

中航中证智选均衡配置指数型发起式证券  
投资基金  
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 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。

基金托管人兴业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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 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                 | 9         |
| 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             | 10        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 10        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 11        |
| 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 | 11        |
| 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       | 11        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>12</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 12        |
| 6.2 利润表                                 | 13        |
| 6.3 净资产变动表                              | 14        |
| 6.4 报表附注                                | 16        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>38</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 38        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 38        |
| 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       | 39        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 60        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 62        |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细      | 62        |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细   | 62        |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细   | 62        |

|                                          |           |
|------------------------------------------|-----------|
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 ..... | 62        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                | 62        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....          | 62        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                      | 63        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>               | <b>63</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....              | 63        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....           | 64        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....   | 64        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                | 64        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>               | <b>65</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                 | <b>65</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                   | 65        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....   | 65        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....        | 66        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                     | 66        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....              | 66        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....       | 66        |
| 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 .....   | 66        |
| 10.8 其他重大事件 .....                        | 67        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>         | <b>68</b> |
| 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 ..... | 68        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                | 68        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                 | <b>69</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                        | 69        |
| 12.2 存放地点 .....                          | 69        |
| 12.3 查阅方式 .....                          | 69        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                        |                  |
|---------------------|------------------------|------------------|
| 基金名称                | 中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金 |                  |
| 基金简称                | 中航中证智选均衡配置指数发起         |                  |
| 基金主代码               | 022854                 |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式                 |                  |
| 基金合同生效日             | 2025 年 3 月 19 日        |                  |
| 基金管理人               | 中航基金管理有限公司             |                  |
| 基金托管人               | 兴业银行股份有限公司             |                  |
| 报告期末基金份<br>额总额      | 52,258,402.35 份        |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期                    |                  |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 中航中证智选均衡配置指数发起 A       | 中航中证智选均衡配置指数发起 C |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 022854                 | 022855           |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 17,284,445.54 份        | 34,973,956.81 份  |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金通过指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                           |
| 投资策略   | （一）大类资产配置（二）股票投资策略（三）债券投资策略（四）股指期货投资策略（五）国债期货投资策略（六）资产支持证券投资策略（七）存托凭证投资策略（八）可转换债券、可交换债券投资策略（九）参与融资及转融通证券出借业务策略 |
| 业绩比较基准 | 中证智选均衡配置指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%                                                                            |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。          |

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          |      | 中航基金管理有限公司                       | 兴业银行股份有限公司                 |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 宋鑫                               | 冯萌                         |
|             | 联系电话 | 010-56716167                     | 021-52629999-213310        |
|             | 电子邮箱 | songxin@avicfund.cn              | fengmeng@cib.com.cn        |
| 客户服务电话      |      | 400-666-2186                     | 95561                      |
| 传真          |      | 010-56716198                     | 021-62159217               |
| 注册地址        |      | 北京市石景山区五一剧场南路 2 号院 1 号楼 7 层 702E | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |

|       |                                                  |                      |
|-------|--------------------------------------------------|----------------------|
| 办公地址  | 北京市朝阳区天辰东路 1 号院亚洲金融大厦 D 座第 8 层<br>801/805/806 单元 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码  | 100101                                           | 200120               |
| 法定代表人 | 杨彦伟                                              | 吕家进                  |

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.avicfund.cn |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人及基金托管人住所   |

2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址                                                 |
|--------|------------|------------------------------------------------------|
| 注册登记机构 | 中航基金管理有限公司 | 北京市朝阳区天辰东路 1 号院<br>亚洲金融大厦 D 座第 8 层<br>801/805/806 单元 |

§ 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<br>据和指标   | 报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |                  |
|---------------------|-------------------------------------|------------------|
|                     | 中航中证智选均衡配置指数发起 A                    | 中航中证智选均衡配置指数发起 C |
| 本期已实现收益             | 1,355,040.58                        | 1,085,093.45     |
| 本期利润                | 3,651,270.97                        | 3,283,029.35     |
| 加权平均基金份<br>额本期利润    | 0.3085                              | 0.3253           |
| 本期加权平均净<br>值利润率     | 20.89%                              | 22.06%           |
| 本期基金份额净<br>值增长率     | 21.90%                              | 21.66%           |
| 3.1.2 期 末 数<br>据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日)               |                  |
|                     |                                     |                  |
| 期末可供分配利<br>润        | 4,706,377.61                        | 9,267,226.09     |
| 期末可供分配基<br>金份额利润    | 0.2723                              | 0.2650           |
| 期末基金资产净<br>值        | 28,500,164.41                       | 57,377,376.29    |

|              |                       |        |
|--------------|-----------------------|--------|
| 期末基金份额净值     | 1.6489                | 1.6406 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |        |
| 基金份额累计净值增长率  | 64.89%                | 64.06% |

注：①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。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述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。

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

中航中证智选均衡配置指数发起 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 21.91%   | 1.46%       | 22.02%     | 1.53%         | -0.11% | -0.07% |
| 过去六个月      | 21.90%   | 1.41%       | 23.00%     | 1.47%         | -1.10% | -0.06% |
| 过去一年       | 51.23%   | 1.24%       | 53.91%     | 1.28%         | -2.68% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 64.89%   | 1.12%       | 49.65%     | 1.28%         | 15.24% | -0.16% |

中航中证智选均衡配置指数发起 C

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③    | ②－④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | 21.80%   | 1.46%       | 22.02%     | 1.53%         | -0.22% | -0.07% |
| 过去六个月      | 21.66%   | 1.41%       | 23.00%     | 1.47%         | -1.34% | -0.06% |
| 过去一年       | 50.64%   | 1.24%       | 53.91%     | 1.28%         | -3.27% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 64.06%   | 1.12%       | 49.65%     | 1.28%         | 14.41% | -0.16% |

### 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

中航中证智选均衡配置指数发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中航中证智选均衡配置指数发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关规定。

## § 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

中航基金管理有限公司成立于 2016 年 6 月 16 日，是经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1249 号文许可批准设立、为客户提供专业基金管理服务的全国性基金管理公司。公司总部

设在北京，注册资本金为 30,000 万元人民币，经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

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 |        |                                                                                                                                                                                                                                       |
| 杨扬 | 本基金的基金经理 | 2025 年 3 月 19 日 | -    | 15 年   | 硕士研究生，具有 10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于上海东方证券资产管理有限公司担任研究员、投资助理、安信基金管理有限责任公司先后担任投资经理助理、投资经理、基金经理助理、基金经理。2020 年 2 月加入中航基金管理有限公司，现担任量化投资部基金经理。                                                                                              |
| 龙川 | 本基金的基金经理 | 2025 年 3 月 19 日 | -    | 16 年   | 统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部总经理，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。 |

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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》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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和

公司内部公平交易制度。在统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%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

2026 年上半年，A 股呈现“指数震荡上行、结构极致分化”格局：上证指数涨 3.16%，深证成指涨 19.82%，创业板指涨 35.58%，科创 50 大涨 64.25%。全市场资金高度向 AI 算力、半导体、通信设备、PCB 等硬科技产业链集中，电子、通信行业表现居前，消费、地产、金融及传统蓝筹相对偏弱，市场呈典型“K 型分化”。

本基金跟踪中证智选均衡配置指数，该指数以“便宜好股票”为成分股筛选的基本理念，并在沪深 300、中证 500、中证 1000 成分中均衡搭配，力求获取超越上述三条指数平均表现的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航中证智选均衡配置指数发起 A 基金份额净值为 1.6489 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.90%；截至本报告期末中航中证智选均衡配置指数发起 C 基金份额净值为 1.6406 元，本报告期基金份额净值增长率为 21.66%；同期业绩比较基准收益率为 23.00%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，A 股有望延续结构性行情，科技成长仍是市场关注的主线，景气度具备产业趋势支撑。不过经历上半年显著上涨，部分细分板块估值与交易拥挤度明显抬升，行情将从单纯的主题驱动逐步转向业绩兑现与验证，“去伪存真”成为关键。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基

金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由投资研究、交易、基金事务、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内，投资研究部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算公司，中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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

无。

### § 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

报告期内，本托管人严格遵守《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，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《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的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：        |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 1,085,441.00           | 1,184,275.88             |
| 结算备付金       |         | 4,920,405.09           | 632,756.34               |
| 存出保证金       |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 74,817,744.38          | 20,144,380.45            |
| 其中：股票投资     |         | 74,817,744.38          | 20,144,380.45            |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | -                      | -                        |
| 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 | -                      | -                        |
| 债权投资        | 6.4.7.5 | -                      | -                        |
| 其中：债券投资     |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 其他投资        |         | -                      | -                        |
| 其他债权投资      | 6.4.7.6 | -                      | -                        |
| 其他权益工具投资    | 6.4.7.7 | -                      | -                        |
| 应收清算款       |         | -                      | -                        |
| 应收股利        |         | -                      | -                        |
| 应收申购款       |         | 5,165,850.93           | 8,762,985.62             |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.8 | -                      | -                        |
| 资产总计        |         | 85,989,441.40          | 30,724,398.29            |
| 负 债 和 净 资 产 |         |                        |                          |
| 负 债：        |         |                        |                          |
| 短期借款        |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                      | -                        |
| 应付清算款       |         | -                      | -                        |
| 应付赎回款       |         | 81,443.72              | 34,528.84                |

|          |          |               |               |
|----------|----------|---------------|---------------|
| 应付管理人报酬  |          | 16,214.40     | 9,055.85      |
| 应付托管费    |          | 3,242.87      | 1,811.15      |
| 应付销售服务费  |          | 6,302.89      | 1,955.73      |
| 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     | 6.4.7.9  | 4,696.82      | 2,100.00      |
| 负债合计     |          | 111,900.70    | 49,451.57     |
| 净资产：     |          |               |               |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 52,258,402.35 | 22,708,454.11 |
| 其他综合收益   | 6.4.7.11 | -             | -             |
| 未分配利润    | 6.4.7.12 | 33,619,138.35 | 7,966,492.61  |
| 净资产合计    |          | 85,877,540.70 | 30,674,946.72 |
| 负债和净资产总计 |          | 85,989,441.40 | 30,724,398.29 |

注：①报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.6489 元，C 类基金份额净值 1.6406 元；基金份额总额 52,258,402.35 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 17,284,445.54 份，C 类基金份额总额 34,973,956.81 份。

②本基金基金合同于 2025 年 3 月 19 日生效，上年度为不完整会计年度，下同。

6.2 利润表

会计主体：中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 附注号      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026<br>年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 19 日（基金<br>合同生效日）至 2025 年 6<br>月 30 日 |
|-----------------------|----------|------------------------------------------|-------------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入               |          | 7,062,467.09                             | 1,273,266.18                                                |
| 1. 利息收入               |          | 2,210.46                                 | 5,027.38                                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.13 | 2,210.46                                 | 5,027.38                                                    |
| 债券利息收入                |          | -                                        | -                                                           |
| 资产支持证券利<br>息收入        |          | -                                        | -                                                           |
| 买入返售金融资<br>产收入        |          | -                                        | -                                                           |
| 其他利息收入                |          | -                                        | -                                                           |
| 2. 投资收益（损失以“-”<br>填列） |          | 2,563,314.41                             | 433,869.29                                                  |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.14 | 2,325,692.75                             | 304,820.12                                                  |
| 基金投资收益                |          | -                                        | -                                                           |

|                            |            |              |              |
|----------------------------|------------|--------------|--------------|
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15   | -            | -            |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.16   | -            | -            |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17   | -            | -            |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18   | -            | -            |
| 股利收益                       | 6.4.7.19   | 237,621.66   | 129,049.17   |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益      |            | -            | -            |
| 其他投资收益                     |            | -            | -            |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.20   | 4,494,166.29 | 834,226.09   |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -            | -            |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.21   | 2,775.93     | 143.42       |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 128,166.77   | 71,637.23    |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 80,017.28    | 20,634.07    |
| 其中：暂估管理人报酬                 |            | -            | -            |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 16,003.43    | 4,126.78     |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 29,453.09    | 4,436.25     |
| 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                  | 6.4.7.22   | -            | -            |
| 7. 税金及附加                   |            | -            | -            |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 2,692.97     | 42,440.13    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | 6,934,300.32 | 1,201,628.95 |
| 减：所得税费用                    |            | -            | -            |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | 6,934,300.32 | 1,201,628.95 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -            | -            |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | 6,934,300.32 | 1,201,628.95 |

6.3 净资产变动表

会计主体：中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期                              |
|----|---------------------------------|
|    | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |

|                                          | 实收基金                                      | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
|------------------------------------------|-------------------------------------------|--------|---------------|----------------|
| 一、上期期末净资产                                | 22,708,454.11                             | -      | 7,966,492.61  | 30,674,946.72  |
| 加：会计政策变更                                 | -                                         | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                         | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -                                         | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产                                | 22,708,454.11                             | -      | 7,966,492.61  | 30,674,946.72  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 29,549,948.24                             | -      | 25,652,645.74 | 55,202,593.98  |
| （一）、综合收益总额                               | -                                         | -      | 6,934,300.32  | 6,934,300.32   |
| （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）      | 29,549,948.24                             | -      | 18,718,345.42 | 48,268,293.66  |
| 其中：1. 基金申购款                              | 45,058,899.51                             | -      | 25,666,390.10 | 70,725,289.61  |
| 2. 基金赎回款                                 | -15,508,951.27                            | -      | -6,948,044.68 | -22,456,995.95 |
| （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）、其他综合收益结转留存收益                         | -                                         | -      | -             | -              |
| 四、本期期末净资产                                | 52,258,402.35                             | -      | 33,619,138.35 | 85,877,540.70  |
| 项目                                       | 上年度可比期间                                   |        |               |                |
|                                          | 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |        |               |                |
|                                          | 实收基金                                      | 其他综合收益 | 未分配利润         | 净资产合计          |
| 一、上期期末净资产                                | -                                         | -      | -             | -              |
| 加：会计政策变更                                 | -                                         | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -                                         | -      | -             | -              |

|                                          |               |   |              |               |
|------------------------------------------|---------------|---|--------------|---------------|
| 其他                                       | -             | - | -            | -             |
| 二、本期期初净资产                                | 16,612,196.51 | - | -            | 16,612,196.51 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -4,448,577.20 | - | 1,095,795.48 | -3,352,781.72 |
| (一)、综合收益总额                               | -             | - | 1,201,628.95 | 1,201,628.95  |
| (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)      | -4,448,577.20 | - | -105,833.47  | -4,554,410.67 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 1,848,280.68  | - | 82,395.47    | 1,930,676.15  |
| 2. 基金赎回款                                 | -6,296,857.88 | - | -188,228.94  | -6,485,086.82 |
| (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)、其他综合收益结转留存收益                         | -             | - | -            | -             |
| 四、本期期末净资产                                | 12,163,619.31 | - | 1,095,795.48 | 13,259,414.79 |

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：

裴荣荣

裴荣荣

韩丹

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

中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2024]1714 号文《关于准予中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金注册的批复》，由中航基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金

法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2025 年 3 月 19 日募集成立。本基金的基金管理人为中航基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，基金合同生效日的基金份额总额为 16,612,196.51 份，有效认购户数为 59 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 538.59 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经立信会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，为更好地实现投资目标，还可以少量投资于国内依法发行上市的其他股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可交换债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券）、债券回购、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、国债期货、股指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。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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>》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

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

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，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 日的经营成果和净资产变动情况。

### 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

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 差错更正的说明

本报告期本基金无需要说明的重大会计差错更正。

### 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【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税明电【2008】2 号《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、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【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、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 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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 2027 年 12 月 31 日前，契约制基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；
2. 基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；
3. 2027 年 12 月 31 日前，对基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的差价收入免征增值税；
4. 2027 年 12 月 31 日前，存款利息收入不征收增值税，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。

5. 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，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；
6. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；
7. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；
8. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 1,085,441.00           |
| 等于：本金          | 1,085,364.28           |
| 加：应计利息         | 76.72                  |
| 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             | 1,085,441.00           |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |      |        |
|----|------------------------|------|------|--------|
|    | 成本                     | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |

|               |       |               |   |               |              |
|---------------|-------|---------------|---|---------------|--------------|
| 股票            |       | 67,827,289.79 | - | 74,817,744.38 | 6,990,454.59 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -             | - | -             | -            |
| 债券            | 交易所市场 | -             | - | -             | -            |
|               | 银行间市场 | -             | - | -             | -            |
|               | 合计    | -             | - | -             | -            |
| 资产支持证券        |       | -             | - | -             | -            |
| 基金            |       | -             | - | -             | -            |
| 其他            |       | -             | - | -             | -            |
| 合计            |       | 67,827,289.79 | - | 74,817,744.38 | 6,990,454.59 |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末本基金未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

#### 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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期本基金未计提减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末本基金未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 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      | -                      |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 1,487.82               |
| 其他应付款       | 3,209.00               |
| 合计          | 4,696.82               |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航中证智选均衡配置指数发起 A

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额          |
| 上年度末          | 12,415,326.61                         | 12,415,326.61 |
| 本期申购          | 7,508,959.43                          | 7,508,959.43  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,639,840.50                         | -2,639,840.50 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                                     | -             |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                                     | -             |
| 本期申购          | -                                     | -             |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -             |
| 本期末           | 17,284,445.54                         | 17,284,445.54 |

中航中证智选均衡配置指数发起 C

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|               | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                |
|---------------|---------------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                         | 账面金额           |
| 上年度末          | 10,293,127.50                   | 10,293,127.50  |
| 本期申购          | 37,549,940.08                   | 37,549,940.08  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -12,869,110.77                  | -12,869,110.77 |
| 基金拆分/份额折算前    | -                               | -              |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                               | -              |
| 本期申购          | -                               | -              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                               | -              |
| 本期末           | 34,973,956.81                   | 34,973,956.81  |

注：本期申购包含基金红利再投、转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航中证智选均衡配置指数发起 A

| 项目             | 已实现部分        | 未实现部分        | 未分配利润合计       |
|----------------|--------------|--------------|---------------|
| 上年度末           | 1,944,380.22 | 2,434,758.39 | 4,379,138.61  |
| 加：会计政策变更       | -            | -            | -             |
| 前期差错更正         | -            | -            | -             |
| 其他             | -            | -            | -             |
| 本期期初           | 1,944,380.22 | 2,434,758.39 | 4,379,138.61  |
| 本期利润           | 1,355,040.58 | 2,296,230.39 | 3,651,270.97  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,406,956.81 | 1,778,352.48 | 3,185,309.29  |
| 其中：基金申购款       | 1,910,455.15 | 2,453,217.50 | 4,363,672.65  |
| 基金赎回款          | -503,498.34  | -674,865.02  | -1,178,363.36 |
| 本期已分配利润        | -            | -            | -             |
| 本期末            | 4,706,377.61 | 6,509,341.26 | 11,215,718.87 |

中航中证智选均衡配置指数发起 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末           | 1,571,013.35  | 2,016,340.65  | 3,587,354.00  |
| 加：会计政策变更       | -             | -             | -             |
| 前期差错更正         | -             | -             | -             |
| 其他             | -             | -             | -             |
| 本期期初           | 1,571,013.35  | 2,016,340.65  | 3,587,354.00  |
| 本期利润           | 1,085,093.45  | 2,197,935.90  | 3,283,029.35  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 6,611,119.29  | 8,921,916.84  | 15,533,036.13 |
| 其中：基金申购款       | 9,049,711.76  | 12,253,005.69 | 21,302,717.45 |
| 基金赎回款          | -2,438,592.47 | -3,331,088.85 | -5,769,681.32 |

|         |              |               |               |
|---------|--------------|---------------|---------------|
| 本期已分配利润 | -            | -             | -             |
| 本期末     | 9,267,226.09 | 13,136,193.39 | 22,403,419.48 |

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,883.58                              |
| 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 | 326.88                                |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 2,210.46                              |

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 2,325,692.75                          |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -                                     |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                                     |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                                     |
| 合计               | 2,325,692.75                          |

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 18,335,910.34                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 15,978,383.19                         |
| 减：交易费用     | 31,834.40                             |
| 买卖股票差价收入   | 2,325,692.75                          |

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期本基金无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

本报告期本基金无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本报告期本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本报告期本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本报告期本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本报告期本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|               |            |
|---------------|------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 237,621.66 |
| 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            | 237,621.66 |

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 4,494,166.29                          |
| 股票投资                   | 4,494,166.29                          |
| 债券投资                   | —                                     |
| 资产支持证券投资               | —                                     |
| 基金投资                   | —                                     |
| 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                     | 4,494,166.29                          |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 2,137.68                              |
| 基金转换费收入 | 638.25                                |
| 合计      | 2,775.93                              |

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本报告期本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 1,487.82                              |
| 信息披露费   | —                                     |
| 证券出借违约金 | —                                     |
| 开户费     | 400.00                                |
| 其他      | 3.90                                  |
| 银行划款费   | 801.25                                |

|    |          |
|----|----------|
| 合计 | 2,692.97 |
|----|----------|

6.4.7.24 分部报告

无。

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

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要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

本报告期内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               |
|-------------------|-----------------------|
| 中航基金管理有限公司        | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司        | 基金托管人                 |
| 中航证券有限公司          | 基金管理人股东、基金代销机构        |
| 招商局积余产业运营服务股份有限公司 | 与基金管理人受同一实际控制人控制的公司   |
| 深南电路股份有限公司        | 与基金管理人受同一实际控制人控制的公司   |
| 江西洪都航空工业股份有限公司    | 与基金管理人受同一实际控制人控制的公司   |
| 中航成飞股份有限公司        | 与基金管理人受同一实际控制人控制的公司   |
| 中航机载系统股份有限公司      | 与基金管理人受同一实际控制人控制的公司   |
| 中航重机股份有限公司        | 与基金管理人受同一实际控制人控制的公司   |
| 中航(成都)无人机系统股份有限公司 | 与基金管理人受同一实际控制人控制的公司   |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称    | 本期                              |                 | 上年度可比期间                         |                 |
|----------|---------------------------------|-----------------|---------------------------------|-----------------|
|          | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                 | 2025年3月19日（基金合同生效日）至2025 年6月30日 |                 |
|          | 成交金额                            | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额                            | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 中航证券有限公司 | 70,649,027.12                   | 83.61           | 23,949,554.88                   | 100.00          |

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称    | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日                |                   |              |                     |
|----------|-------------------------------------------|-------------------|--------------|---------------------|
|          | 当期<br>佣金                                  | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 中航证券有限公司 | 14,542.98                                 | 84.36             | —            | —                   |
| 关联方名称    | 上年度可比期间<br>2025年3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日 |                   |              |                     |
|          | 当期<br>佣金                                  | 占当期佣金总量<br>的比例（%） | 期末应付佣金余<br>额 | 占期末应付佣金<br>总额的比例（%） |
| 中航证券有限公司 | 4,931.11                                  | 100.00            | —            | —                   |

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取、并由券商承担的费用后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>2026年1月1日至2026年6月30日 | 上年度可比期间<br>2025年3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日 |
|------------------|----------------------------|-------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 80,017.28                  | 20,634.07                                 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 20,047.47                  | 1,903.14                                  |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 59,969.81                  | 18,730.93                                 |

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.50\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|------------------------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 16,003.43                             | 4,126.78                                             |

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                  |          |
|----------------|---------------------------------------|------------------|----------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                      |                  |          |
|                | 中航中证智选均衡配置指数发起 A                      | 中航中证智选均衡配置指数发起 C | 合计       |
| 中航证券有限公司       | -                                     | 4,469.12         | 4,469.12 |
| 合计             | -                                     | 4,469.12         | 4,469.12 |
| 获得销售服务费的各关联方   | 上年度可比期间                               |                  |          |

| 方名称      | 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |                  |          |
|----------|-------------------------------------------|------------------|----------|
|          | 当期发生的基金应支付的销售服务费                          |                  |          |
|          | 中航中证智选均衡配置指数发起 A                          | 中航中证智选均衡配置指数发起 C | 合计       |
| 中航证券有限公司 | -                                         | 3,780.88         | 3,780.88 |
| 合计       | -                                         | 3,780.88         | 3,780.88 |

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。本基金 C 类基金份额的销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                  |
|-------------|---------------------------------------|------------------|
|             | 中航中证智选均衡配置指数发起 A                      | 中航中证智选均衡配置指数发起 C |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,277.80                         | -                |

|                                             |                                                      |                  |
|---------------------------------------------|------------------------------------------------------|------------------|
| 报告期间申购/<br>买入总份额                            | -                                                    | -                |
| 报告期间因拆分<br>变动份额                             | -                                                    | -                |
| 减：报告期间赎回/<br>卖出总份额                          | -                                                    | -                |
| 报告期末持有的<br>基金份额                             | 10,000,277.80                                        | -                |
| 报告期末持有的<br>基金份额<br>占基金总份额比<br>例             | 19.14%                                               | -                |
| 项目                                          | 上年度可比期间<br>2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日 |                  |
|                                             | 中航中证智选均衡配置指数发起 A                                     | 中航中证智选均衡配置指数发起 C |
| 基金合同生效日<br>（ 2025 年 3 月<br>19 日）持有的基<br>金份额 | 10,000,277.80                                        | -                |
| 报告期初持有的<br>基金份额                             | -                                                    | -                |
| 报告期间申购/<br>买入总份额                            | -                                                    | -                |
| 报告期间因拆分<br>变动份额                             | -                                                    | -                |
| 减：报告期间赎回/<br>卖出总份额                          | -                                                    | -                |
| 报告期末持有的<br>基金份额                             | 10,000,277.80                                        | -                |
| 报告期末持有的<br>基金份额<br>占基金总份额比<br>例             | 82.21%                                               | -                |

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

本报告期末及上年度末，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                              |        | 上年度可比期间                        |        |
|-------|---------------------------------|--------|--------------------------------|--------|
|       | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |        | 2025年3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日 |        |
|       | 期末余额                            | 当期利息收入 | 期末余额                           | 当期利息收入 |

|            |              |          |            |          |
|------------|--------------|----------|------------|----------|
| 兴业银行股份有限公司 | 1,085,441.00 | 1,883.58 | 137,467.72 | 3,467.94 |
| 中航证券有限公司   | 4,497,761.06 | 211.78   | 852,361.19 | 456.32   |

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为更紧密地跟踪标的指数，降低跟踪误差，经与基金托管人协商一致，本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于相关关联方发行的股票：洪都航空(600316)、中航机载(600372)、招商积余(001914)、深南电路(002916)、中航成飞(302132)、中航重机(600765)、中无人机(688297)。

本报告期末，本基金持有洪都航空 1,700 股，占基金资产净值比例 0.06%；本基金持有中航机载 3,500 股，占基金资产净值比例 0.04%；本基金持有招商积余 1,800 股，占基金资产净值比例 0.02%；本基金持有深南电路 430 股，占基金资产净值比例 0.23%；本基金持有中航成飞 400 股，占基金资产净值比例 0.03%；本基金持有中航重机 4,300 股，占基金资产净值比例 0.06%；本基金持有中无人机 1,319 股，占基金资产净值比例 0.06%。

#### 6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2026 年 6 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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

##### 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 |
|--------|------|-----------------|--------|--------|-----------------|--------|-------|-----------|-----------|----|
| 601369 | 陕鼓动力 | 2026 年 6 月 29 日 | 重大事项停牌 | 9.05   | 2026 年 7 月 13 日 | 9.96   | 2,300 | 20,997.24 | 20,815.00 | -  |

##### 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

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目的是在力求在严格控制风险的前提下，谋求实现基金资产的长期稳定增长的投资目标。

本基金的基金管理人对于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评估各种风险发生的可能损失。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。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

董事会对公司风险管理负有最终责任，董事会下设合规及风险管理委员会与督察长。合规及风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策，对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司监察稽核工作，监督检查受托资产和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程，处置重大风险事件，促进风险管理文化的形成。

监察稽核部和风险管理部是公司内部控制的职能部门。各职能部门负责从经营管理的各环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

#### 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同责任，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。

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。基金的货币资金存放

在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该货币资金相关的信用风险不重大。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，违约风险事件发生的可能性很小；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。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放日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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末,除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(若有)将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息,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。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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,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。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,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度:根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2026 年 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                     | 1,085,441.00 | -     | -     | -             | 1,085,441.00  |
| 结算备付金                    | 4,920,405.09 | -     | -     | -             | 4,920,405.09  |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 74,817,744.38 | 74,817,744.38 |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 5,165,850.93  | 5,165,850.93  |
| 资产总计                     | 6,005,846.09 | -     | -     | 79,983,595.31 | 85,989,441.40 |
| 负债                       |              |       |       |               |               |
| 应付赎回款                    | -            | -     | -     | 81,443.72     | 81,443.72     |
| 应付管理人报酬                  | -            | -     | -     | 16,214.40     | 16,214.40     |
| 应付托管费                    | -            | -     | -     | 3,242.87      | 3,242.87      |
| 应付销售服务费                  | -            | -     | -     | 6,302.89      | 6,302.89      |
| 其他负债                     | -            | -     | -     | 4,696.82      | 4,696.82      |
| 负债总计                     | -            | -     | -     | 111,900.70    | 111,900.70    |
| 利率敏感度缺口                  | 6,005,846.09 | -     | -     | 79,871,694.61 | 85,877,540.70 |
| 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | 1 年以内        | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息           | 合计            |
| 资产                       |              |       |       |               |               |
| 货币资金                     | 1,184,275.88 | -     | -     | -             | 1,184,275.88  |
| 结算备付金                    | 632,756.34   | -     | -     | -             | 632,756.34    |
| 交易性金融资产                  | -            | -     | -     | 20,144,380.45 | 20,144,380.45 |
| 应收申购款                    | -            | -     | -     | 8,762,985.62  | 8,762,985.62  |
| 资产总计                     | 1,817,032.22 | -     | -     | 28,907,366.07 | 30,724,398.29 |

|         |              |   |   |               |               |
|---------|--------------|---|---|---------------|---------------|
| 负债      |              |   |   |               |               |
| 应付赎回款   | -            | - | - | 34,528.84     | 34,528.84     |
| 应付管理人报酬 | -            | - | - | 9,055.85      | 9,055.85      |
| 应付托管费   | -            | - | - | 1,811.15      | 1,811.15      |
| 应付销售服务费 | -            | - | - | 1,955.73      | 1,955.73      |
| 其他负债    | -            | - | - | 2,100.00      | 2,100.00      |
| 负债总计    | -            | - | - | 49,451.57     | 49,451.57     |
| 利率敏感度缺口 | 1,817,032.22 | - | - | 28,857,914.50 | 30,674,946.72 |

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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资或资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|--------------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                     | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 74,817,744.38          | 87.12            | 20,144,380.45            | 65.67            |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -                | -                        | -                |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                      | -                | -                        | -                |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                      | -                | -                        | -                |
| 其他            | -                      | -                | -                        | -                |
| 合计            | 74,817,744.38          | 87.12            | 20,144,380.45            | 65.67            |

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（2026 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2025 年 12 月 31 日） |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 3,468,494.48                | 336,447.63             |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | -3,468,494.48               | -336,447.63            |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

|                                                |
|------------------------------------------------|
| 公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： |
| 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。                     |
| 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。             |
| 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。                          |

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 74,796,929.38          | 20,058,312.45            |
| 第二层次          | 20,815.00              | 86,068.00                |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 74,817,744.38          | 20,144,380.45            |

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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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              | 74,817,744.38 | 87.01        |
|    | 其中：股票             | 74,817,744.38 | 87.01        |
| 2  | 基金投资              | —             | —            |
| 3  | 固定收益投资            | —             | —            |
|    | 其中：债券             | —             | —            |
|    | 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      | 6,005,846.09  | 6.98         |
| 8  | 其他各项资产            | 5,165,850.93  | 6.01         |
| 9  | 合计                | 85,989,441.40 | 100.00       |

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资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 | 103,561.30   | 0.12         |
| B  | 采矿业      | 3,338,310.70 | 3.89         |

|   |                  |               |       |
|---|------------------|---------------|-------|
| C | 制造业              | 54,835,062.58 | 63.85 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 1,401,160.00  | 1.63  |
| E | 建筑业              | 769,236.00    | 0.90  |
| F | 批发和零售业           | 1,576,000.40  | 1.84  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,091,342.80  | 1.27  |
| H | 住宿和餐饮业           | 65,142.00     | 0.08  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,515,996.78  | 5.26  |
| J | 金融业              | 4,646,605.82  | 5.41  |
| K | 房地产业             | 206,360.00    | 0.24  |
| L | 租赁和商务服务业         | 607,398.00    | 0.71  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 953,929.00    | 1.11  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 345,880.00    | 0.40  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -             | -     |
| P | 教育               | 54,879.00     | 0.06  |
| Q | 卫生和社会工作          | 112,619.00    | 0.13  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 152,105.00    | 0.18  |
| S | 综合               | 42,156.00     | 0.05  |
|   | 合计               | 74,817,744.38 | 87.12 |

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|--------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创 | 1,600 | 2,032,000.00 | 2.37         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 3,800 | 1,493,438.00 | 1.74         |
| 3  | 688498 | 源杰科技 | 490   | 924,140.00   | 1.08         |
| 4  | 600487 | 亨通光电 | 7,700 | 841,918.00   | 0.98         |
| 5  | 603986 | 兆易创新 | 1,000 | 815,000.00   | 0.95         |
| 6  | 688256 | 寒武纪  | 498   | 794,583.90   | 0.93         |

|    |        |       |        |            |      |
|----|--------|-------|--------|------------|------|
| 7  | 601318 | 中国平安  | 15,400 | 735,196.00 | 0.86 |
| 8  | 688525 | 佰维存储  | 1,476  | 730,221.48 | 0.85 |
| 9  | 301308 | 江波龙   | 1,000  | 703,800.00 | 0.82 |
| 10 | 001309 | 德明利   | 700    | 660,030.00 | 0.77 |
| 11 | 601899 | 紫金矿业  | 23,800 | 598,332.00 | 0.70 |
| 12 | 300604 | 长川科技  | 1,700  | 580,414.00 | 0.68 |
| 13 | 688347 | 华虹公司  | 1,596  | 536,734.80 | 0.63 |
| 14 | 000333 | 美的集团  | 7,000  | 528,710.00 | 0.62 |
| 15 | 002475 | 立讯精密  | 7,400  | 520,960.00 | 0.61 |
| 16 | 688012 | 中微公司  | 1,109  | 519,566.50 | 0.61 |
| 17 | 688008 | 澜起科技  | 1,655  | 512,884.50 | 0.60 |
| 18 | 002384 | 东山精密  | 1,900  | 498,465.00 | 0.58 |
| 19 | 688120 | 华海清科  | 1,547  | 498,412.46 | 0.58 |
| 20 | 688041 | 海光信息  | 1,344  | 497,683.20 | 0.58 |
| 21 | 002281 | 光迅科技  | 1,900  | 488,186.00 | 0.57 |
| 22 | 002008 | 大族激光  | 3,200  | 480,352.00 | 0.56 |
| 23 | 600900 | 长江电力  | 17,700 | 468,519.00 | 0.55 |
| 24 | 688981 | 中芯国际  | 2,942  | 467,248.44 | 0.54 |
| 25 | 300857 | 协创数据  | 1,360  | 462,264.00 | 0.54 |
| 26 | 000725 | 京东方 A | 52,500 | 455,700.00 | 0.53 |
| 27 | 300475 | 香农芯创  | 1,500  | 450,000.00 | 0.52 |
| 28 | 603259 | 药明康德  | 3,600  | 448,236.00 | 0.52 |
| 29 | 601138 | 工业富联  | 5,700  | 411,255.00 | 0.48 |
| 30 | 600030 | 中信证券  | 14,100 | 405,093.00 | 0.47 |
| 31 | 300223 | 北京君正  | 1,500  | 373,350.00 | 0.43 |
| 32 | 300059 | 东方财富  | 18,300 | 372,954.00 | 0.43 |
| 33 | 300666 | 江丰电子  | 1,000  | 368,600.00 | 0.43 |
| 34 | 600549 | 厦门钨业  | 4,300  | 366,360.00 | 0.43 |
| 35 | 002353 | 杰瑞股份  | 2,400  | 366,000.00 | 0.43 |
| 36 | 688200 | 华峰测控  | 696    | 365,469.60 | 0.43 |
| 37 | 600183 | 生益科技  | 2,100  | 364,140.00 | 0.42 |
| 38 | 002156 | 通富微电  | 4,700  | 356,589.00 | 0.42 |
| 39 | 000657 | 中钨高新  | 3,600  | 344,592.00 | 0.40 |
| 40 | 300054 | 鼎龙股份  | 3,000  | 317,910.00 | 0.37 |
| 41 | 300408 | 三环集团  | 1,900  | 317,110.00 | 0.37 |
| 42 | 688766 | 普冉股份  | 400    | 306,640.00 | 0.36 |
| 43 | 603083 | 剑桥科技  | 1,200  | 305,844.00 | 0.36 |
| 44 | 300548 | 长芯博创  | 1,100  | 305,800.00 | 0.36 |
| 45 | 300394 | 天孚通信  | 976    | 295,415.68 | 0.34 |
| 46 | 002463 | 沪电股份  | 1,900  | 290,320.00 | 0.34 |
| 47 | 688110 | 东芯股份  | 1,405  | 286,198.50 | 0.33 |
| 48 | 002484 | 江海股份  | 2,700  | 283,500.00 | 0.33 |
| 49 | 688146 | 中船特气  | 800    | 279,992.00 | 0.33 |

|    |        |      |        |            |      |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 50 | 000021 | 深科技  | 4,300  | 276,361.00 | 0.32 |
| 51 | 688409 | 富创精密 | 899    | 275,318.75 | 0.32 |
| 52 | 601869 | 长飞光纤 | 500    | 272,950.00 | 0.32 |
| 53 | 300620 | 光库科技 | 700    | 264,740.00 | 0.31 |
| 54 | 688313 | 仕佳光子 | 1,418  | 261,833.70 | 0.30 |
| 55 | 600176 | 中国巨石 | 3,500  | 255,080.00 | 0.30 |
| 56 | 601208 | 东材科技 | 3,600  | 254,844.00 | 0.30 |
| 57 | 300346 | 南大光电 | 2,700  | 250,155.00 | 0.29 |
| 58 | 000636 | 风华高科 | 3,400  | 245,616.00 | 0.29 |
| 59 | 000651 | 格力电器 | 6,500  | 243,750.00 | 0.28 |
| 60 | 301526 | 国际复材 | 5,100  | 238,017.00 | 0.28 |
| 61 | 600522 | 中天科技 | 3,900  | 236,652.00 | 0.28 |
| 62 | 002080 | 中材科技 | 2,600  | 234,000.00 | 0.27 |
| 63 | 002185 | 华天科技 | 10,400 | 232,024.00 | 0.27 |
| 64 | 688519 | 南亚新材 | 600    | 228,024.00 | 0.27 |
| 65 | 688002 | 睿创微纳 | 1,470  | 227,394.30 | 0.26 |
| 66 | 603993 | 洛阳钼业 | 12,600 | 221,130.00 | 0.26 |
| 67 | 301377 | 鼎泰高科 | 400    | 220,360.00 | 0.26 |
| 68 | 600150 | 中国船舶 | 6,516  | 220,175.64 | 0.26 |
| 69 | 688630 | 芯碁微装 | 400    | 219,756.00 | 0.26 |
| 70 | 600887 | 伊利股份 | 9,100  | 218,036.00 | 0.25 |
| 71 | 605376 | 博迁新材 | 800    | 217,040.00 | 0.25 |
| 72 | 300390 | 天华新能 | 2,300  | 215,073.00 | 0.25 |
| 73 | 300395 | 菲利华  | 1,600  | 213,968.00 | 0.25 |
| 74 | 000338 | 潍柴动力 | 7,800  | 212,550.00 | 0.25 |
| 75 | 603256 | 宏和科技 | 800    | 212,264.00 | 0.25 |
| 76 | 002202 | 金风科技 | 8,800  | 210,320.00 | 0.24 |
| 77 | 000858 | 五粮液  | 2,800  | 207,200.00 | 0.24 |
| 78 | 300672 | 国科微  | 700    | 206,500.00 | 0.24 |
| 79 | 300373 | 扬杰科技 | 1,300  | 204,399.00 | 0.24 |
| 80 | 301511 | 德福科技 | 1,400  | 201,390.00 | 0.23 |
| 81 | 600869 | 远东股份 | 6,000  | 200,820.00 | 0.23 |
| 82 | 002916 | 深南电路 | 430    | 196,897.00 | 0.23 |
| 83 | 300037 | 新宙邦  | 2,100  | 194,985.00 | 0.23 |
| 84 | 002222 | 福晶科技 | 2,100  | 193,788.00 | 0.23 |
| 85 | 300058 | 蓝色光标 | 14,000 | 192,640.00 | 0.22 |
| 86 | 600667 | 太极实业 | 6,500  | 189,670.00 | 0.22 |
| 87 | 600309 | 万华化学 | 2,700  | 184,707.00 | 0.22 |
| 88 | 301217 | 铜冠铜箔 | 1,100  | 181,577.00 | 0.21 |
| 89 | 000426 | 兴业银锡 | 5,500  | 181,280.00 | 0.21 |
| 90 | 002415 | 海康威视 | 5,300  | 181,260.00 | 0.21 |
| 91 | 605358 | 立昂微  | 2,300  | 178,480.00 | 0.21 |
| 92 | 601168 | 西部矿业 | 6,500  | 176,410.00 | 0.21 |

|     |        |        |        |            |      |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 93  | 000811 | 冰轮环境   | 3,100  | 174,282.00 | 0.20 |
| 94  | 601688 | 华泰证券   | 8,400  | 173,208.00 | 0.20 |
| 95  | 600206 | 有研新材   | 2,600  | 173,160.00 | 0.20 |
| 96  | 688183 | 生益电子   | 1,298  | 171,855.20 | 0.20 |
| 97  | 600988 | 赤峰黄金   | 6,500  | 171,080.00 | 0.20 |
| 98  | 600885 | 宏发股份   | 4,860  | 167,621.40 | 0.20 |
| 99  | 000960 | 锡业股份   | 3,900  | 166,491.00 | 0.19 |
| 100 | 001389 | 广合科技   | 700    | 166,075.00 | 0.19 |
| 101 | 600089 | 特变电工   | 7,300  | 164,250.00 | 0.19 |
| 102 | 601857 | 中国石油   | 18,600 | 161,448.00 | 0.19 |
| 103 | 600601 | 方正科技   | 11,600 | 160,544.00 | 0.19 |
| 104 | 601088 | 中国神华   | 4,000  | 156,160.00 | 0.18 |
| 105 | 002273 | 水晶光电   | 4,400  | 156,112.00 | 0.18 |
| 106 | 002028 | 思源电气   | 900    | 155,700.00 | 0.18 |
| 107 | 000100 | TCL 科技 | 26,100 | 151,902.00 | 0.18 |
| 108 | 301358 | 湖南裕能   | 2,000  | 151,740.00 | 0.18 |
| 109 | 002850 | 科达利    | 800    | 151,440.00 | 0.18 |
| 110 | 600378 | 昊华科技   | 2,000  | 150,760.00 | 0.18 |
| 111 | 688629 | 华丰科技   | 800    | 150,008.00 | 0.17 |
| 112 | 605111 | 新洁能    | 1,500  | 148,710.00 | 0.17 |
| 113 | 600031 | 三一重工   | 8,500  | 146,880.00 | 0.17 |
| 114 | 688536 | 思瑞浦    | 400    | 145,636.00 | 0.17 |
| 115 | 002558 | 巨人网络   | 5,200  | 143,312.00 | 0.17 |
| 116 | 002245 | 蔚蓝锂芯   | 7,656  | 143,243.76 | 0.17 |
| 117 | 300014 | 亿纬锂能   | 2,200  | 143,066.00 | 0.17 |
| 118 | 600497 | 驰宏锌锗   | 11,800 | 142,898.00 | 0.17 |
| 119 | 002142 | 宁波银行   | 4,800  | 142,512.00 | 0.17 |
| 120 | 601601 | 中国太保   | 4,900  | 139,748.00 | 0.16 |
| 121 | 601126 | 四方股份   | 2,200  | 139,040.00 | 0.16 |
| 122 | 000792 | 盐湖股份   | 4,600  | 138,874.00 | 0.16 |
| 123 | 002532 | 天山铝业   | 12,700 | 136,271.00 | 0.16 |
| 124 | 300438 | 鹏辉能源   | 1,600  | 132,560.00 | 0.15 |
| 125 | 002340 | 格林美    | 19,900 | 131,539.00 | 0.15 |
| 126 | 300236 | 上海新阳   | 1,000  | 131,500.00 | 0.15 |
| 127 | 000933 | 神火股份   | 6,200  | 131,440.00 | 0.15 |
| 128 | 603588 | 高能环境   | 6,800  | 130,560.00 | 0.15 |
| 129 | 002821 | 凯莱英    | 800    | 129,600.00 | 0.15 |
| 130 | 601668 | 中国建筑   | 29,800 | 129,332.00 | 0.15 |
| 131 | 603308 | 应流股份   | 2,100  | 126,840.00 | 0.15 |
| 132 | 003031 | 中瓷电子   | 700    | 126,210.00 | 0.15 |
| 133 | 000783 | 长江证券   | 12,900 | 125,775.00 | 0.15 |
| 134 | 688503 | 聚和材料   | 931    | 123,543.70 | 0.14 |
| 135 | 300398 | 飞凯材料   | 2,000  | 123,500.00 | 0.14 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 136 | 600352 | 浙江龙盛  | 10,100 | 122,311.00 | 0.14 |
| 137 | 603659 | 璞泰来   | 4,200  | 121,506.00 | 0.14 |
| 138 | 002203 | 海亮股份  | 5,300  | 121,105.00 | 0.14 |
| 139 | 002966 | 苏州银行  | 17,400 | 121,104.00 | 0.14 |
| 140 | 300339 | 润和软件  | 3,100  | 119,381.00 | 0.14 |
| 141 | 601233 | 桐昆股份  | 5,500  | 119,075.00 | 0.14 |
| 142 | 688213 | 思特威-W | 1,100  | 117,777.00 | 0.14 |
| 143 | 601728 | 中国电信  | 22,400 | 116,256.00 | 0.14 |
| 144 | 688052 | 纳芯微   | 400    | 115,324.00 | 0.13 |
| 145 | 688578 | 艾力斯   | 1,052  | 114,878.40 | 0.13 |
| 146 | 600941 | 中国移动  | 1,300  | 111,969.00 | 0.13 |
| 147 | 600999 | 招商证券  | 5,300  | 111,830.00 | 0.13 |
| 148 | 688372 | 伟测科技  | 600    | 111,600.00 | 0.13 |
| 149 | 600552 | 凯盛科技  | 3,400  | 110,772.00 | 0.13 |
| 150 | 600690 | 海尔智家  | 5,400  | 110,214.00 | 0.13 |
| 151 | 601108 | 财通证券  | 12,700 | 109,855.00 | 0.13 |
| 152 | 002859 | 洁美科技  | 1,000  | 109,510.00 | 0.13 |
| 153 | 688301 | 奕瑞科技  | 880    | 109,120.00 | 0.13 |
| 154 | 301200 | 大族数控  | 300    | 108,195.00 | 0.13 |
| 155 | 002709 | 天赐材料  | 2,100  | 108,003.00 | 0.13 |
| 156 | 603678 | 火炬电子  | 1,300  | 107,900.00 | 0.13 |
| 157 | 002517 | 恺英网络  | 6,600  | 107,250.00 | 0.12 |
| 158 | 002797 | 第一创业  | 16,300 | 107,091.00 | 0.12 |
| 159 | 601958 | 金钼股份  | 3,800  | 106,818.00 | 0.12 |
| 160 | 300458 | 全志科技  | 2,700  | 106,542.00 | 0.12 |
| 161 | 002128 | 电投能源  | 4,600  | 106,352.00 | 0.12 |
| 162 | 603799 | 华友钴业  | 2,200  | 106,172.00 | 0.12 |
| 163 | 300033 | 同花顺   | 440    | 106,040.00 | 0.12 |
| 164 | 002497 | 雅化集团  | 5,200  | 105,924.00 | 0.12 |
| 165 | 688385 | 复旦微电  | 1,471  | 104,867.59 | 0.12 |
| 166 | 002460 | 赣锋锂业  | 1,600  | 104,640.00 | 0.12 |
| 167 | 601991 | 大唐发电  | 14,500 | 102,660.00 | 0.12 |
| 168 | 002155 | 湖南黄金  | 4,270  | 101,924.90 | 0.12 |
| 169 | 000703 | 恒逸石化  | 7,500  | 101,775.00 | 0.12 |
| 170 | 600160 | 巨化股份  | 1,900  | 100,719.00 | 0.12 |
| 171 | 300442 | 润泽科技  | 1,200  | 99,684.00  | 0.12 |
| 172 | 002487 | 大金重工  | 1,700  | 98,549.00  | 0.11 |
| 173 | 000776 | 广发证券  | 4,200  | 98,280.00  | 0.11 |
| 174 | 603156 | 养元饮品  | 2,000  | 98,140.00  | 0.11 |
| 175 | 688300 | 联瑞新材  | 400    | 97,760.00  | 0.11 |
| 176 | 688127 | 蓝特光学  | 1,001  | 97,697.60  | 0.11 |
| 177 | 688331 | 荣昌生物  | 748    | 97,434.48  | 0.11 |
| 178 | 601665 | 齐鲁银行  | 16,800 | 96,936.00  | 0.11 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 179 | 300454 | 深信服  | 1,000  | 96,200.00 | 0.11 |
| 180 | 000425 | 徐工机械 | 11,800 | 95,462.00 | 0.11 |
| 181 | 600563 | 法拉电子 | 500    | 95,400.00 | 0.11 |
| 182 | 000938 | 紫光股份 | 3,300  | 95,238.00 | 0.11 |
| 183 | 600884 | 杉杉股份 | 7,000  | 94,850.00 | 0.11 |
| 184 | 300319 | 麦捷科技 | 3,200  | 94,816.00 | 0.11 |
| 185 | 600577 | 精达股份 | 9,600  | 93,888.00 | 0.11 |
| 186 | 601600 | 中国铝业 | 11,400 | 93,708.00 | 0.11 |
| 187 | 600028 | 中国石化 | 20,900 | 93,214.00 | 0.11 |
| 188 | 601677 | 明泰铝业 | 5,600  | 92,960.00 | 0.11 |
| 189 | 600460 | 士兰微  | 1,700  | 92,922.00 | 0.11 |
| 190 | 002130 | 沃尔核材 | 4,900  | 92,904.00 | 0.11 |
| 191 | 600938 | 中国海油 | 3,400  | 92,310.00 | 0.11 |
| 192 | 002466 | 天齐锂业 | 1,500  | 91,980.00 | 0.11 |
| 193 | 000060 | 中金岭南 | 12,100 | 91,597.00 | 0.11 |
| 194 | 601766 | 中国中车 | 17,600 | 91,520.00 | 0.11 |
| 195 | 603379 | 三美股份 | 1,200  | 91,068.00 | 0.11 |
| 196 | 300953 | 震裕科技 | 680    | 90,916.00 | 0.11 |
| 197 | 000878 | 云南铜业 | 5,700  | 90,516.00 | 0.11 |
| 198 | 002378 | 章源钨业 | 2,700  | 90,396.00 | 0.11 |
| 199 | 301536 | 星辰科技 | 700    | 90,097.00 | 0.10 |
| 200 | 300012 | 华测检测 | 6,500  | 90,090.00 | 0.10 |
| 201 | 600050 | 中国联通 | 22,500 | 90,000.00 | 0.10 |
| 202 | 000893 | 亚钾国际 | 2,200  | 89,958.00 | 0.10 |
| 203 | 600186 | 莲花控股 | 6,400  | 89,600.00 | 0.10 |
| 204 | 300184 | 力源信息 | 5,100  | 89,505.00 | 0.10 |
| 205 | 002414 | 高德红外 | 6,700  | 88,842.00 | 0.10 |
| 206 | 000034 | 神州数码 | 3,200  | 88,800.00 | 0.10 |
| 207 | 002049 | 紫光国微 | 1,000  | 88,750.00 | 0.10 |
| 208 | 600109 | 国金证券 | 10,100 | 88,678.00 | 0.10 |
| 209 | 603979 | 金诚信  | 1,500  | 88,545.00 | 0.10 |
| 210 | 603283 | 赛腾股份 | 1,090  | 88,268.20 | 0.10 |
| 211 | 601009 | 南京银行 | 8,900  | 88,021.00 | 0.10 |
| 212 | 002271 | 东方雨虹 | 7,400  | 87,838.00 | 0.10 |
| 213 | 300323 | 华灿光电 | 4,300  | 87,720.00 | 0.10 |
| 214 | 603119 | 浙江荣泰 | 1,320  | 87,568.80 | 0.10 |
| 215 | 002617 | 露笑科技 | 8,500  | 87,465.00 | 0.10 |
| 216 | 002444 | 巨星科技 | 2,800  | 87,080.00 | 0.10 |
| 217 | 600298 | 安琪酵母 | 2,400  | 86,880.00 | 0.10 |
| 218 | 603663 | 三祥新材 | 900    | 86,670.00 | 0.10 |
| 219 | 300496 | 中科创达 | 1,400  | 86,506.00 | 0.10 |
| 220 | 600060 | 海信视像 | 3,100  | 86,397.00 | 0.10 |
| 221 | 300661 | 圣邦股份 | 600    | 86,088.00 | 0.10 |

|     |        |        |        |           |      |
|-----|--------|--------|--------|-----------|------|
| 222 | 002747 | 埃斯顿    | 2,300  | 85,859.00 | 0.10 |
| 223 | 300623 | 捷捷微电   | 1,900  | 85,481.00 | 0.10 |
| 224 | 688111 | 金山办公   | 400    | 85,220.00 | 0.10 |
| 225 | 002756 | 永兴材料   | 1,500  | 84,960.00 | 0.10 |
| 226 | 688266 | 泽璟制药-U | 721    | 84,111.86 | 0.10 |
| 227 | 605117 | 德业股份   | 780    | 82,820.40 | 0.10 |
| 228 | 601128 | 常熟银行   | 14,193 | 82,603.26 | 0.10 |
| 229 | 601696 | 中银证券   | 6,500  | 82,225.00 | 0.10 |
| 230 | 300602 | 飞荣达    | 1,600  | 81,920.00 | 0.10 |
| 231 | 601577 | 长沙银行   | 9,400  | 81,874.00 | 0.10 |
| 232 | 002716 | 湖南白银   | 10,100 | 81,709.00 | 0.10 |
| 233 | 300073 | 当升科技   | 1,700  | 81,668.00 | 0.10 |
| 234 | 000423 | 东阿阿胶   | 1,800  | 81,648.00 | 0.10 |
| 235 | 002078 | 太阳纸业   | 6,500  | 81,185.00 | 0.09 |
| 236 | 002241 | 歌尔股份   | 3,600  | 81,108.00 | 0.09 |
| 237 | 601872 | 招商轮船   | 4,600  | 80,822.00 | 0.09 |
| 238 | 603606 | 东方电缆   | 1,940  | 80,529.40 | 0.09 |
| 239 | 002192 | 融捷股份   | 900    | 80,460.00 | 0.09 |
| 240 | 300432 | 富临精工   | 4,000  | 80,360.00 | 0.09 |
| 241 | 688652 | 京仪装备   | 400    | 80,068.00 | 0.09 |
| 242 | 300919 | 中伟新材   | 1,800  | 78,750.00 | 0.09 |
| 243 | 002171 | 楚江新材   | 5,800  | 78,706.00 | 0.09 |
| 244 | 688700 | 东威科技   | 879    | 78,582.60 | 0.09 |
| 245 | 600961 | 株冶集团   | 2,400  | 77,736.00 | 0.09 |
| 246 | 688599 | 天合光能   | 5,458  | 77,066.96 | 0.09 |
| 247 | 603127 | 昭衍新药   | 2,000  | 76,440.00 | 0.09 |
| 248 | 000408 | 藏格矿业   | 1,100  | 76,252.00 | 0.09 |
| 249 | 600489 | 中金黄金   | 4,200  | 75,810.00 | 0.09 |
| 250 | 002625 | 光启技术   | 2,500  | 75,800.00 | 0.09 |
| 251 | 601888 | 中国中免   | 1,400  | 75,194.00 | 0.09 |
| 252 | 300657 | 弘信电子   | 1,700  | 74,834.00 | 0.09 |
| 253 | 688396 | 华润微    | 763    | 74,430.65 | 0.09 |
| 254 | 002064 | 华峰化学   | 7,800  | 74,022.00 | 0.09 |
| 255 | 000630 | 铜陵有色   | 11,500 | 73,140.00 | 0.09 |
| 256 | 688617 | 惠泰医疗   | 400    | 72,624.00 | 0.08 |
| 257 | 300166 | 东方国信   | 4,100  | 72,611.00 | 0.08 |
| 258 | 688390 | 固德威    | 669    | 72,593.19 | 0.08 |
| 259 | 603444 | 吉比特    | 200    | 71,684.00 | 0.08 |
| 260 | 300170 | 汉得信息   | 4,700  | 71,628.00 | 0.08 |
| 261 | 600595 | 中孚实业   | 12,600 | 70,812.00 | 0.08 |
| 262 | 300738 | 奥飞数据   | 3,500  | 70,770.00 | 0.08 |
| 263 | 688400 | 凌云光    | 1,069  | 70,767.80 | 0.08 |
| 264 | 300199 | 翰宇药业   | 3,200  | 70,656.00 | 0.08 |

|     |        |       |        |           |      |
|-----|--------|-------|--------|-----------|------|
| 265 | 002027 | 分众传媒  | 14,500 | 70,180.00 | 0.08 |
| 266 | 300409 | 道氏技术  | 3,500  | 69,755.00 | 0.08 |
| 267 | 000519 | 中兵红箭  | 3,300  | 69,531.00 | 0.08 |
| 268 | 300972 | 万辰集团  | 400    | 69,364.00 | 0.08 |
| 269 | 002326 | 永太科技  | 2,900  | 68,585.00 | 0.08 |
| 270 | 002405 | 四维图新  | 10,600 | 68,582.00 | 0.08 |
| 271 | 688005 | 容百科技  | 2,240  | 68,544.00 | 0.08 |
| 272 | 300693 | 盛弘股份  | 1,400  | 68,250.00 | 0.08 |
| 273 | 002354 | 天娱数科  | 7,300  | 67,890.00 | 0.08 |
| 274 | 600019 | 宝钢股份  | 12,500 | 67,875.00 | 0.08 |
| 275 | 600516 | 方大炭素  | 11,000 | 67,870.00 | 0.08 |
| 276 | 600177 | 雅戈尔   | 9,000  | 67,770.00 | 0.08 |
| 277 | 600596 | 新安股份  | 4,200  | 67,032.00 | 0.08 |
| 278 | 000807 | 云铝股份  | 3,000  | 66,420.00 | 0.08 |
| 279 | 688559 | 海目星   | 789    | 66,212.88 | 0.08 |
| 280 | 601699 | 潞安环能  | 4,600  | 65,688.00 | 0.08 |
| 281 | 000623 | 吉林敖东  | 3,700  | 65,601.00 | 0.08 |
| 282 | 600388 | 龙净环保  | 4,500  | 65,475.00 | 0.08 |
| 283 | 001301 | 尚太科技  | 700    | 65,457.00 | 0.08 |
| 284 | 300558 | 贝达药业  | 1,000  | 65,070.00 | 0.08 |
| 285 | 600989 | 宝丰能源  | 3,200  | 65,056.00 | 0.08 |
| 286 | 603876 | 鼎胜新材  | 2,500  | 65,025.00 | 0.08 |
| 287 | 600362 | 江西铜业  | 1,500  | 64,950.00 | 0.08 |
| 288 | 603225 | 新凤鸣   | 3,300  | 64,845.00 | 0.08 |
| 289 | 301071 | 力量钻石  | 700    | 64,750.00 | 0.08 |
| 290 | 000750 | 国海证券  | 17,500 | 64,400.00 | 0.07 |
| 291 | 603345 | 安井食品  | 800    | 64,152.00 | 0.07 |
| 292 | 600875 | 东方电气  | 2,200  | 63,294.00 | 0.07 |
| 293 | 688097 | 博众精工  | 1,000  | 63,050.00 | 0.07 |
| 294 | 002065 | 东华软件  | 8,800  | 62,832.00 | 0.07 |
| 295 | 600369 | 西南证券  | 15,600 | 62,712.00 | 0.07 |
| 296 | 603026 | 石大胜华  | 700    | 62,559.00 | 0.07 |
| 297 | 600338 | 西藏珠峰  | 4,100  | 62,484.00 | 0.07 |
| 298 | 600499 | 科达制造  | 4,500  | 62,100.00 | 0.07 |
| 299 | 300607 | 拓斯达   | 1,500  | 61,845.00 | 0.07 |
| 300 | 000538 | 云南白药  | 1,300  | 61,581.00 | 0.07 |
| 301 | 601995 | 中金公司  | 1,700  | 61,455.00 | 0.07 |
| 302 | 002266 | 浙富控股  | 12,100 | 61,226.00 | 0.07 |
| 303 | 603296 | 华勤技术  | 820    | 60,901.40 | 0.07 |
| 304 | 002947 | 恒铭达   | 800    | 60,840.00 | 0.07 |
| 305 | 601678 | 滨化股份  | 9,200  | 60,628.00 | 0.07 |
| 306 | 688158 | 优刻得-W | 1,648  | 60,580.48 | 0.07 |
| 307 | 600323 | 瀚蓝环境  | 2,200  | 60,412.00 | 0.07 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 308 | 603699 | 纽威股份 | 1,200  | 60,360.00 | 0.07 |
| 309 | 001339 | 智微智能 | 590    | 60,345.20 | 0.07 |
| 310 | 002151 | 北斗星通 | 1,900  | 60,325.00 | 0.07 |
| 311 | 600547 | 山东黄金 | 2,600  | 60,034.00 | 0.07 |
| 312 | 000155 | 川能动力 | 5,000  | 59,900.00 | 0.07 |
| 313 | 601377 | 兴业证券 | 9,900  | 59,796.00 | 0.07 |
| 314 | 688188 | 柏楚电子 | 560    | 59,752.00 | 0.07 |
| 315 | 300002 | 神州泰岳 | 7,600  | 59,356.00 | 0.07 |
| 316 | 300726 | 宏达电子 | 700    | 59,199.00 | 0.07 |
| 317 | 600521 | 华海药业 | 4,100  | 59,040.00 | 0.07 |
| 318 | 000415 | 渤海租赁 | 14,500 | 59,015.00 | 0.07 |
| 319 | 600985 | 淮北矿业 | 4,200  | 59,010.00 | 0.07 |
| 320 | 002745 | 木林森  | 4,700  | 58,985.00 | 0.07 |
| 321 | 002430 | 杭氧股份 | 1,900  | 58,824.00 | 0.07 |
| 322 | 601997 | 贵阳银行 | 11,400 | 58,482.00 | 0.07 |
| 323 | 601669 | 中国电建 | 12,400 | 58,280.00 | 0.07 |
| 324 | 000683 | 博源化工 | 10,100 | 58,176.00 | 0.07 |
| 325 | 002249 | 大洋电机 | 7,700  | 57,750.00 | 0.07 |
| 326 | 301392 | 汇成真空 | 200    | 57,728.00 | 0.07 |
| 327 | 601001 | 晋控煤业 | 3,300  | 57,387.00 | 0.07 |
| 328 | 002237 | 恒邦股份 | 3,900  | 57,291.00 | 0.07 |
| 329 | 000166 | 申万宏源 | 13,000 | 57,200.00 | 0.07 |
| 330 | 605020 | 永和股份 | 1,400  | 57,008.00 | 0.07 |
| 331 | 688131 | 皓元医药 | 600    | 56,760.00 | 0.07 |
| 332 | 600704 | 物产中大 | 12,000 | 56,640.00 | 0.07 |
| 333 | 600312 | 平高电气 | 3,200  | 56,512.00 | 0.07 |
| 334 | 603893 | 瑞芯微  | 300    | 56,508.00 | 0.07 |
| 335 | 002648 | 卫星化学 | 2,400  | 56,376.00 | 0.07 |
| 336 | 600332 | 白云山  | 2,800  | 56,112.00 | 0.07 |
| 337 | 600531 | 豫光金铅 | 3,800  | 56,088.00 | 0.07 |
| 338 | 000729 | 燕京啤酒 | 5,500  | 55,715.00 | 0.06 |
| 339 | 600765 | 中航重机 | 4,300  | 55,556.00 | 0.06 |
| 340 | 000737 | 北方铜业 | 4,200  | 55,524.00 | 0.06 |
| 341 | 300821 | 东岳硅材 | 2,700  | 55,512.00 | 0.06 |
| 342 | 002174 | 游族网络 | 4,400  | 55,484.00 | 0.06 |
| 343 | 600529 | 山东药玻 | 3,000  | 55,350.00 | 0.06 |
| 344 | 300015 | 爱尔眼科 | 6,700  | 55,342.00 | 0.06 |
| 345 | 002841 | 视源股份 | 1,600  | 55,248.00 | 0.06 |
| 346 | 601066 | 中信建投 | 1,900  | 55,233.00 | 0.06 |
| 347 | 002389 | 航天彩虹 | 3,100  | 55,087.00 | 0.06 |
| 348 | 688297 | 中无人机 | 1,319  | 54,804.45 | 0.06 |
| 349 | 000422 | 湖北宜化 | 3,900  | 54,795.00 | 0.06 |
| 350 | 000967 | 盈峰环境 | 5,200  | 54,756.00 | 0.06 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 351 | 601975 | 招商南油 | 14,600 | 54,458.00 | 0.06 |
| 352 | 601799 | 星宇股份 | 600    | 54,372.00 | 0.06 |
| 353 | 000528 | 柳工   | 7,200  | 54,360.00 | 0.06 |
| 354 | 688615 | 合合信息 | 480    | 54,288.00 | 0.06 |
| 355 | 603236 | 移远通信 | 1,060  | 54,240.20 | 0.06 |
| 356 | 603267 | 鸿远电子 | 700    | 54,236.00 | 0.06 |
| 357 | 600155 | 华创云信 | 9,800  | 54,096.00 | 0.06 |
| 358 | 601868 | 中国能建 | 20,200 | 53,934.00 | 0.06 |
| 359 | 600166 | 福田汽车 | 18,500 | 53,835.00 | 0.06 |
| 360 | 002518 | 科士达  | 1,000  | 53,590.00 | 0.06 |
| 361 | 301031 | 中熔电气 | 448    | 53,513.60 | 0.06 |
| 362 | 688114 | 华大智造 | 1,043  | 53,276.44 | 0.06 |
| 363 | 300459 | 汤姆猫  | 15,700 | 53,223.00 | 0.06 |
| 364 | 600346 | 恒力石化 | 3,000  | 53,130.00 | 0.06 |
| 365 | 001287 | 中电港  | 1,700  | 52,955.00 | 0.06 |
| 366 | 000686 | 东北证券 | 6,300  | 52,920.00 | 0.06 |
| 367 | 000830 | 鲁西化工 | 4,400  | 52,800.00 | 0.06 |
| 368 | 688380 | 中微半导 | 800    | 52,728.00 | 0.06 |
| 369 | 300773 | 拉卡拉  | 3,440  | 52,632.00 | 0.06 |
| 370 | 300253 | 卫宁健康 | 7,800  | 52,494.00 | 0.06 |
| 371 | 600482 | 中国动力 | 1,600  | 52,480.00 | 0.06 |
| 372 | 601918 | 新集能源 | 6,100  | 52,399.00 | 0.06 |
| 373 | 002410 | 广联达  | 6,400  | 52,224.00 | 0.06 |
| 374 | 600901 | 江苏金租 | 9,000  | 51,750.00 | 0.06 |
| 375 | 600366 | 宁波韵升 | 3,500  | 51,380.00 | 0.06 |
| 376 | 688003 | 天准科技 | 400    | 50,920.00 | 0.06 |
| 377 | 000062 | 深圳华强 | 1,600  | 50,912.00 | 0.06 |
| 378 | 002926 | 华西证券 | 6,200  | 50,654.00 | 0.06 |
| 379 | 002048 | 宁波华翔 | 2,200  | 50,600.00 | 0.06 |
| 380 | 600578 | 京能电力 | 7,800  | 50,310.00 | 0.06 |
| 381 | 002643 | 万润股份 | 2,400  | 50,280.00 | 0.06 |
| 382 | 600426 | 华鲁恒升 | 2,100  | 50,232.00 | 0.06 |
| 383 | 000681 | 视觉中国 | 2,500  | 49,850.00 | 0.06 |
| 384 | 002603 | 以岭药业 | 3,300  | 49,500.00 | 0.06 |
| 385 | 600063 | 皖维高新 | 6,500  | 49,400.00 | 0.06 |
| 386 | 002400 | 省广集团 | 7,800  | 49,218.00 | 0.06 |
| 387 | 000921 | 海信家电 | 1,800  | 49,176.00 | 0.06 |
| 388 | 600398 | 海澜之家 | 9,400  | 49,162.00 | 0.06 |
| 389 | 688692 | 达梦数据 | 200    | 48,858.00 | 0.06 |
| 390 | 688036 | 传音控股 | 826    | 48,692.70 | 0.06 |
| 391 | 601375 | 中原证券 | 12,200 | 48,678.00 | 0.06 |
| 392 | 600872 | 中炬高新 | 2,800  | 48,608.00 | 0.06 |
| 393 | 600428 | 中远海特 | 6,200  | 48,422.00 | 0.06 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 394 | 601000 | 唐山港  | 11,600 | 48,140.00 | 0.06 |
| 395 | 600550 | 保变电气 | 4,100  | 48,093.00 | 0.06 |
| 396 | 300613 | 富瀚微  | 600    | 48,048.00 | 0.06 |
| 397 | 688690 | 纳微科技 | 1,088  | 47,980.80 | 0.06 |
| 398 | 002948 | 青岛银行 | 9,400  | 47,752.00 | 0.06 |
| 399 | 603298 | 杭叉集团 | 2,000  | 47,720.00 | 0.06 |
| 400 | 300315 | 掌趣科技 | 12,200 | 47,580.00 | 0.06 |
| 401 | 000738 | 航发控制 | 2,600  | 47,554.00 | 0.06 |
| 402 | 600316 | 洪都航空 | 1,700  | 47,498.00 | 0.06 |
| 403 | 301219 | 腾远钴业 | 860    | 47,128.00 | 0.05 |
| 404 | 300573 | 兴齐眼药 | 1,151  | 46,914.76 | 0.05 |
| 405 | 600115 | 中国东航 | 12,300 | 46,863.00 | 0.05 |
| 406 | 300008 | 天海防务 | 7,700  | 46,662.00 | 0.05 |
| 407 | 600998 | 九州通  | 9,900  | 46,431.00 | 0.05 |
| 408 | 600008 | 首创环保 | 17,000 | 46,240.00 | 0.05 |
| 409 | 002493 | 荣盛石化 | 4,300  | 46,225.00 | 0.05 |
| 410 | 600188 | 兖矿能源 | 2,600  | 46,202.00 | 0.05 |
| 411 | 002236 | 大华股份 | 2,800  | 46,172.00 | 0.05 |
| 412 | 000987 | 越秀资本 | 5,900  | 46,138.00 | 0.05 |
| 413 | 600170 | 上海建工 | 20,700 | 45,954.00 | 0.05 |
| 414 | 301029 | 怡合达  | 1,700  | 45,917.00 | 0.05 |
| 415 | 600761 | 安徽合力 | 2,800  | 45,808.00 | 0.05 |
| 416 | 603486 | 科沃斯  | 900    | 45,675.00 | 0.05 |
| 417 | 000997 | 新大陆  | 2,800  | 45,640.00 | 0.05 |
| 418 | 000690 | 宝新能源 | 9,700  | 45,590.00 | 0.05 |
| 419 | 600995 | 南网储能 | 3,700  | 45,510.00 | 0.05 |
| 420 | 000682 | 东方电子 | 3,600  | 45,468.00 | 0.05 |
| 421 | 002545 | 东方铁塔 | 2,800  | 45,416.00 | 0.05 |
| 422 | 002152 | 广电运通 | 4,800  | 45,024.00 | 0.05 |
| 423 | 002262 | 恩华药业 | 2,400  | 45,000.00 | 0.05 |
| 424 | 688279 | 峰昭科技 | 200    | 44,888.00 | 0.05 |
| 425 | 000951 | 中国重汽 | 2,300  | 44,873.00 | 0.05 |
| 426 | 002979 | 雷赛智能 | 800    | 44,624.00 | 0.05 |
| 427 | 000612 | 焦作万方 | 4,200  | 44,478.00 | 0.05 |
| 428 | 600282 | 南钢股份 | 9,600  | 44,064.00 | 0.05 |
| 429 | 601058 | 赛轮轮胎 | 3,800  | 43,814.00 | 0.05 |
| 430 | 300181 | 佐力药业 | 3,100  | 43,710.00 | 0.05 |
| 431 | 002079 | 苏州固锝 | 2,900  | 43,587.00 | 0.05 |
| 432 | 688778 | 厦钨新能 | 800    | 43,520.00 | 0.05 |
| 433 | 002396 | 星网锐捷 | 2,270  | 43,515.90 | 0.05 |
| 434 | 000301 | 东方盛虹 | 3,800  | 43,510.00 | 0.05 |
| 435 | 601360 | 三六零  | 5,000  | 43,450.00 | 0.05 |
| 436 | 300687 | 赛意信息 | 1,400  | 43,400.00 | 0.05 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 437 | 301316 | 慧博云通 | 1,100  | 43,318.00 | 0.05 |
| 438 | 600583 | 海油工程 | 8,600  | 43,258.00 | 0.05 |
| 439 | 002607 | 中公教育 | 24,000 | 43,200.00 | 0.05 |
| 439 | 601901 | 方正证券 | 6,000  | 43,200.00 | 0.05 |
| 440 | 603939 | 益丰药房 | 2,400  | 43,152.00 | 0.05 |
| 441 | 600026 | 中远海能 | 2,400  | 43,056.00 | 0.05 |
| 442 | 002539 | 云图控股 | 3,800  | 43,016.00 | 0.05 |
| 443 | 300031 | 宝通科技 | 1,500  | 42,855.00 | 0.05 |
| 444 | 000917 | 电广传媒 | 6,400  | 42,816.00 | 0.05 |
| 445 | 600546 | 山煤国际 | 3,900  | 42,627.00 | 0.05 |
| 446 | 688063 | 派能科技 | 800    | 42,616.00 | 0.05 |
| 447 | 603338 | 浙江鼎力 | 1,000  | 42,500.00 | 0.05 |
| 448 | 603816 | 顾家家居 | 1,900  | 42,484.00 | 0.05 |
| 449 | 000833 | 粤桂股份 | 1,800  | 42,156.00 | 0.05 |
| 450 | 601609 | 金田股份 | 3,900  | 42,120.00 | 0.05 |
| 451 | 600867 | 通化东宝 | 5,200  | 41,808.00 | 0.05 |
| 452 | 688779 | 五矿新能 | 5,129  | 41,596.19 | 0.05 |
| 453 | 301510 | 固高科技 | 1,300  | 41,509.00 | 0.05 |
| 454 | 003022 | 联泓新科 | 1,600  | 41,440.00 | 0.05 |
| 455 | 600458 | 时代新材 | 2,500  | 41,375.00 | 0.05 |
| 456 | 300244 | 迪安诊断 | 2,200  | 41,228.00 | 0.05 |
| 457 | 601111 | 中国国航 | 6,800  | 41,140.00 | 0.05 |
| 458 | 600329 | 达仁堂  | 1,100  | 40,942.00 | 0.05 |
| 459 | 002498 | 汉缆股份 | 6,000  | 40,920.00 | 0.05 |
| 460 | 000975 | 山金国际 | 2,400  | 40,800.00 | 0.05 |
| 461 | 601666 | 平煤股份 | 5,700  | 40,755.00 | 0.05 |
| 462 | 600490 | 鹏欣资源 | 7,000  | 40,740.00 | 0.05 |
| 463 | 000758 | 中色股份 | 6,200  | 40,734.00 | 0.05 |
| 464 | 600685 | 中船防务 | 1,600  | 40,704.00 | 0.05 |
| 465 | 688006 | 杭可科技 | 1,112  | 40,643.60 | 0.05 |
| 466 | 600415 | 小商品城 | 4,000  | 40,640.00 | 0.05 |
| 467 | 603613 | 国联股份 | 2,200  | 40,524.00 | 0.05 |
| 468 | 600380 | 健康元  | 4,300  | 40,506.00 | 0.05 |
| 469 | 600196 | 复星医药 | 1,800  | 40,446.00 | 0.05 |
| 470 | 301275 | 汉朔科技 | 900    | 40,410.00 | 0.05 |
| 471 | 600029 | 南方航空 | 7,800  | 40,404.00 | 0.05 |
| 471 | 601788 | 光大证券 | 2,800  | 40,404.00 | 0.05 |
| 472 | 002312 | 川发龙蟒 | 4,400  | 40,348.00 | 0.05 |
| 473 | 600562 | 国睿科技 | 1,900  | 40,318.00 | 0.05 |
| 474 | 601156 | 东航物流 | 2,500  | 40,300.00 | 0.05 |
| 475 | 601187 | 厦门银行 | 5,900  | 40,297.00 | 0.05 |
| 476 | 601881 | 中国银河 | 3,200  | 40,224.00 | 0.05 |
| 477 | 603997 | 继峰股份 | 3,400  | 40,222.00 | 0.05 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 478 | 603565 | 中谷物流 | 4,100  | 40,221.00 | 0.05 |
| 479 | 000680 | 山推股份 | 4,000  | 40,200.00 | 0.05 |
| 480 | 000778 | 新兴铸管 | 10,700 | 39,697.00 | 0.05 |
| 481 | 600390 | 五矿资本 | 8,700  | 39,672.00 | 0.05 |
| 482 | 600619 | 海立股份 | 2,500  | 39,625.00 | 0.05 |
| 483 | 600233 | 圆通速递 | 2,500  | 39,375.00 | 0.05 |
| 484 | 002468 | 申通快递 | 2,700  | 39,312.00 | 0.05 |
| 484 | 300185 | 通裕重工 | 14,400 | 39,312.00 | 0.05 |
| 485 | 600120 | 浙江东方 | 9,100  | 39,130.00 | 0.05 |
| 486 | 600511 | 国药股份 | 1,500  | 39,060.00 | 0.05 |
| 487 | 601117 | 中国化学 | 5,300  | 38,955.00 | 0.05 |
| 488 | 002507 | 涪陵榨菜 | 3,600  | 38,880.00 | 0.05 |
| 489 | 600285 | 羚锐制药 | 2,000  | 38,760.00 | 0.05 |
| 490 | 300676 | 华大基因 | 1,100  | 38,566.00 | 0.04 |
| 491 | 600064 | 南京高科 | 5,400  | 38,502.00 | 0.04 |
| 492 | 600267 | 海正药业 | 3,800  | 38,418.00 | 0.04 |
| 493 | 600535 | 天士力  | 2,900  | 38,367.00 | 0.04 |
| 494 | 688088 | 虹软科技 | 1,079  | 38,358.45 | 0.04 |
| 495 | 603323 | 苏农银行 | 9,888  | 38,266.56 | 0.04 |
| 496 | 600372 | 中航机载 | 3,500  | 37,975.00 | 0.04 |
| 497 | 300130 | 新国都  | 1,800  | 37,872.00 | 0.04 |
| 498 | 000543 | 皖能电力 | 5,000  | 37,850.00 | 0.04 |
| 499 | 300034 | 钢研高纳 | 2,200  | 37,708.00 | 0.04 |
| 500 | 601877 | 正泰电器 | 1,500  | 37,605.00 | 0.04 |
| 501 | 603305 | 旭升集团 | 3,100  | 37,572.00 | 0.04 |
| 502 | 688281 | 华秦科技 | 744    | 37,371.12 | 0.04 |
| 503 | 600906 | 财达证券 | 5,000  | 37,300.00 | 0.04 |
| 504 | 301127 | 武汉天源 | 1,800  | 37,296.00 | 0.04 |
| 505 | 000598 | 兴蓉环境 | 5,800  | 37,236.00 | 0.04 |
| 506 | 600816 | 建元信托 | 15,200 | 37,088.00 | 0.04 |
| 507 | 601878 | 浙商证券 | 3,900  | 37,050.00 | 0.04 |
| 508 | 600559 | 老白干酒 | 3,300  | 36,960.00 | 0.04 |
| 509 | 688336 | 三生国健 | 696    | 36,957.60 | 0.04 |
| 510 | 002170 | 芭田股份 | 3,400  | 36,924.00 | 0.04 |
| 511 | 000685 | 中山公用 | 3,300  | 36,828.00 | 0.04 |
| 512 | 002439 | 启明星辰 | 2,900  | 36,685.00 | 0.04 |
| 513 | 301606 | 绿联科技 | 600    | 36,612.00 | 0.04 |
| 514 | 300725 | 药石科技 | 1,000  | 36,600.00 | 0.04 |
| 515 | 300718 | 长盛轴承 | 600    | 36,582.00 | 0.04 |
| 516 | 601333 | 广深铁路 | 13,300 | 36,575.00 | 0.04 |
| 517 | 000963 | 华东医药 | 1,300  | 36,556.00 | 0.04 |
| 518 | 002244 | 滨江集团 | 4,800  | 36,480.00 | 0.04 |
| 519 | 002276 | 万马股份 | 3,600  | 36,396.00 | 0.04 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 519 | 600739 | 辽宁成大 | 3,600  | 36,396.00 | 0.04 |
| 520 | 002299 | 圣农发展 | 2,400  | 36,384.00 | 0.04 |
| 520 | 300735 | 光弘科技 | 1,600  | 36,384.00 | 0.04 |
| 521 | 600320 | 振华重工 | 8,800  | 36,344.00 | 0.04 |
| 522 | 600509 | 天富能源 | 4,300  | 36,335.00 | 0.04 |
| 523 | 600726 | 华电能源 | 5,100  | 36,312.00 | 0.04 |
| 524 | 601963 | 重庆银行 | 3,600  | 36,288.00 | 0.04 |
| 525 | 688321 | 微芯生物 | 1,378  | 36,282.74 | 0.04 |
| 526 | 688612 | 威迈斯  | 1,218  | 36,040.62 | 0.04 |
| 527 | 300457 | 赢合科技 | 1,700  | 35,836.00 | 0.04 |
| 528 | 600967 | 内蒙一机 | 3,300  | 35,805.00 | 0.04 |
| 529 | 300098 | 高新兴  | 7,800  | 35,802.00 | 0.04 |
| 530 | 000581 | 威孚高科 | 2,100  | 35,742.00 | 0.04 |
| 531 | 300618 | 寒锐钴业 | 1,000  | 35,700.00 | 0.04 |
| 532 | 600741 | 华域汽车 | 2,300  | 35,696.00 | 0.04 |
| 533 | 002120 | 韵达股份 | 5,600  | 35,616.00 | 0.04 |
| 534 | 688016 | 心脉医疗 | 400    | 35,456.00 | 0.04 |
| 535 | 000883 | 湖北能源 | 8,200  | 35,424.00 | 0.04 |
| 536 | 300861 | 美畅股份 | 1,400  | 35,266.00 | 0.04 |
| 537 | 300146 | 汤臣倍健 | 3,900  | 35,256.00 | 0.04 |
| 538 | 603638 | 艾迪精密 | 1,500  | 35,175.00 | 0.04 |
| 539 | 600908 | 无锡银行 | 6,900  | 35,052.00 | 0.04 |
| 540 | 000027 | 深圳能源 | 5,600  | 34,720.00 | 0.04 |
| 541 | 002063 | 远光软件 | 6,800  | 34,680.00 | 0.04 |
| 542 | 600633 | 浙数文化 | 3,400  | 34,612.00 | 0.04 |
| 543 | 688717 | 艾罗能源 | 419    | 34,596.83 | 0.04 |
| 544 | 002925 | 盈趣科技 | 1,400  | 34,524.00 | 0.04 |
| 545 | 000810 | 创维数字 | 2,600  | 34,450.00 | 0.04 |
| 546 | 300855 | 图南股份 | 1,100  | 34,386.00 | 0.04 |
| 547 | 002338 | 奥普光电 | 600    | 34,320.00 | 0.04 |
| 548 | 600216 | 浙江医药 | 3,000  | 34,200.00 | 0.04 |
| 549 | 601222 | 林洋能源 | 6,400  | 34,048.00 | 0.04 |
| 550 | 601866 | 中远海发 | 15,400 | 34,034.00 | 0.04 |
| 551 | 600933 | 爱柯迪  | 2,300  | 33,994.00 | 0.04 |
| 552 | 600072 | 中船科技 | 4,000  | 33,960.00 | 0.04 |
| 553 | 002568 | 百润股份 | 2,000  | 33,840.00 | 0.04 |
| 554 | 002020 | 京新药业 | 2,700  | 33,723.00 | 0.04 |
| 555 | 002023 | 海特高新 | 2,600  | 33,696.00 | 0.04 |
| 556 | 688686 | 奥普特  | 200    | 33,678.00 | 0.04 |
| 557 | 002701 | 奥瑞金  | 7,900  | 33,654.00 | 0.04 |
| 558 | 600210 | 紫江企业 | 5,400  | 33,480.00 | 0.04 |
| 559 | 001979 | 招商蛇口 | 5,200  | 33,436.00 | 0.04 |
| 560 | 002158 | 汉钟精机 | 900    | 33,372.00 | 0.04 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 561 | 000088 | 盐田港  | 8,100  | 33,129.00 | 0.04 |
| 562 | 001337 | 四川黄金 | 900    | 32,994.00 | 0.04 |
| 563 | 002421 | 达实智能 | 9,500  | 32,965.00 | 0.04 |
| 564 | 600258 | 首旅酒店 | 3,000  | 32,760.00 | 0.04 |
| 564 | 600801 | 华新建材 | 2,100  | 32,760.00 | 0.04 |
| 564 | 603300 | 海南华铁 | 7,200  | 32,760.00 | 0.04 |
| 565 | 000791 | 甘肃能源 | 4,300  | 32,680.00 | 0.04 |
| 566 | 300357 | 我武生物 | 1,400  | 32,648.00 | 0.04 |
| 567 | 603612 | 索通发展 | 1,800  | 32,634.00 | 0.04 |
| 568 | 600850 | 电科数字 | 2,240  | 32,614.40 | 0.04 |
| 569 | 300416 | 苏试试验 | 1,600  | 32,608.00 | 0.04 |
| 570 | 603337 | 杰克科技 | 900    | 32,607.00 | 0.04 |
| 571 | 301571 | 国科天成 | 500    | 32,590.00 | 0.04 |
| 572 | 600754 | 锦江酒店 | 1,800  | 32,382.00 | 0.04 |
| 573 | 000902 | 新洋丰  | 2,800  | 32,368.00 | 0.04 |
| 574 | 601021 | 春秋航空 | 700    | 31,906.00 | 0.04 |
| 575 | 002091 | 江苏国泰 | 4,400  | 31,812.00 | 0.04 |
| 576 | 601898 | 中煤能源 | 2,600  | 31,668.00 | 0.04 |
| 577 | 600517 | 国网英大 | 6,700  | 31,356.00 | 0.04 |
| 578 | 600655 | 豫园股份 | 7,600  | 31,236.00 | 0.04 |
| 579 | 300761 | 立华股份 | 1,900  | 31,179.00 | 0.04 |
| 580 | 002541 | 鸿路钢构 | 1,800  | 31,176.00 | 0.04 |
| 581 | 000709 | 河钢股份 | 16,000 | 31,040.00 | 0.04 |
| 582 | 600572 | 康恩贝  | 7,900  | 30,968.00 | 0.04 |
| 583 | 002832 | 比音勒芬 | 1,500  | 30,960.00 | 0.04 |
| 584 | 002077 | 大港股份 | 1,600  | 30,864.00 | 0.04 |
| 585 | 002011 | 盾安环境 | 2,900  | 30,769.00 | 0.04 |
| 586 | 002635 | 安洁科技 | 1,500  | 30,675.00 | 0.04 |
| 587 | 603530 | 神马电力 | 600    | 30,540.00 | 0.04 |
| 588 | 688486 | 龙迅股份 | 480    | 30,518.40 | 0.04 |
| 589 | 001286 | 陕西能源 | 3,000  | 30,420.00 | 0.04 |
| 590 | 600598 | 北大荒  | 2,800  | 30,352.00 | 0.04 |
| 591 | 600993 | 马应龙  | 1,400  | 30,268.00 | 0.04 |
| 592 | 002458 | 益生股份 | 3,890  | 30,225.30 | 0.04 |
| 593 | 688337 | 普源精电 | 400    | 29,972.00 | 0.03 |
| 594 | 002906 | 华阳集团 | 1,200  | 29,952.00 | 0.03 |
| 595 | 600361 | 创新新材 | 8,300  | 29,880.00 | 0.03 |
| 596 | 688209 | 英集芯  | 1,027  | 29,865.16 | 0.03 |
| 597 | 300415 | 伊之密  | 1,500  | 29,865.00 | 0.03 |
| 598 | 300723 | 一品红  | 800    | 29,824.00 | 0.03 |
| 599 | 301589 | 诺瓦星云 | 200    | 29,796.00 | 0.03 |
| 600 | 600056 | 中国医药 | 3,400  | 29,750.00 | 0.03 |
| 601 | 600039 | 四川路桥 | 3,800  | 29,716.00 | 0.03 |

|     |        |        |       |           |      |
|-----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 602 | 601800 | 中国交建   | 5,200 | 29,692.00 | 0.03 |
| 603 | 002416 | 爱施德    | 3,300 | 29,568.00 | 0.03 |
| 604 | 600389 | 江山股份   | 1,500 | 29,280.00 | 0.03 |
| 605 | 300529 | 健帆生物   | 1,900 | 29,260.00 | 0.03 |
| 606 | 301458 | 钧崴电子   | 500   | 29,230.00 | 0.03 |
| 607 | 603858 | 步长制药   | 2,000 | 29,200.00 | 0.03 |
| 608 | 605123 | 派克新材   | 300   | 29,103.00 | 0.03 |
| 609 | 600744 | 华银电力   | 4,500 | 28,935.00 | 0.03 |
| 610 | 603899 | 晨光股份   | 1,400 | 28,882.00 | 0.03 |
| 611 | 688029 | 南微医学   | 400   | 28,720.00 | 0.03 |
| 612 | 600771 | 广誉远    | 2,200 | 28,490.00 | 0.03 |
| 613 | 603713 | 密尔克卫   | 400   | 28,468.00 | 0.03 |
| 614 | 688349 | 三一重能   | 1,873 | 28,432.14 | 0.03 |
| 615 | 002251 | 步步高    | 8,400 | 28,392.00 | 0.03 |
| 616 | 600528 | 中铁工业   | 4,300 | 28,337.00 | 0.03 |
| 617 | 000600 | 建投能源   | 3,200 | 28,000.00 | 0.03 |
| 618 | 002258 | 利尔化学   | 2,200 | 27,962.00 | 0.03 |
| 619 | 002004 | 华邦健康   | 7,100 | 27,903.00 | 0.03 |
| 620 | 000089 | 深圳机场   | 4,600 | 27,738.00 | 0.03 |
| 621 | 600776 | 东方通信   | 2,100 | 27,594.00 | 0.03 |
| 622 | 600037 | 歌华有线   | 4,400 | 27,588.00 | 0.03 |
| 623 | 601098 | 中南传媒   | 2,800 | 27,552.00 | 0.03 |
| 624 | 688187 | 时代电气   | 400   | 27,464.00 | 0.03 |
| 625 | 601101 | 昊华能源   | 2,600 | 27,456.00 | 0.03 |
| 626 | 000786 | 北新建材   | 1,500 | 27,135.00 | 0.03 |
| 627 | 603233 | 大参林    | 1,800 | 27,054.00 | 0.03 |
| 628 | 300079 | 数码视讯   | 6,400 | 26,880.00 | 0.03 |
| 629 | 600968 | 海油发展   | 8,000 | 26,640.00 | 0.03 |
| 630 | 002668 | TCL 智家 | 2,400 | 26,592.00 | 0.03 |
| 630 | 600480 | 凌云股份   | 3,200 | 26,592.00 | 0.03 |
| 631 | 001965 | 招商公路   | 2,900 | 26,564.00 | 0.03 |
| 632 | 002226 | 江南化工   | 5,900 | 26,491.00 | 0.03 |
| 633 | 002006 | 精工科技   | 1,800 | 26,478.00 | 0.03 |
| 634 | 601069 | 西部黄金   | 1,200 | 26,400.00 | 0.03 |
| 635 | 601928 | 凤凰传媒   | 3,000 | 26,370.00 | 0.03 |
| 636 | 002508 | 老板电器   | 1,800 | 26,316.00 | 0.03 |
| 637 | 000990 | 诚志股份   | 3,200 | 26,176.00 | 0.03 |
| 638 | 600211 | 西藏药业   | 700   | 26,173.00 | 0.03 |
| 639 | 600587 | 新华医疗   | 2,200 | 26,136.00 | 0.03 |
| 640 | 002315 | 焦点科技   | 1,120 | 26,073.60 | 0.03 |
| 641 | 688083 | 中望软件   | 401   | 25,964.75 | 0.03 |
| 642 | 000650 | 仁和药业   | 5,100 | 25,959.00 | 0.03 |
| 643 | 600827 | 百联股份   | 3,500 | 25,935.00 | 0.03 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 644 | 000156 | 华数传媒 | 4,100 | 25,871.00 | 0.03 |
| 645 | 300772 | 运达股份 | 2,100 | 25,830.00 | 0.03 |
| 646 | 605507 | 国邦医药 | 1,740 | 25,752.00 | 0.03 |
| 647 | 002345 | 潮宏基  | 2,800 | 25,676.00 | 0.03 |
| 648 | 600062 | 华润双鹤 | 1,600 | 25,664.00 | 0.03 |
| 649 | 688050 | 爱博医疗 | 704   | 25,660.80 | 0.03 |
| 650 | 300337 | 银邦股份 | 2,200 | 25,652.00 | 0.03 |
| 651 | 603194 | 中力股份 | 700   | 25,592.00 | 0.03 |
| 652 | 002292 | 奥飞娱乐 | 3,900 | 25,584.00 | 0.03 |
| 653 | 002215 | 诺普信  | 3,100 | 25,513.00 | 0.03 |
| 654 | 002043 | 兔宝宝  | 2,300 | 25,484.00 | 0.03 |
| 655 | 603118 | 共进股份 | 2,100 | 25,431.00 | 0.03 |
| 656 | 600916 | 中国黄金 | 3,700 | 25,308.00 | 0.03 |
| 657 | 600315 | 上海家化 | 1,500 | 25,230.00 | 0.03 |
| 658 | 600688 | 上海石化 | 8,600 | 25,198.00 | 0.03 |
| 659 | 300888 | 稳健医疗 | 900   | 25,191.00 | 0.03 |
| 660 | 002557 | 洽洽食品 | 1,400 | 25,144.00 | 0.03 |
| 661 | 002233 | 塔牌集团 | 3,600 | 25,092.00 | 0.03 |
| 662 | 002985 | 北摩高科 | 900   | 24,930.00 | 0.03 |
| 663 | 002051 | 中工国际 | 2,200 | 24,904.00 | 0.03 |
| 664 | 600717 | 天津港  | 6,400 | 24,896.00 | 0.03 |
| 665 | 300047 | 天源迪科 | 2,800 | 24,864.00 | 0.03 |
| 666 | 600098 | 广州发展 | 4,200 | 24,822.00 | 0.03 |
| 667 | 600295 | 鄂尔多斯 | 2,300 | 24,656.00 | 0.03 |
| 668 | 601607 | 上海医药 | 1,600 | 24,640.00 | 0.03 |
| 669 | 603809 | 豪能股份 | 2,800 | 24,556.00 | 0.03 |
| 670 | 601890 | 亚星锚链 | 3,000 | 24,510.00 | 0.03 |
| 671 | 002928 | 华夏航空 | 3,500 | 24,465.00 | 0.03 |
| 672 | 301238 | 瑞泰新材 | 1,000 | 24,400.00 | 0.03 |
| 673 | 300363 | 博腾股份 | 1,500 | 24,360.00 | 0.03 |
| 674 | 603533 | 掌阅科技 | 1,200 | 24,348.00 | 0.03 |
| 675 | 603733 | 仙鹤股份 | 900   | 24,309.00 | 0.03 |
| 676 | 600787 | 中储股份 | 5,800 | 24,244.00 | 0.03 |
| 677 | 600061 | 国投资本 | 3,700 | 24,235.00 | 0.03 |
| 678 | 600116 | 三峡水利 | 4,300 | 24,080.00 | 0.03 |
| 679 | 000966 | 长源电力 | 6,100 | 23,912.00 | 0.03 |
| 680 | 301087 | 可孚医疗 | 500   | 23,825.00 | 0.03 |
| 681 | 603039 | 泛微网络 | 660   | 23,806.20 | 0.03 |
| 682 | 002032 | 苏泊尔  | 600   | 23,760.00 | 0.03 |
| 683 | 000617 | 中油资本 | 3,600 | 23,724.00 | 0.03 |
| 684 | 300628 | 亿联网络 | 700   | 23,674.00 | 0.03 |
| 685 | 600808 | 马钢股份 | 9,400 | 23,500.00 | 0.03 |
| 686 | 600502 | 安徽建工 | 5,400 | 23,490.00 | 0.03 |

|     |        |       |       |           |      |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 687 | 002017 | 东信和平  | 1,600 | 23,408.00 | 0.03 |
| 688 | 000049 | 德赛电池  | 1,000 | 23,370.00 | 0.03 |
| 689 | 302132 | 中航成飞  | 400   | 23,328.00 | 0.03 |
| 690 | 002125 | 湘潭电化  | 1,700 | 23,222.00 | 0.03 |
| 691 | 000983 | 山西焦煤  | 4,000 | 23,200.00 | 0.03 |
| 692 | 000539 | 粤电力 A | 3,400 | 23,154.00 | 0.03 |
| 693 | 301345 | 涛涛车业  | 100   | 23,100.00 | 0.03 |
| 694 | 000880 | 潍柴重机  | 1,000 | 23,010.00 | 0.03 |
| 695 | 603826 | 坤彩科技  | 900   | 23,004.00 | 0.03 |
| 696 | 000676 | 智度股份  | 4,500 | 22,995.00 | 0.03 |
| 697 | 688472 | 阿特斯   | 2,124 | 22,981.68 | 0.03 |
| 698 | 301487 | 盟固利   | 1,200 | 22,980.00 | 0.03 |
| 698 | 603496 | 恒为科技  | 1,000 | 22,980.00 | 0.03 |
| 699 | 600515 | 海南机场  | 8,300 | 22,742.00 | 0.03 |
| 700 | 002204 | 大连重工  | 4,300 | 22,704.00 | 0.03 |
| 701 | 601061 | 中信金属  | 2,100 | 22,617.00 | 0.03 |
| 702 | 300075 | 数字政通  | 2,200 | 22,484.00 | 0.03 |
| 703 | 000589 | 贵州轮胎  | 5,500 | 22,330.00 | 0.03 |
| 704 | 300925 | 法本信息  | 1,500 | 22,185.00 | 0.03 |
| 705 | 688563 | 航材股份  | 433   | 22,182.59 | 0.03 |
| 706 | 300580 | 贝斯特   | 1,100 | 22,121.00 | 0.03 |
| 707 | 002221 | 东华能源  | 4,200 | 22,092.00 | 0.03 |
| 708 | 600710 | 苏美达   | 2,300 | 21,988.00 | 0.03 |
| 709 | 603883 | 老百姓   | 2,000 | 21,920.00 | 0.03 |
| 710 | 600266 | 城建发展  | 5,600 | 21,896.00 | 0.03 |
| 711 | 300428 | 立中集团  | 1,200 | 21,816.00 | 0.03 |
| 712 | 300443 | 金雷股份  | 1,000 | 21,580.00 | 0.03 |
| 713 | 000552 | 甘肃能化  | 9,600 | 21,504.00 | 0.03 |
| 714 | 600686 | 金龙汽车  | 1,900 | 21,451.00 | 0.02 |
| 715 | 600395 | 盘江股份  | 4,700 | 21,432.00 | 0.02 |
| 716 | 601969 | 海南矿业  | 2,700 | 21,357.00 | 0.02 |
| 717 | 300999 | 金龙鱼   | 900   | 20,934.00 | 0.02 |
| 718 | 300298 | 三诺生物  | 1,500 | 20,925.00 | 0.02 |
| 719 | 301500 | 飞南资源  | 800   | 20,840.00 | 0.02 |
| 720 | 600123 | 兰花科创  | 3,900 | 20,826.00 | 0.02 |
| 721 | 601369 | 陕鼓动力  | 2,300 | 20,815.00 | 0.02 |
| 722 | 600125 | 铁龙物流  | 4,100 | 20,787.00 | 0.02 |
| 723 | 600018 | 上港集团  | 4,400 | 20,768.00 | 0.02 |
| 724 | 000848 | 承德露露  | 2,800 | 20,720.00 | 0.02 |
| 725 | 002608 | 江苏国信  | 3,000 | 20,700.00 | 0.02 |
| 726 | 002588 | 史丹利   | 2,600 | 20,540.00 | 0.02 |
| 727 | 301363 | 美好医疗  | 1,120 | 20,529.60 | 0.02 |
| 728 | 600059 | 古越龙山  | 2,800 | 20,496.00 | 0.02 |

|     |        |      |        |           |      |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 729 | 603888 | 新华网  | 1,200  | 20,436.00 | 0.02 |
| 730 | 600339 | 中油工程 | 6,600  | 20,262.00 | 0.02 |
| 731 | 000999 | 华润三九 | 900    | 20,241.00 | 0.02 |
| 732 | 000061 | 农产品  | 3,600  | 20,160.00 | 0.02 |
| 732 | 300678 | 中科信息 | 900    | 20,160.00 | 0.02 |
| 733 | 002605 | 姚记科技 | 1,100  | 20,097.00 | 0.02 |
| 734 | 600664 | 哈药股份 | 6,700  | 20,033.00 | 0.02 |
| 735 | 600033 | 福建高速 | 6,200  | 19,964.00 | 0.02 |
| 736 | 603171 | 税友股份 | 500    | 19,925.00 | 0.02 |
| 737 | 601326 | 秦港股份 | 6,300  | 19,908.00 | 0.02 |
| 738 | 300226 | 上海钢联 | 1,300  | 19,903.00 | 0.02 |
| 739 | 002761 | 浙江建投 | 3,000  | 19,890.00 | 0.02 |
| 740 | 603100 | 川仪股份 | 1,100  | 19,855.00 | 0.02 |
| 741 | 601200 | 上海环境 | 3,000  | 19,800.00 | 0.02 |
| 741 | 603556 | 海兴电力 | 900    | 19,800.00 | 0.02 |
| 742 | 600757 | 长江传媒 | 2,700  | 19,737.00 | 0.02 |
| 743 | 603195 | 公牛集团 | 500    | 19,575.00 | 0.02 |
| 744 | 603197 | 保隆科技 | 700    | 19,558.00 | 0.02 |
| 745 | 000950 | 重药控股 | 3,900  | 19,539.00 | 0.02 |
| 746 | 600606 | 绿地控股 | 16,100 | 19,481.00 | 0.02 |
| 747 | 002061 | 浙江交科 | 5,900  | 19,470.00 | 0.02 |
| 748 | 000928 | 中钢国际 | 3,900  | 19,422.00 | 0.02 |
| 749 | 300140 | 节能环保 | 3,900  | 19,383.00 | 0.02 |
| 750 | 600928 | 西安银行 | 5,900  | 19,293.00 | 0.02 |
| 751 | 600882 | 妙可蓝多 | 1,200  | 19,188.00 | 0.02 |
| 752 | 605599 | 菜百股份 | 1,400  | 19,180.00 | 0.02 |
| 753 | 600764 | 中国海防 | 1,100  | 19,173.00 | 0.02 |
| 754 | 300841 | 康华生物 | 400    | 19,024.00 | 0.02 |
| 755 | 688169 | 石头科技 | 200    | 18,994.00 | 0.02 |
| 756 | 000708 | 中信特钢 | 1,500  | 18,930.00 | 0.02 |
| 757 | 300770 | 新媒股份 | 600    | 18,894.00 | 0.02 |
| 758 | 600729 | 重庆百货 | 1,000  | 18,780.00 | 0.02 |
| 759 | 600971 | 恒源煤电 | 2,700  | 18,630.00 | 0.02 |
| 760 | 002511 | 中顺洁柔 | 2,800  | 18,620.00 | 0.02 |
| 761 | 002216 | 三全食品 | 1,600  | 18,448.00 | 0.02 |
| 762 | 600305 | 恒顺醋业 | 2,900  | 18,299.00 | 0.02 |
| 763 | 301600 | 慧翰股份 | 200    | 18,280.00 | 0.02 |
| 764 | 603317 | 天味食品 | 1,400  | 18,214.00 | 0.02 |
| 765 | 688475 | 萤石网络 | 664    | 18,160.40 | 0.02 |
| 766 | 002563 | 森马服饰 | 3,600  | 18,144.00 | 0.02 |
| 767 | 600006 | 东风股份 | 3,500  | 17,955.00 | 0.02 |
| 768 | 002941 | 新疆交建 | 1,900  | 17,936.00 | 0.02 |
| 769 | 603049 | 中策橡胶 | 400    | 17,924.00 | 0.02 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 770 | 600740 | 山西焦化 | 5,600 | 17,864.00 | 0.02 |
| 771 | 002516 | 旷达科技 | 3,200 | 17,856.00 | 0.02 |
| 772 | 000828 | 东莞控股 | 1,900 | 17,784.00 | 0.02 |
| 773 | 000028 | 国药一致 | 940   | 17,775.40 | 0.02 |
| 774 | 601163 | 三角轮胎 | 1,400 | 17,766.00 | 0.02 |
| 775 | 002243 | 力合科创 | 2,700 | 17,739.00 | 0.02 |
| 776 | 603128 | 华贸物流 | 3,500 | 17,675.00 | 0.02 |
| 777 | 600557 | 康缘药业 | 1,500 | 17,655.00 | 0.02 |
| 778 | 300783 | 三只松鼠 | 1,100 | 17,380.00 | 0.02 |
| 779 | 600720 | 中交设计 | 3,600 | 17,352.00 | 0.02 |
| 780 | 601018 | 宁波港  | 5,500 | 17,325.00 | 0.02 |
| 781 | 300119 | 瑞普生物 | 1,200 | 17,316.00 | 0.02 |
| 782 | 002351 | 漫步者  | 1,900 | 17,271.00 | 0.02 |
| 783 | 603508 | 思维列控 | 800   | 17,088.00 | 0.02 |
| 784 | 603915 | 国茂股份 | 1,200 | 17,028.00 | 0.02 |
| 785 | 300284 | 苏文科  | 3,400 | 17,000.00 | 0.02 |
| 786 | 002946 | 新乳业  | 1,200 | 16,896.00 | 0.02 |
| 787 | 300127 | 银河磁体 | 600   | 16,770.00 | 0.02 |
| 788 | 002901 | 大博医疗 | 400   | 16,712.00 | 0.02 |
| 789 | 300768 | 迪普科技 | 1,200 | 16,524.00 | 0.02 |
| 790 | 603162 | 海通发展 | 1,840 | 16,504.80 | 0.02 |
| 791 | 301175 | 中科环保 | 3,300 | 16,335.00 | 0.02 |
| 792 | 601900 | 南方传媒 | 1,500 | 16,290.00 | 0.02 |
| 793 | 300413 | 芒果超媒 | 1,100 | 16,093.00 | 0.02 |
| 794 | 601033 | 永兴股份 | 1,200 | 16,080.00 | 0.02 |
| 795 | 301267 | 华夏眼科 | 1,100 | 16,049.00 | 0.02 |
| 796 | 000719 | 中原传媒 | 1,400 | 16,002.00 | 0.02 |
| 797 | 601019 | 山东出版 | 2,500 | 16,000.00 | 0.02 |
| 798 | 603383 | 顶点软件 | 600   | 15,936.00 | 0.02 |
| 799 | 300341 | 麦克奥迪 | 1,200 | 15,900.00 | 0.02 |
| 800 | 000059 | 华锦股份 | 4,200 | 15,750.00 | 0.02 |
| 801 | 601096 | 宏盛华源 | 3,600 | 15,624.00 | 0.02 |
| 802 | 000567 | 海德股份 | 2,600 | 15,522.00 | 0.02 |
| 803 | 688522 | 纳睿雷达 | 769   | 15,395.38 | 0.02 |
| 804 | 002697 | 红旗连锁 | 3,700 | 15,392.00 | 0.02 |
| 805 | 601500 | 通用股份 | 4,200 | 15,330.00 | 0.02 |
| 806 | 002399 | 海普瑞  | 1,700 | 15,266.00 | 0.02 |
| 807 | 600007 | 中国国贸 | 800   | 15,184.00 | 0.02 |
| 808 | 688351 | 微电生理 | 670   | 15,182.20 | 0.02 |
| 809 | 002060 | 广东建工 | 5,000 | 15,150.00 | 0.02 |
| 810 | 600020 | 中原高速 | 4,100 | 15,129.00 | 0.02 |
| 811 | 688128 | 中国电研 | 629   | 14,932.46 | 0.02 |
| 812 | 600810 | 神马股份 | 2,400 | 14,808.00 | 0.02 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 813 | 001914 | 招商积余 | 1,800 | 14,688.00 | 0.02 |
| 814 | 000550 | 江铃汽车 | 900   | 14,598.00 | 0.02 |
| 815 | 002737 | 葵花药业 | 1,300 | 14,573.00 | 0.02 |
| 816 | 300134 | 大富科技 | 1,700 | 14,535.00 | 0.02 |
| 817 | 603093 | 南华期货 | 800   | 14,520.00 | 0.02 |
| 818 | 600894 | 广日股份 | 1,900 | 14,478.00 | 0.02 |
| 819 | 002727 | 一心堂  | 1,500 | 14,385.00 | 0.02 |
| 820 | 300406 | 九强生物 | 1,300 | 14,209.00 | 0.02 |
| 821 | 601882 | 海天精工 | 700   | 14,161.00 | 0.02 |
| 822 | 601107 | 四川成渝 | 2,900 | 14,152.00 | 0.02 |
| 823 | 600927 | 永安期货 | 1,100 | 13,695.00 | 0.02 |
| 824 | 600639 | 浦东金桥 | 1,500 | 13,680.00 | 0.02 |
| 825 | 603025 | 大豪科技 | 1,000 | 13,640.00 | 0.02 |
| 826 | 002390 | 信邦制药 | 5,200 | 13,572.00 | 0.02 |
| 827 | 000597 | 东北制药 | 3,200 | 13,568.00 | 0.02 |
| 828 | 600508 | 上海能源 | 1,840 | 13,560.80 | 0.02 |
| 829 | 600640 | 国脉文化 | 1,400 | 13,538.00 | 0.02 |
| 830 | 603707 | 健友股份 | 1,900 | 13,433.00 | 0.02 |
| 831 | 301015 | 百洋医药 | 700   | 13,342.00 | 0.02 |
| 832 | 601801 | 皖新传媒 | 2,700 | 13,311.00 | 0.02 |
| 833 | 600903 | 贵州燃气 | 2,000 | 13,280.00 | 0.02 |
| 834 | 301592 | 六九一二 | 100   | 13,235.00 | 0.02 |
| 835 | 000557 | 西部创业 | 3,800 | 13,148.00 | 0.02 |
| 836 | 301207 | 华兰疫苗 | 800   | 13,032.00 | 0.02 |
| 837 | 002489 | 浙江永强 | 4,800 | 13,008.00 | 0.02 |
| 838 | 301047 | 义翘神州 | 200   | 12,912.00 | 0.02 |
| 838 | 688639 | 华恒生物 | 800   | 12,912.00 | 0.02 |
| 839 | 688696 | 极米科技 | 200   | 12,908.00 | 0.02 |
| 840 | 000899 | 赣能股份 | 1,300 | 12,558.00 | 0.01 |
| 841 | 600662 | 外服控股 | 3,100 | 12,493.00 | 0.01 |
| 842 | 301109 | 军信股份 | 1,000 | 12,460.00 | 0.01 |
| 843 | 301376 | 致欧科技 | 700   | 12,404.00 | 0.01 |
| 844 | 603043 | 广州酒家 | 1,000 | 12,400.00 | 0.01 |
| 845 | 600861 | 北京人力 | 1,000 | 12,200.00 | 0.01 |
| 846 | 600335 | 国机汽车 | 2,600 | 12,168.00 | 0.01 |
| 847 | 603327 | 福蓉科技 | 1,400 | 11,872.00 | 0.01 |
| 848 | 002041 | 登海种业 | 1,500 | 11,805.00 | 0.01 |
| 849 | 002053 | 云南能投 | 1,200 | 11,796.00 | 0.01 |
| 850 | 300492 | 华图山鼎 | 340   | 11,679.00 | 0.01 |
| 851 | 003006 | 百亚股份 | 800   | 11,608.00 | 0.01 |
| 852 | 301327 | 华宝新能 | 240   | 11,536.80 | 0.01 |
| 853 | 301565 | 中仑新材 | 500   | 11,395.00 | 0.01 |
| 854 | 688232 | 新点软件 | 640   | 11,379.20 | 0.01 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 855 | 601921 | 浙版传媒 | 1,700 | 11,373.00 | 0.01 |
| 856 | 603057 | 紫燕食品 | 500   | 11,150.00 | 0.01 |
| 857 | 002242 | 九阳股份 | 1,400 | 11,004.00 | 0.01 |
| 858 | 301101 | 明月镜片 | 400   | 10,896.00 | 0.01 |
| 859 | 301262 | 海看股份 | 600   | 10,782.00 | 0.01 |
| 860 | 601038 | 一拖股份 | 1,000 | 10,590.00 | 0.01 |
| 861 | 001308 | 康冠科技 | 500   | 10,430.00 | 0.01 |
| 862 | 002651 | 利君股份 | 1,400 | 10,234.00 | 0.01 |
| 863 | 301631 | 壹连科技 | 140   | 10,060.40 | 0.01 |
| 864 | 600618 | 氯碱化工 | 1,000 | 10,050.00 | 0.01 |
| 865 | 003039 | 顺控发展 | 900   | 9,909.00  | 0.01 |
| 866 | 301268 | 铭利达  | 700   | 9,786.00  | 0.01 |
| 867 | 301153 | 中科江南 | 600   | 9,774.00  | 0.01 |
| 868 | 002275 | 桂林三金 | 800   | 9,752.00  | 0.01 |
| 868 | 300917 | 特发服务 | 400   | 9,752.00  | 0.01 |
| 869 | 601808 | 中海油服 | 900   | 9,729.00  | 0.01 |
| 870 | 000885 | 城发环境 | 800   | 9,624.00  | 0.01 |
| 871 | 300856 | 科思股份 | 900   | 9,594.00  | 0.01 |
| 872 | 002287 | 奇正藏药 | 500   | 9,420.00  | 0.01 |
| 873 | 603055 | 台华新材 | 1,200 | 9,348.00  | 0.01 |
| 874 | 301215 | 中汽股份 | 1,700 | 8,823.00  | 0.01 |
| 875 | 000030 | 富奥股份 | 2,200 | 8,514.00  | 0.01 |
| 876 | 002543 | 万和电气 | 1,300 | 8,086.00  | 0.01 |
| 877 | 601298 | 青岛港  | 1,000 | 8,050.00  | 0.01 |
| 878 | 301339 | 通行宝  | 780   | 7,979.40  | 0.01 |
| 879 | 605009 | 豪悦护理 | 340   | 7,925.40  | 0.01 |
| 880 | 603013 | 亚普股份 | 500   | 7,895.00  | 0.01 |
| 881 | 301371 | 敷尔佳  | 300   | 7,800.00  | 0.01 |
| 882 | 605118 | 力鼎光电 | 200   | 6,978.00  | 0.01 |
| 883 | 301508 | 中机认检 | 300   | 6,942.00  | 0.01 |
| 884 | 605099 | 共创草坪 | 200   | 6,440.00  | 0.01 |
| 885 | 605011 | 杭州热电 | 400   | 6,184.00  | 0.01 |
| 886 | 601811 | 新华文轩 | 500   | 5,470.00  | 0.01 |

7.3.2 期末积极投资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

本报告期末本基金未持有积极投资的股票。

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  | 300750 | 宁德时代 | 1,568,006.00 | 5.11           |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 1,279,307.00 | 4.17           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 3  | 688498 | 源杰科技 | 812,262.00 | 2.65 |
| 4  | 601318 | 中国平安 | 638,113.00 | 2.08 |
| 5  | 600487 | 亨通光电 | 572,830.00 | 1.87 |
| 6  | 688256 | 寒武纪  | 557,580.07 | 1.82 |
| 7  | 603986 | 兆易创新 | 509,999.00 | 1.66 |
| 8  | 601899 | 紫金矿业 | 507,014.00 | 1.65 |
| 9  | 600900 | 长江电力 | 481,642.00 | 1.57 |
| 10 | 301308 | 江波龙  | 480,870.00 | 1.57 |
| 11 | 002384 | 东山精密 | 463,048.00 | 1.51 |
| 12 | 688981 | 中芯国际 | 462,021.61 | 1.51 |
| 13 | 688525 | 佰维存储 | 428,856.56 | 1.40 |
| 14 | 688347 | 华虹公司 | 425,496.22 | 1.39 |
| 15 | 000333 | 美的集团 | 418,371.00 | 1.36 |
| 16 | 688012 | 中微公司 | 385,814.34 | 1.26 |
| 17 | 300059 | 东方财富 | 381,166.00 | 1.24 |
| 18 | 002475 | 立讯精密 | 379,049.00 | 1.24 |
| 19 | 001309 | 德明利  | 374,641.00 | 1.22 |
| 20 | 300475 | 香农芯创 | 373,450.00 | 1.22 |

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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  | 300502 | 新易盛  | 427,239.20 | 1.39           |
| 2  | 300476 | 胜宏科技 | 371,908.00 | 1.21           |
| 3  | 688256 | 寒武纪  | 259,700.00 | 0.85           |
| 4  | 688498 | 源杰科技 | 212,908.00 | 0.69           |
| 5  | 300274 | 阳光电源 | 190,555.00 | 0.62           |
| 6  | 688981 | 中芯国际 | 176,654.88 | 0.58           |
| 7  | 002371 | 北方华创 | 174,687.00 | 0.57           |
| 8  | 688072 | 拓荆科技 | 141,424.00 | 0.46           |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 135,351.00 | 0.44           |
| 10 | 600919 | 江苏银行 | 130,115.00 | 0.42           |
| 11 | 600879 | 航天电子 | 128,993.00 | 0.42           |
| 12 | 600118 | 中国卫星 | 122,244.00 | 0.40           |
| 13 | 600309 | 万华化学 | 121,116.00 | 0.39           |
| 14 | 300750 | 宁德时代 | 119,526.00 | 0.39           |
| 15 | 300450 | 先导智能 | 119,196.00 | 0.39           |
| 16 | 300033 | 同花顺  | 117,067.00 | 0.38           |
| 17 | 601816 | 京沪高铁 | 116,636.00 | 0.38           |
| 18 | 688347 | 华虹公司 | 113,017.69 | 0.37           |

|    |        |      |            |      |
|----|--------|------|------------|------|
| 19 | 688676 | 金盘科技 | 112,862.79 | 0.37 |
| 20 | 600673 | 东阳光  | 112,589.00 | 0.37 |

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”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。

7.4.3 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 | 66,157,580.83 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 18,335,910.34 |

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

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

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货的投资中将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则：（1）避险：在市场风险大幅累积时，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；（2）有效管理：利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监

控，在大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

无。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同约定股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | -            |
| 2  | 应收清算款 | -            |
| 3  | 应收股利  | -            |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 5,165,850.93 |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 5,165,850.93 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别             | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额          | 占总<br>份额<br>比例<br>(%) |
| 中航中证智选均衡配置指数发起 A | 471              | 36,697.34     | 10,000,277.80 | 57.86             | 7,284,167.74  | 42.14                 |
| 中航中证智选均衡配置指数发起 C | 799              | 43,772.16     | 2,335,785.55  | 6.68              | 32,638,171.26 | 93.32                 |
| 合计               | 1,245            | 41,974.62     | 12,336,063.35 | 23.61             | 39,922,339.00 | 76.39                 |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别             | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|------------------|------------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 中航中证智选均衡配置指数发起 A | 263,873.24 | 1.53        |
|                  | 中航中证智选均衡配置指数发起 C | 40,810.72  | 0.12        |
|                  | 合计               | 304,683.96 | 0.58        |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别             | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 中航中证智选均衡配置指数发起 A | —                 |
|                                | 中航中证智选均衡配置指数发起 C | 0~10              |
|                                | 合计               | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 中航中证智选均衡配置指数发起 A | —                 |
|                                | 中航中证智选均衡配置指数发起 C | —                 |
|                                | 合计               | —                 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 (%) | 发起份额承诺持有期限 |
|----|--------|------------------|--------|------------------|------------|
|----|--------|------------------|--------|------------------|------------|

|             |               |       |               |       |     |
|-------------|---------------|-------|---------------|-------|-----|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,277.80 | 19.14 | 10,000,277.80 | 19.14 | 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -     | -             | -     | -   |
| 基金经理等人员     | -             | -     | -             | -     | -   |
| 基金管理人股东     | -             | -     | -             | -     | -   |
| 其他          | -             | -     | -             | -     | -   |
| 合计          | 10,000,277.80 | 19.14 | 10,000,277.80 | 19.14 | 3 年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                           | 中航中证智选均衡配置指数发起 A | 中航中证智选均衡配置指数发起 C |
|------------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日<br>(2025 年 3 月 19 日) |                  |                  |
| 基金份额总额                       | 10,472,386.66    | 6,139,809.85     |
| 本报告期期初基金份额总额                 | 12,415,326.61    | 10,293,127.50    |
| 本报告期基金总申购份额                  | 7,508,959.43     | 37,549,940.08    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                | 2,639,840.50     | 12,869,110.77    |
| 本报告期基金拆分变动份额                 | -                | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                 | 17,284,445.54    | 34,973,956.81    |

注：基金总申购份额包含基金红利再投、转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

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. 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
2. 2026 年 2 月 4 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2026 年 2 月 2 日起，宋鑫担任公司督察长职务，刘建不再担任公司督察长职务。
3. 2026 年 4 月 24 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更

的公告》。自 2026 年 4 月 22 日起，王楠担任公司副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

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

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

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，本基金管理人相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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 (%) |    |
| 中航证券有限公司   | 2      | 70,649,027.12 | 83.61            | 14,542.98 | 84.36          | -  |
| 华宝证券股份有限公司 | 2      | 13,844,464.05 | 16.39            | 2,696.60  | 15.64          | -  |

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式。

2、此处的佣金指本基金通过证券公司的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该证券公司的佣金合计，不单指股票交易佣金。

3、交易单元的选择标准和程序

选择标准：①实力雄厚，信誉良好；②研究、交易实力较强，选择需要支付研究服务费用的证券公司，应考察其研究服务能力，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；③财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；④经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

选择程序：①对合作证券公司研究机构实行评分制；②研究部根据证券公司研究机构的评分结果及交易单元租用协议的谈判结果向投资决策委员会申请开通交易单元或调整佣金；③中央交易室根据投资决策委员会决议与证券公司签订交易单元租用协议或券结协议。

4、本报告期内本基金减少 2 个证券交易单元。

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 |                  |
|------------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
|            | 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 (%) |
| 中航证券有限公司   | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 华宝证券股份有限公司 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

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  | 关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加泰信财富基金销售有限公司为销售机构的公告 | 上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 1 月 21 日 |
| 2  | 中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告    | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2026 年 1 月 22 日 |
| 3  | 中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                  | 上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 2 月 4 日  |
| 4  | 中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金更新的招募说明书           | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2026 年 3 月 19 日 |

|    |                                              |                           |                 |
|----|----------------------------------------------|---------------------------|-----------------|
|    | (2026 年第 1 号)                                |                           |                 |
| 5  | 中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新             | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2026 年 3 月 19 日 |
| 6  | 中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金 2025 年年度报告            | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2026 年 3 月 31 日 |
| 7  | 中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告        | 管理人网站、中国证监会基金电子披露网站       | 2026 年 4 月 22 日 |
| 8  | 中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告                      | 上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 4 月 24 日 |
| 9  | 关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告                  | 上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 6 月 9 日  |
| 10 | 关于中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金增加华泰证券股份有限公司为销售机构的公告 | 上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 6 月 15 日 |
| 11 | 中航基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司销售业务的公告       | 上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2026 年 6 月 16 日 |

§ 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              | 20260101-20260629       | 10,000,277.80 | -    | -    | 10,000,277.80 | 19.14   |

产品特有风险

本基金本报告期内存在单一持有人持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。当单一持有人持有份额超 20%时，将面临客户集中度较高的风险，对基金规模的稳定性带来隐患，可能的赎回将可能引发产品的流动性风险。本管理人将加强与客户的沟通，尽量了解申赎意向，审慎确认大额申购与大额赎回，提前做好投资计划，有效防控产品流动性风险，公平对待投资者，保障中小投资者合法权益，本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权，不受特定投资者的影响。

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. 中国证监会批准中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《中航中证智选均衡配置指数型发起式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
5. 报告期内中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金在规定媒体上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

中航基金管理有限公司，地址：北京市朝阳区天辰东路 1 号院亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 单元。

### 12.3 查阅方式

1. 营业时间内到本公司免费查阅
2. 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：[www.avicfund.cn](http://www.avicfund.cn)
3. 拨打本公司客户服务电话垂询：400-666-2186

中航基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日