60	0.00

1047	603352	至信股份	64	1,633.28	0.00
1048	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
1049	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
1050	001312	福恩股份	83	1,392.74	0.00
1051	603293	埃泰克	41	1,391.13	0.00
1052	400237	天通5	118,400	-	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	3,168,751.00	1.41
2	300502	新易盛	2,125,682.00	0.95
3	601899	紫金矿业	2,006,999.00	0.90
4	603986	兆易创新	1,809,986.00	0.81
5	688525	佰维存储	1,797,762.25	0.80
6	300972	万辰集团	1,772,833.00	0.79
7	300857	协创数据	1,728,342.00	0.77
8	300476	胜宏科技	1,666,771.31	0.74
9	603993	洛阳钼业	1,663,403.00	0.74
10	688002	睿创微纳	1,625,713.98	0.73
11	688025	杰普特	1,605,322.77	0.72
12	600030	中信证券	1,602,564.00	0.72
13	301377	鼎泰高科	1,601,266.00	0.71
14	688257	新锐股份	1,593,578.64	0.71

15	301536	星宸科技	1,545,501.00	0.69
16	000807	云铝股份	1,530,137.00	0.68
17	688630	芯碁微装	1,526,627.62	0.68
18	688498	源杰科技	1,510,931.94	0.67
19	600176	中国巨石	1,503,853.00	0.67
20	688188	柏楚电子	1,487,992.39	0.66

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	603629	利通电子	2,233,594.00	1.00
2	601899	紫金矿业	2,211,876.00	0.99
3	688525	佰维存储	2,117,434.22	0.94
4	603993	洛阳钼业	2,069,850.00	0.92
5	300857	协创数据	1,978,043.00	0.88
6	300308	中际旭创	1,954,896.00	0.87
7	601600	中国铝业	1,920,064.00	0.86
8	300750	宁德时代	1,907,693.00	0.85
9	300502	新易盛	1,856,740.00	0.83
10	600989	宝丰能源	1,765,114.00	0.79
11	600183	生益科技	1,750,758.00	0.78
12	688498	源杰科技	1,654,822.50	0.74
13	002463	沪电股份	1,590,932.00	0.71
14	002545	东方铁塔	1,562,227.00	0.70
15	301219	腾远钴业	1,555,905.50	0.69
16	300442	润泽科技	1,539,034.00	0.69
17	002384	东山精密	1,537,679.92	0.69
18	688183	生益电子	1,527,124.14	0.68
19	300389	艾比森	1,506,505.00	0.67

20	600176	中国巨石	1,484,402.00	0.66
----	--------	------	--------------	------

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	738,199,860.06
卖出股票收入（成交）总额	707,586,743.16

注：本项中7.4.1、7.4.2、7.4.3表中的"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	55,965.92	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	55,965.92	0.02

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	123272	中汽转债	235	36,965.21	0.01
2	113704	春风转债	110	11,000.51	0.00
3	118072	鼎通转债	50	5,000.15	0.00

4	111025	圣泉转债	20	2,000.03	0.00
5	118071	华峰转债	10	1,000.02	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	47,268.41
2	应收清算款	33,324.33
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	122,326.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	202,919.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
14,625	8,812.95	77,421,106.43	60.07%	51,468,294.80	39.93%

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	98.44%

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	1,094,931.44	0.85%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年06月01日)基金份额总额	847,544,853.76
本报告期期初基金份额总额	113,674,951.16
本报告期基金总申购份额	67,524,222.77
减：本报告期基金总赎回份额	52,309,772.70
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	128,889,401.23

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产的诉讼事项，且无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人高级管理人员及其他从业人员受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无重大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

本报告期内托管人相关从业人员无重大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	
金融街证券	2	810,461,933.55	56.10%	150,669.19	56.10%	-
东莞证券	2	249,445,379.40	17.27%	46,370.94	17.27%	-
第一	2	144,301,662.99	9.99%	26,825.10	9.99%	-

创业 证券						
申港 证券	2	122,552,230.88	8.48%	22,783.16	8.48%	-
国新 证券	2	117,933,983.99	8.16%	21,924.37	8.16%	-
渤海 证券	1	-	-	-	-	-
长江 证券	1	-	-	-	-	-
国泰 海通 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-
信达 证券	1	-	-	-	-	-
长城 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国投 证券	2	-	-	-	-	-
国信	2	-	-	-	-	-

证券						
华金 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
国联 民生 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-
甬兴 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- （1）本基金报告期内新增租用交易单元：无。
- （2）本基金报告期内停止租用交易单元：国金证券。

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
金融街证券	65,313.89	41.36%	-	-	-	-	-	-
东莞证券	16,236.04	10.28%	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	76,352.94	48.35%	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

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

1	泓德基金管理有限公司关于旗下基金参与北京汇成基金销售有限公司费率优惠活动的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-10
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加财信证券股份有限公司为销售机构并参与其费率优惠的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-20
3	泓德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	泓德基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司代销本公司旗下基金的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026/03/17-2026/04/27	21,267,015.44	-	-	21,267,015.44	16.50%
	2	2026/03/30,2026/04/01,2026/04/07-2026/04/27	20,775,298.62	-	-	20,775,298.62	16.12%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二六年八月二十九日