

泓德智选启鑫混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年2月5日（基金合同生效日）起至2025年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	91
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	91
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	91
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	91
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	91
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
7.12 投资组合报告附注	92
§8 基金份额持有人信息	93
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	94
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	94
§9 开放式基金份额变动	95
§10 重大事件揭示	95
10.1 基金份额持有人大会决议	95
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	95
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	95
10.4 基金投资策略的改变	95
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	96
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	96
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	96
10.8 其他重大事件	97
§11 影响投资者决策的其他重要信息	99
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	99
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	99
§12 备查文件目录	99
12.1 备查文件目录	99
12.2 存放地点	100
12.3 查阅方式	100

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德智选启鑫混合型证券投资基金	
基金简称	泓德智选启鑫混合	
基金主代码	021965	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年02月05日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	50,157,076.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德智选启鑫混合A	泓德智选启鑫混合C
下属分级基金的交易代码	021965	021966
报告期末下属分级基金的份额总额	41,060,009.74份	9,097,066.55份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。在股票投资中，本基金运用基金管理人开发的"多因子选股模型"以及基本面选股等多种策略进行股票选择并据此构建股票投资组合。在债券投资中，本基金采取适当的久期配置策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、可交换债券配置策略、证券公司短期公司债券投资策略和资产支持证券投资策略。此外，本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货与国债期货投资，以调整投资组合的风险暴露程度，降低系统性风险。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×90%+中国债券综合全价

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	帅芳
	联系电话	010-59850151	021-38031815
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		4009-100-888	021-38917599-5
传真		010-59850195	021-38677819
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区 北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	中国（上海）自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街1 25号	上海市静安区新闻路669号博 华广场19楼
邮政编码		100088	200041
法定代表人		王德晓	朱健

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年02月05日（基金合同生效日）-2025年06月30日)	
	泓德智选启鑫混合 A	泓德智选启鑫混合 C
本期已实现收益	1,379,950.67	283,051.95
本期利润	2,553,508.17	651,522.35
加权平均基金份额本期利润	0.0443	0.0149
本期加权平均净值利润率	4.45%	1.50%
本期基金份额净值增长率	5.39%	5.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	期末可供分配利润	1,449,328.38305,178.06
	期末可供分配基金份额利润	0.03530.0335
	期末基金资产净值	43,272,163.599,570,884.79
	期末基金份额净值	1.05391.0521
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	5.39%5.21%

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

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

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

4、本基金基金合同生效日为2025年2月5日，本期财务报表的实际编制期间为2025年2月5日至2025年6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泓德智选启鑫混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.82%	0.59%	3.61%	0.66%	1.21%	-0.07%
过去三个月	6.53%	1.20%	2.55%	1.28%	3.98%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	5.39%	0.94%	6.28%	1.14%	-0.89%	-0.20%

泓德智选启鑫混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.79%	0.59%	3.61%	0.66%	1.18%	-0.07%
过去三个月	6.43%	1.20%	2.55%	1.28%	3.88%	-0.08%
自基金合同 生效起至今	5.21%	0.94%	6.28%	1.14%	-1.07%	-0.20%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

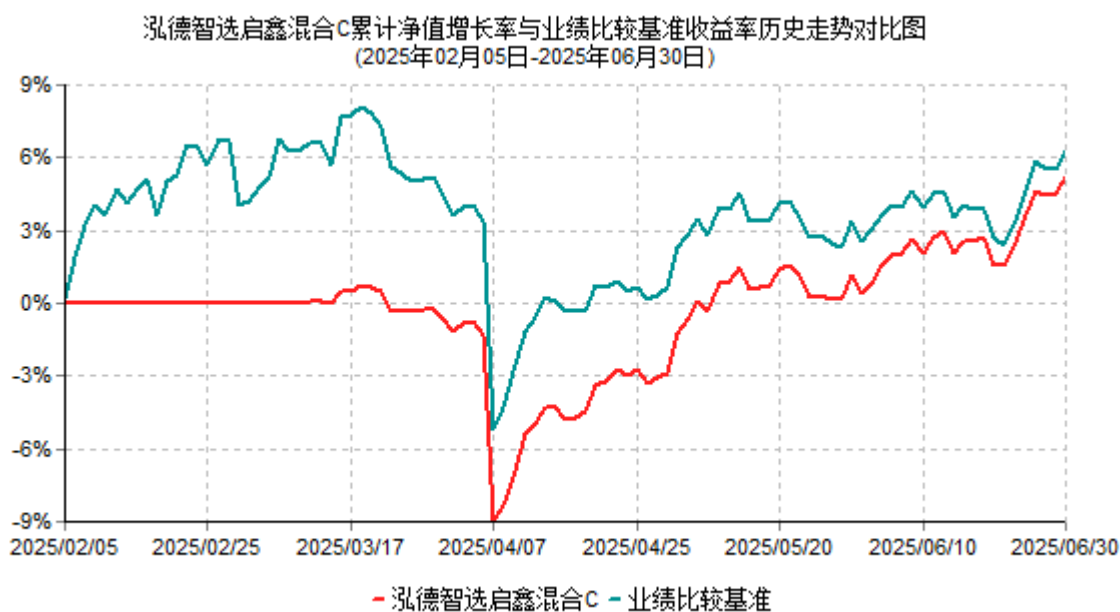
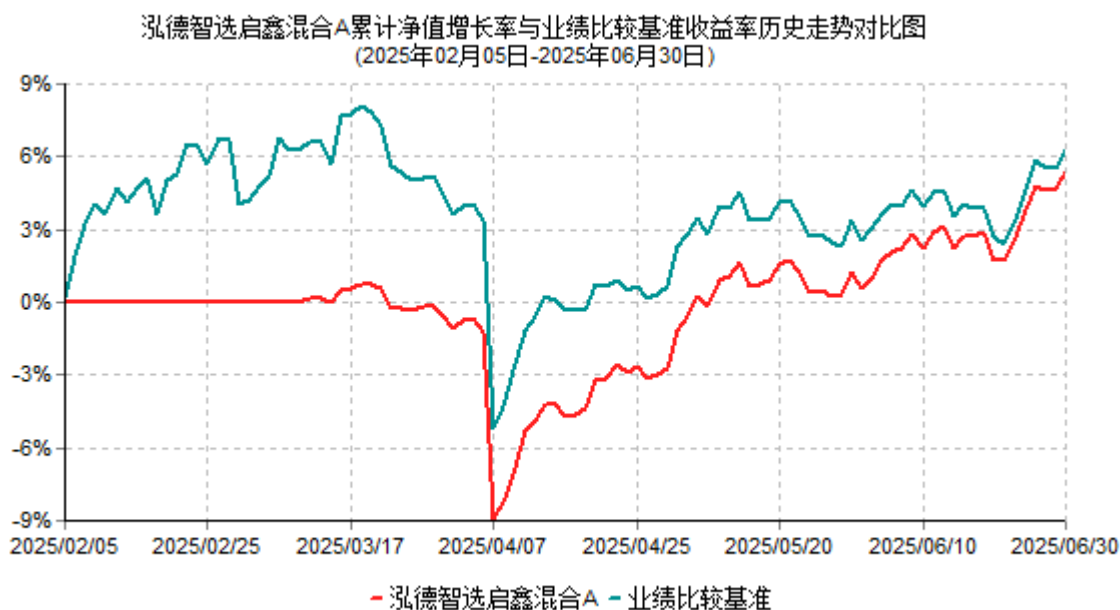
基准指数的构建原则如下：

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

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

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

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



注：1、本基金的基金合同于2025年2月5日生效，截至2025年6月30日止，本基金成立未
满1年。

2、本基金建仓期为6个月，截至2025年6月30日止，本基金建仓期尚未结束。

3、建仓期结束后，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

未来公司将继续秉持投资者利益至上的初心，不断精进，推动公司高质量发展。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
李子昂	本基金的基金经理、 智能投资部副总监	2025- 02-05	-	11年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。
刘令宇	本基金的基金经理	2025- 04-30	-	6年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任泰达宏利基金管理有限公司策略投资部研

					究员。
--	--	--	--	--	-----

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股整体呈现上涨趋势，成交量较为活跃，小盘股好于大盘股，成长风格优于价值风格，过去两年一枝独秀的红利板块出现回调，概念轮动此消彼长，年初的DeepSeek行情、一季度的机器人行情和贯穿整个上半年的创新药行情也让中国的硬科技价值得到重估。交投活跃且震荡向上的市场对量化策略也较为友好，虽然4月7日美国“对

等关税”推出导致市场短期出现恐慌，产品净值也有不小回撤，但超额收益总体稳健，我们在风格暴露上相对较为克制，努力避免因风格收益的大幅波动而造成的超额收益大幅波动，但同时我们也在努力迭代模型，力争让模型更好地适应市场。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德智选启鑫混合A基金份额净值为1.0539元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.39%，同期业绩比较基准收益率为6.28%；截至报告期末泓德智选启鑫混合C基金份额净值为1.0521元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为5.21%，同期业绩比较基准收益率为6.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年中国科技股出现了明显的估值修复，背后源于我们在硬科技研发上不断的厚积薄发，DeepSeek的横空出世让我们看到了我国自主大模型广阔的发展前景，机器人的百花齐放让我们看到了具身智能的可能性，我们在AI领域拥有大量的人才储备，广阔的下游市场空间和丰厚的资本支持，我们也有理由相信我国AI的发展不是昙花一现，未来的机会很多；创新药领域同样值得期待，我国FIC数量的占比显著提升、License-out交易额逐步提高，是对我国创新药领域政策扶持、融资便利和科学家红利的最好体现。当然，硬科技板块的繁荣和宽松的宏观环境与投资者较高的风险偏好息息相关。宏观方面，上半年宏观经济在险峻的外部环境下依然表现出较好韧性，GDP同比增长5.3%，在补贴等促消费政策的拉动下，消费成为促进GDP增长的主要动力，“抢出口”行为虽然一定程度上预支了出口需求，但也使得在二季度巨大关税威胁冲击下，出口依然对上半年经济增长做出较大贡献，投资总体承压，但结构有所改善，新质生产力加速发展。展望下半年，随着宏观政策的不断发力，国内大循环不断强化，经济稳中向好的发展态势不会改变。回到资本市场，市场的不断上涨也带动了投资者的做多热情，成交量稳步抬升，我们也会继续完善深度学习选股模型，努力通过多模型多策略的方式为投资者创造更好收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2025年06月30日，期末可供分配利润为1,754,506.44元，其中：泓德智选启鑫混合A期末可供分配利润为1,449,328.38元（泓德智选启鑫混合A的未分配利润已实现部分为1,449,328.38元，未分配利润未实现部分为762,825.47元），泓德智选启鑫混合C期末可供分配利润为305,178.06元（泓德智选启鑫混合C的未分配利润已实现部分为305,178.06元，未分配利润未实现部分为168,640.18元）。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在泓德智选启鑫混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、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。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德智选启鑫混合型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年06月30日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	5,742,402.07
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	43,235,642.08
其中：股票投资		43,226,241.69
基金投资		-
债券投资		9,400.39
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		4,430,103.90
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		53,408,148.05
负债和净资产	附注号	本期末

		2025年06月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		435,344.09
应付管理人报酬		48,241.89
应付托管费		6,030.22
应付销售服务费		3,175.55
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	72,307.92
负债合计		565,099.67
净 资 产：		
实收基金	6.4.7.7	50,157,076.29
未分配利润	6.4.7.8	2,685,972.09
净资产合计		52,843,048.38
负债和净资产总计		53,408,148.05

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额总额50,157,076.29份，其中A类基金份额总额为41,060,009.74份，基金份额净值为1.0539元；C类基金份额总额为9,097,066.55份，基金份额净值为1.0521元。

6.2 利润表

会计主体：泓德智选启鑫混合型证券投资基金

本报告期：2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
一、营业总收入		3,872,456.70
1.利息收入		331,496.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	331,496.58
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,702,184.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,128,684.30
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	1,967.97
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	571,532.00
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,542,027.90
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	296,747.95
减：二、营业总支出		667,426.18
1.管理人报酬		471,236.95
2.托管费		58,904.63
3.销售服务费		66,182.72
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-

7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.16	71,101.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,205,030.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,205,030.52
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,205,030.52

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选启鑫混合型证券投资基金

本报告期：2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	210,329,958.64	-	210,329,958.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-160,172,882.35	2,685,972.09	-157,486,910.26
（一）、综合收益总额	-	3,205,030.52	3,205,030.52
（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）	-160,172,882.35	-519,058.43	-160,691,940.78
其中：1.基金申购款	44,893,210.29	-649,769.58	44,243,440.71
2.基金赎回	-205,066,092.64	130,711.15	-204,935,381.49

款			
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	50,157,076.29	2,685,972.09	52,843,048.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓

基金管理人负责人

王德晓

主管会计工作负责人

王玲

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

泓德智选启鑫混合型证券投资基金（以下简称"本基金"）经中国证券监督管理委员会（以下简称"中国证监会"）证监许可[2024]1054号《关于准予泓德智选启鑫混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德智选启鑫混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式。存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集210,220,880.44元，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第80014975_A01号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德智选启鑫混合型证券投资基金基金合同》于2025年2月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为210,329,958.64份，其中认购资金利息折合109,078.20份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德智选启鑫混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标为本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年2月5日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2025年6月30日的财务状况以及2025年2月5日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年2月5日（基金合同生效日）至2025年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质

上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

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

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

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

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

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

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

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 2025年06月30日
活期存款	2,217,616.72
等于：本金	2,216,908.42
加：应计利息	708.30
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-

存款期限3个月以上	-
其他存款	3,524,785.35
等于：本金	3,524,744.30
加：应计利息	41.05
减：坏账准备	-
合计	5,742,402.07

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		41,684,213.79	-	43,226,241.69	1,542,027.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	9,400.00	0.39	9,400.39	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	9,400.00	0.39	9,400.39	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		41,693,613.79	0.39	43,235,642.08	1,542,027.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产
无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	271.80
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	69,901.88
其他应付	2,134.24
合计	72,307.92

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 泓德智选启鑫混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启鑫混合A)	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	78,875,557.80	78,875,557.80
本期申购	35,766,030.24	35,766,030.24
本期赎回（以“-”号填列）	-73,581,578.30	-73,581,578.30
本期末	41,060,009.74	41,060,009.74

6.4.7.7.2 泓德智选启鑫混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启鑫混合C)	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	131,454,400.84	131,454,400.84
本期申购	9,127,180.05	9,127,180.05
本期赎回（以“-”号填列）	-131,484,514.34	-131,484,514.34
本期末	9,097,066.55	9,097,066.55

注：1、申购含转换入份额。

2、本基金自2025年1月6日至2025年1月24日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币210,220,880.44元，折合为210,220,880.44份基金份额(其中A类基金份额78,835,471.06份，C类基金份额131,385,409.38份)。根据《泓德智选启鑫混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币109,078.20元。在本基金成立后，折算为109,078.20份基金份额(其中A类基金份额40,086.74份，C类基金份额68,991.46份)，划入基金份额持有人账户。

3、根据《泓德智选启鑫混合型证券投资基金基金合同》、《泓德智选启鑫混合型证券投资基金招募说明书》及《泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于2025年2月5日(基金合同生效日)至2025年3月6日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购、赎回、转换及定期定额投资业务自2025年3月7日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德智选启鑫混合A

单位：人民币元

项目 (泓德智选启鑫混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	1,379,950.67	1,173,557.50	2,553,508.17
本期基金份额交易产生的变动数	69,377.71	-410,732.03	-341,354.32
其中：基金申购款	182,041.26	-728,985.81	-546,944.55

基金赎回款	-112,663.55	318,253.78	205,590.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,449,328.38	762,825.47	2,212,153.85

6.4.7.8.2 泓德智选启鑫混合C

单位：人民币元

项目 (泓德智选启鑫混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	283,051.95	368,470.40	651,522.35
本期基金份额交易产生的变动数	22,126.11	-199,830.22	-177,704.11
其中：基金申购款	63,711.05	-166,536.08	-102,825.03
基金赎回款	-41,584.94	-33,294.14	-74,879.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	305,178.06	168,640.18	473,818.24

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
活期存款利息收入	315,926.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	4,081.02
结算备付金利息收入	-
其他	11,488.98
合计	331,496.58

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金产生的利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出股票成交总额	118,999,044.74
减：卖出股票成本总额	117,741,224.78
减：交易费用	129,135.66
买卖股票差价收入	1,128,684.30

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	1.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,966.65
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,967.97

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,967.95
减：卖出债券（债转股及债券到期兑	7,000.00

付) 成本总额	
减: 应计利息总额	0.93
减: 交易费用	0.37
买卖债券差价收入	1,966.65

6.4.7.12 衍生工具收益

无。

6.4.7.13 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	571,532.00
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	571,532.00

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	1,542,027.90
——股票投资	1,542,027.90
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减: 应税金融商品公允	-

价值变动产生的预估增值税	
合计	1,542,027.90

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金赎回费收入	296,747.95
合计	296,747.95

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
审计费用	21,235.70
信息披露费	48,666.18
证券出借违约金	-
开户费	1,200.00
合计	71,101.88

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
国泰海通证券股份有限公司（以下简称“国泰海通证券”）	基金托管人、基金销售机构
泓德基业(西藏)企业管理有限公司	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券	10,332.00	0.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

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	本期
------	----

称	2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券	4.51	0.01%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果服务。

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 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	471,236.95
其中：应支付销售机构的客户维护费	147,191.69
应支付基金管理人的净管理费	324,045.26

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,904.63

注：支付基金托管人国泰海通证券的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

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		
	2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德智选启鑫混合A	泓德智选启鑫混合C	合计
国泰海通 证券	0.00	30,606.40	30,606.40
合计	0.00	30,606.40	30,606.40

注：支付基金销售机构的C类基金份额销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付给泓德基金，再由泓德基金计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：
日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

泓德智选启鑫混合A

份额单位：份

项目	本期 2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金合同生效日（2025年02月05日）持有的基金份额	15,000,000.00
报告期初持有的基金份额	-
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-
报告期末持有的基金份额	15,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比	29.91%

例	
---	--

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

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年02月05日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
国泰海通 证券-托管 户	2,217,616.72	315,926.58
国泰海通 证券-证券 户	12,571.99	2,391.79

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人国泰海通证券存放在交通银行上海交银大厦支行，按银行同业利率计息；本基金证券户的存款为本基金存放于国泰海通证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113695	华辰转债	2025-06-23	13个交易日	新债未上市	100.00	100.00	60	6,000.00	6,000.29	-
118057	甬矽转债	2025-06-27	13个交易日	新债未上市	100.00	100.00	30	3,000.00	3,000.07	-
123257	安克转债	2025-06-16	14个交易日	新债未上市	100.00	100.01	4	400.00	400.03	-

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

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
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项	38.05	2025-07-11	39.98	1,600	43,782.74	60,880.00	-

注：本基金截至2025年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他信用良好的境内商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为

交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中

浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,742,402.07	-	-	-	5,742,402.07
交易性金融资产	-	-	9,400.39	43,226,241.69	43,235,642.08
应收申购款	-	-	-	4,430,103.90	4,430,103.90
资产总计	5,742,402.07	-	9,400.39	47,656,345.59	53,408,148.05
负债					
应付赎回款	-	-	-	435,344.09	435,344.09
应付管理人报酬	-	-	-	48,241.89	48,241.89
应付托管费	-	-	-	6,030.22	6,030.22
应付销售服务费	-	-	-	3,175.55	3,175.55
其他负债	-	-	-	72,307.92	72,307.92
负债总计	-	-	-	565,099.67	565,099.67
利率敏感度缺口	5,742,402.07	-	9,400.39	47,091,245.92	52,843,048.38

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为0.02%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	43,226,241.69	81.80
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	43,226,241.69	81.80

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

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 2025年06月30日
第一层次	43,165,361.69
第二层次	70,280.39
第三层次	-
合计	43,235,642.08

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	43,226,241.69	80.94
	其中：股票	43,226,241.69	80.94
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,400.39	0.02
	其中：债券	9,400.39	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,742,402.07	10.75
8	其他各项资产	4,430,103.90	8.29
9	合计	53,408,148.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	140,700.00	0.27
B	采矿业	1,813,031.00	3.43
C	制造业	25,178,566.39	47.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,427,396.00	2.70
E	建筑业	576,676.00	1.09
F	批发和零售业	1,133,597.00	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	1,286,478.00	2.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,660,943.40	5.04
J	金融业	6,751,883.90	12.78
K	房地产业	420,491.00	0.80

L	租赁和商务服务业	323,558.00	0.61
M	科学研究和技术服务业	511,964.00	0.97
N	水利、环境和公共设施管理业	241,728.00	0.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,856.00	0.01
Q	卫生和社会工作	143,212.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	611,161.00	1.16
S	综合	-	-
	合计	43,226,241.69	81.80

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,800	706,216.00	1.34
2	600519	贵州茅台	500	704,760.00	1.33
3	601318	中国平安	11,400	632,472.00	1.20
4	600036	招商银行	11,200	514,640.00	0.97
5	600900	长江电力	15,300	461,142.00	0.87
6	000333	美的集团	6,300	454,860.00	0.86
7	601899	紫金矿业	22,800	444,600.00	0.84
8	601166	兴业银行	17,800	415,452.00	0.79
9	600030	中信证券	12,400	342,488.00	0.65
10	601688	华泰证券	15,300	272,493.00	0.52
11	000651	格力电器	6,000	269,520.00	0.51
12	300059	东方财富	10,900	252,117.00	0.48
13	600919	江苏银行	20,900	249,546.00	0.47
14	600887	伊利股份	8,800	245,344.00	0.46
15	601398	工商银行	32,200	244,398.00	0.46
16	002594	比亚迪	700	232,337.00	0.44

17	601319	中国人保	25,400	221,234.00	0.42
18	601600	中国铝业	29,700	209,088.00	0.40
19	000725	京东方 A	52,300	208,677.00	0.39
20	000776	广发证券	12,200	205,082.00	0.39
21	603259	药明康德	2,900	201,695.00	0.38
22	601229	上海银行	18,000	190,980.00	0.36
23	002463	沪电股份	4,400	187,352.00	0.35
24	601857	中国石油	21,900	187,245.00	0.35
25	601336	新华保险	3,200	187,200.00	0.35
26	600926	杭州银行	11,000	185,020.00	0.35
27	601328	交通银行	22,900	183,200.00	0.35
28	603993	洛阳钼业	21,000	176,820.00	0.33
29	000100	TCL科技	39,900	172,767.00	0.33
30	601728	中国电信	21,300	165,075.00	0.31
31	605058	澳弘电子	5,400	165,024.00	0.31
32	601288	农业银行	26,600	156,408.00	0.30
33	000858	五 粮 液	1,300	154,570.00	0.29
34	601009	南京银行	12,900	149,898.00	0.28
35	601919	中远海控	9,500	142,880.00	0.27
36	000001	平安银行	11,700	141,219.00	0.27
37	600050	中国联通	26,400	140,976.00	0.27
38	601766	中国中车	19,900	140,096.00	0.27
39	601898	中煤能源	12,800	140,032.00	0.26
40	600039	四川路桥	13,800	136,620.00	0.26
41	600019	宝钢股份	20,700	136,413.00	0.26
42	601963	重庆银行	12,500	135,750.00	0.26
43	300476	胜宏科技	1,000	134,380.00	0.25
44	300502	新易盛	1,040	132,100.80	0.25
45	300308	中际旭创	900	131,274.00	0.25
46	000338	潍柴动力	8,400	129,192.00	0.24
47	000166	申万宏源	25,700	129,014.00	0.24

48	002475	立讯精密	3,700	128,353.00	0.24
49	002648	卫星化学	7,400	128,242.00	0.24
50	000425	徐工机械	16,100	125,097.00	0.24
51	600276	恒瑞医药	2,400	124,560.00	0.24
52	688981	中芯国际	1,400	123,438.00	0.23
53	600219	南山铝业	32,000	122,560.00	0.23
54	002142	宁波银行	4,400	120,384.00	0.23
55	600585	海螺水泥	5,500	118,085.00	0.22
56	600989	宝丰能源	7,300	117,822.00	0.22
57	300274	阳光电源	1,700	115,209.00	0.22
58	002736	国信证券	10,000	115,200.00	0.22
59	603113	金能科技	16,600	115,038.00	0.22
60	600547	山东黄金	3,600	114,948.00	0.22
61	603501	豪威集团	900	114,885.00	0.22
62	000553	安道麦A	15,800	114,076.00	0.22
63	002352	顺丰控股	2,300	112,148.00	0.21
64	001965	招商公路	9,300	111,600.00	0.21
65	600690	海尔智家	4,500	111,510.00	0.21
66	688223	晶科能源	21,200	110,028.00	0.21
67	601668	中国建筑	19,000	109,630.00	0.21
68	603676	卫信康	10,800	109,404.00	0.21
69	605118	力鼎光电	4,400	109,252.00	0.21
70	601991	大唐发电	34,400	109,048.00	0.21
71	001358	兴欣新材	4,400	105,292.00	0.20
72	002461	珠江啤酒	9,100	102,739.00	0.19
73	301318	维海德	3,000	101,520.00	0.19
74	600941	中国移动	900	101,295.00	0.19
75	002493	荣盛石化	12,200	101,016.00	0.19
76	002714	牧原股份	2,400	100,824.00	0.19
77	002230	科大讯飞	2,100	100,548.00	0.19
78	000301	东方盛虹	12,000	99,960.00	0.19

79	603799	华友钴业	2,700	99,954.00	0.19
80	601816	京沪高铁	17,000	97,750.00	0.18
81	300369	绿盟科技	12,500	97,125.00	0.18
82	600031	三一重工	5,400	96,930.00	0.18
83	600406	国电南瑞	4,300	96,363.00	0.18
84	002414	高德红外	9,300	95,325.00	0.18
85	600999	招商证券	5,400	94,986.00	0.18
86	605499	东鹏饮料	300	94,215.00	0.18
87	600015	华夏银行	11,900	94,129.00	0.18
88	300389	艾比森	8,100	93,798.00	0.18
89	603386	骏亚科技	7,300	92,345.00	0.17
90	000050	深天马 A	10,700	91,164.00	0.17
91	300559	佳发教育	7,700	90,860.00	0.17
92	300162	雷曼光电	11,900	90,440.00	0.17
93	600741	华域汽车	5,100	90,015.00	0.17
94	605218	伟时电子	4,000	89,520.00	0.17
95	002371	北方华创	200	88,442.00	0.17
96	600809	山西汾酒	500	88,195.00	0.17
97	300690	双一科技	3,600	87,156.00	0.16
98	600958	东方证券	9,000	87,120.00	0.16
99	601555	东吴证券	9,900	86,625.00	0.16
100	601818	光大银行	20,700	85,905.00	0.16
101	603380	易德龙	3,200	85,120.00	0.16
102	300512	中亚股份	9,900	84,942.00	0.16
103	601988	中国银行	15,100	84,862.00	0.16
104	000963	华东医药	2,100	84,756.00	0.16
105	600418	江淮汽车	2,100	84,189.00	0.16
106	601877	正泰电器	3,700	83,879.00	0.16
107	605138	盛泰集团	12,500	83,750.00	0.16
108	600613	神奇制药	12,900	83,334.00	0.16
109	601658	邮储银行	15,100	82,597.00	0.16

110	688055	龙腾光电	22,200	82,140.00	0.16
111	002311	海大集团	1,400	82,026.00	0.16
112	600460	士兰微	3,300	81,906.00	0.15
113	601998	中信银行	9,600	81,600.00	0.15
114	688588	凌志软件	5,600	81,592.00	0.15
115	002532	天山铝业	9,800	81,438.00	0.15
116	300279	和晶科技	11,700	81,081.00	0.15
117	002587	奥拓电子	12,400	79,980.00	0.15
118	600660	福耀玻璃	1,400	79,814.00	0.15
119	601218	吉鑫科技	19,400	79,734.00	0.15
120	002913	奥士康	2,700	79,407.00	0.15
121	002623	亚玛顿	4,900	79,135.00	0.15
122	002661	克明食品	7,800	78,078.00	0.15
123	002080	中材科技	4,000	78,000.00	0.15
124	002637	赞宇科技	7,800	77,844.00	0.15
125	301362	民爆光电	1,900	77,539.00	0.15
126	001387	雪祺电气	5,600	76,944.00	0.15
127	601186	中国铁建	9,600	76,896.00	0.15
128	600956	新天绿能	9,900	76,428.00	0.14
129	002788	鹭燕医药	8,900	76,273.00	0.14
130	600760	中航沈飞	1,300	76,206.00	0.14
131	603230	内蒙新华	5,900	76,169.00	0.14
132	601811	新华文轩	5,200	75,764.00	0.14
133	603628	清源股份	6,200	75,702.00	0.14
134	600350	山东高速	7,100	75,686.00	0.14
135	603201	常润股份	4,100	75,645.00	0.14
136	300752	隆利科技	3,300	74,184.00	0.14
137	600104	上汽集团	4,600	73,830.00	0.14
138	000807	云铝股份	4,600	73,508.00	0.14
139	688668	鼎通科技	1,169	73,015.74	0.14
140	688009	中国通号	14,200	72,988.00	0.14

141	603132	金徽股份	5,500	72,985.00	0.14
142	002202	金风科技	7,100	72,775.00	0.14
143	600362	江西铜业	3,100	72,633.00	0.14
144	000538	云南白药	1,300	72,527.00	0.14
145	002001	新 和 成	3,400	72,318.00	0.14
146	000726	鲁 泰 A	11,400	72,276.00	0.14
147	002624	完美世界	4,700	71,299.00	0.13
148	000977	浪潮信息	1,400	71,232.00	0.13
149	001289	龙源电力	4,400	71,192.00	0.13
150	300606	金太阳	3,600	70,992.00	0.13
151	000895	双汇发展	2,900	70,789.00	0.13
152	603520	司太立	7,200	70,560.00	0.13
153	002203	海亮股份	6,800	70,176.00	0.13
154	300101	振芯科技	3,100	70,153.00	0.13
155	603288	海天味业	1,800	70,038.00	0.13
156	600578	京能电力	15,500	69,595.00	0.13
157	300812	易天股份	3,000	69,330.00	0.13
158	603633	徕木股份	7,900	68,651.00	0.13
159	301106	骏成科技	2,300	68,540.00	0.13
160	301060	兰卫医学	7,100	68,515.00	0.13
161	600998	九州通	13,300	68,362.00	0.13
162	002625	光启技术	1,700	67,966.00	0.13
163	002905	金逸影视	7,300	67,744.00	0.13
164	600282	南钢股份	16,100	67,620.00	0.13
165	603173	福斯达	1,900	67,545.00	0.13
166	301376	致欧科技	3,700	67,525.00	0.13
167	601601	中国太保	1,800	67,518.00	0.13
168	300760	迈瑞医疗	300	67,425.00	0.13
169	603379	三美股份	1,400	67,368.00	0.13
170	600866	星湖科技	9,700	67,027.00	0.13
171	688208	道通科技	2,180	66,708.00	0.13

172	688509	正元地信	15,400	66,066.00	0.13
173	600377	宁沪高速	4,300	65,962.00	0.12
174	300447	全信股份	4,200	65,814.00	0.12
175	601225	陕西煤业	3,400	65,416.00	0.12
176	600997	开滦股份	11,100	65,379.00	0.12
177	002950	奥美医疗	7,600	65,360.00	0.12
178	002236	大华股份	4,100	65,108.00	0.12
179	601126	四方股份	4,000	65,080.00	0.12
180	003022	联泓新科	4,100	64,903.00	0.12
181	603309	维力医疗	5,100	64,872.00	0.12
182	601568	北元集团	15,600	64,740.00	0.12
183	600663	陆家嘴	7,300	64,678.00	0.12
184	300442	润泽科技	1,300	64,389.00	0.12
185	300768	迪普科技	3,700	63,455.00	0.12
186	600029	南方航空	10,700	63,130.00	0.12
187	300140	节能环保	10,200	62,934.00	0.12
188	300433	蓝思科技	2,800	62,440.00	0.12
189	002976	瑞玛精密	2,400	62,400.00	0.12
190	688093	世华科技	2,000	62,100.00	0.12
191	300821	东岳硅材	7,900	62,094.00	0.12
192	002206	海利得	12,100	61,831.00	0.12
193	300206	理邦仪器	5,100	61,302.00	0.12
194	002479	富春环保	12,200	61,122.00	0.12
195	600873	梅花生物	5,700	60,933.00	0.12
196	688313	仕佳光子	1,600	60,880.00	0.12
197	601107	四川成渝	10,100	60,802.00	0.12
198	605186	健麾信息	2,900	60,726.00	0.11
199	301189	奥尼电子	2,300	60,513.00	0.11
200	603444	吉比特	200	60,390.00	0.11
201	600757	长江传媒	6,500	60,320.00	0.11
202	000893	亚钾国际	2,000	60,280.00	0.11

203	300830	金现代	6,600	60,258.00	0.11
204	601066	中信建投	2,500	60,125.00	0.11
205	601238	广汽集团	8,000	59,920.00	0.11
206	600488	津药药业	13,900	57,963.00	0.11
207	601138	工业富联	2,700	57,726.00	0.11
208	601628	中国人寿	1,400	57,666.00	0.11
209	300455	航天智装	4,000	57,600.00	0.11
210	600638	新黄浦	9,800	57,428.00	0.11
211	002266	浙富控股	18,600	57,288.00	0.11
212	603083	剑桥科技	1,200	56,760.00	0.11
213	002384	东山精密	1,500	56,655.00	0.11
214	600918	中泰证券	8,800	56,584.00	0.11
215	688779	五矿新能	10,400	56,576.00	0.11
216	300999	金龙鱼	1,900	56,107.00	0.11
217	600018	上港集团	9,800	55,958.00	0.11
218	002346	柘中股份	4,100	55,760.00	0.11
219	301268	铭利达	3,000	55,650.00	0.11
220	600061	国投资本	7,400	55,648.00	0.11
221	002852	道道全	5,800	55,448.00	0.10
222	600332	白云山	2,100	55,356.00	0.10
223	002534	西子洁能	4,900	55,076.00	0.10
224	601717	中创智领	3,300	54,846.00	0.10
225	300777	中简科技	1,500	54,375.00	0.10
226	000623	吉林敖东	3,200	54,240.00	0.10
227	600028	中国石化	9,600	54,144.00	0.10
228	300972	万辰集团	300	54,072.00	0.10
229	601019	山东出版	5,700	53,979.00	0.10
230	300978	东箭科技	4,800	53,568.00	0.10
231	300548	长芯博创	800	53,416.00	0.10
232	002543	万和电气	4,800	53,328.00	0.10
233	301408	华人健康	3,500	53,235.00	0.10

234	301265	华新环保	5,200	53,040.00	0.10
235	601111	中国国航	6,700	52,863.00	0.10
236	002916	深南电路	490	52,826.90	0.10
237	002558	巨人网络	2,200	51,810.00	0.10
238	300124	汇川技术	800	51,656.00	0.10
239	601633	长城汽车	2,400	51,552.00	0.10
240	600183	生益科技	1,700	51,255.00	0.10
241	603327	福蓉科技	5,540	51,245.00	0.10
242	000708	中信特钢	4,300	50,568.00	0.10
243	300468	四方精创	1,000	50,490.00	0.10
244	600990	四创电子	1,800	50,472.00	0.10
245	000411	英特集团	4,700	50,384.00	0.10
246	002415	海康威视	1,800	49,914.00	0.09
247	601916	浙商银行	14,700	49,833.00	0.09
248	002545	东方铁塔	5,600	49,784.00	0.09
249	300130	新国都	1,400	49,742.00	0.09
250	000755	山西高速	10,200	49,674.00	0.09
251	002128	电投能源	2,500	49,450.00	0.09
251	000937	冀中能源	8,600	49,450.00	0.09
252	000783	长江证券	7,100	49,203.00	0.09
253	000157	中联重科	6,800	49,164.00	0.09
254	600819	耀皮玻璃	8,300	48,306.00	0.09
255	002331	皖通科技	6,000	48,300.00	0.09
256	601999	出版传媒	6,900	48,231.00	0.09
257	600508	上海能源	4,100	47,970.00	0.09
258	002399	海普瑞	4,000	47,640.00	0.09
259	603115	海星股份	3,300	47,619.00	0.09
260	300636	同和药业	6,200	47,616.00	0.09
261	000848	承德露露	5,200	47,476.00	0.09
262	301017	漱玉平民	3,700	47,471.00	0.09
263	600688	上海石化	16,600	47,310.00	0.09

264	600988	赤峰黄金	1,900	47,272.00	0.09
265	600048	保利发展	5,800	46,980.00	0.09
266	603933	睿能科技	2,700	46,494.00	0.09
267	300796	贝斯美	4,500	46,395.00	0.09
268	600739	辽宁成大	4,200	46,200.00	0.09
269	600482	中国动力	2,000	46,140.00	0.09
270	002174	游族网络	3,800	46,094.00	0.09
271	001229	魅视科技	1,400	46,088.00	0.09
272	600796	钱江生化	7,800	45,786.00	0.09
273	002928	华夏航空	5,500	45,705.00	0.09
274	601006	大秦铁路	6,900	45,540.00	0.09
275	300639	凯普生物	7,800	45,240.00	0.09
276	603237	五芳斋	2,700	45,117.00	0.09
277	600089	特变电工	3,700	44,141.00	0.08
277	300824	北鼎股份	3,700	44,141.00	0.08
278	688041	海光信息	311	43,941.19	0.08
279	601678	滨化股份	10,600	43,884.00	0.08
280	600351	亚宝药业	7,200	43,704.00	0.08
281	300232	洲明科技	6,000	43,440.00	0.08
282	600329	达仁堂	1,300	43,368.00	0.08
283	300241	瑞丰光电	7,600	43,320.00	0.08
284	300868	杰美特	1,300	43,056.00	0.08
285	300850	新强联	1,200	42,984.00	0.08
286	300983	尤安设计	2,200	42,944.00	0.08
287	600925	苏能股份	8,200	42,886.00	0.08
288	600346	恒力石化	3,000	42,780.00	0.08
289	600458	时代新材	3,100	42,532.00	0.08
290	002983	芯瑞达	2,000	42,380.00	0.08
291	002333	罗普斯金	7,700	42,350.00	0.08
292	300080	易成新能	10,100	42,218.00	0.08
293	600176	中国巨石	3,700	42,180.00	0.08

294	300981	中红医疗	3,520	42,134.40	0.08
295	603168	莎普爱思	5,700	42,123.00	0.08
296	605266	健之佳	2,000	42,060.00	0.08
297	002170	芭田股份	4,100	42,025.00	0.08
298	300255	常山药业	900	41,949.00	0.08
299	000800	一汽解放	6,100	41,846.00	0.08
300	600096	云天化	1,900	41,743.00	0.08
301	600057	厦门象屿	5,900	41,477.00	0.08
302	300393	中来股份	7,200	41,472.00	0.08
303	002595	豪迈科技	700	41,454.00	0.08
304	688201	信安世纪	3,200	41,440.00	0.08
305	600961	株冶集团	3,700	41,366.00	0.08
306	688183	生益电子	807	41,318.40	0.08
307	603609	禾丰股份	5,000	41,300.00	0.08
308	600521	华海药业	2,200	40,986.00	0.08
309	600517	国网英大	8,000	40,800.00	0.08
310	688029	南微医学	600	40,530.00	0.08
311	003005	竞业达	2,000	40,420.00	0.08
312	002179	中航光电	1,000	40,360.00	0.08
313	601800	中国交建	4,500	40,005.00	0.08
314	003016	欣贺股份	5,300	39,750.00	0.08
315	000719	中原传媒	3,200	39,712.00	0.08
316	600272	开开实业	2,900	39,556.00	0.07
317	600628	新世界	5,400	39,528.00	0.07
318	603097	江苏华辰	1,800	39,330.00	0.07
319	688551	科威尔	1,333	39,176.87	0.07
320	601117	中国化学	5,100	39,117.00	0.07
321	000686	东北证券	5,100	38,913.00	0.07
322	601686	友发集团	6,800	38,624.00	0.07
323	000877	天山股份	8,300	38,512.00	0.07
324	600886	国投电力	2,600	38,324.00	0.07

325	688079	美迪凯	3,800	38,152.00	0.07
326	600295	鄂尔多斯	4,300	37,453.00	0.07
327	300015	爱尔眼科	3,000	37,440.00	0.07
328	688578	艾力斯	400	37,216.00	0.07
329	605500	森林包装	5,000	36,950.00	0.07
330	001979	招商蛇口	4,200	36,834.00	0.07
331	603365	水星家纺	2,000	36,720.00	0.07
332	000626	远大控股	5,400	36,612.00	0.07
333	601077	渝农商行	5,100	36,414.00	0.07
334	301221	光庭信息	700	36,379.00	0.07
335	600662	外服控股	7,100	36,281.00	0.07
336	300105	龙源技术	4,700	36,237.00	0.07
337	601868	中国能建	16,200	36,126.00	0.07
337	600851	海欣股份	5,400	36,126.00	0.07
338	002027	分众传媒	4,900	35,770.00	0.07
339	301109	军信股份	2,400	35,712.00	0.07
340	300662	科锐国际	1,200	35,652.00	0.07
341	000915	华特达因	1,000	35,350.00	0.07
342	601390	中国中铁	6,300	35,343.00	0.07
343	603916	苏博特	3,900	35,334.00	0.07
344	000655	金岭矿业	5,000	35,300.00	0.07
345	002588	史丹利	4,000	35,240.00	0.07
346	301337	亚华电子	1,200	35,052.00	0.07
347	301168	通灵股份	1,000	34,910.00	0.07
348	001360	南矿集团	2,500	34,800.00	0.07
349	603373	安邦护卫	700	34,496.00	0.07
350	688629	华丰科技	600	34,320.00	0.06
351	600499	科达制造	3,500	34,300.00	0.06
352	000603	盛达资源	2,300	34,247.00	0.06
353	600718	东软集团	3,500	34,125.00	0.06
354	301115	联检科技	2,200	34,078.00	0.06

355	603277	银都股份	2,115	33,840.00	0.06
356	688636	智明达	992	33,519.68	0.06
357	688508	芯朋微	600	33,492.00	0.06
358	688128	中国电研	1,364	33,418.00	0.06
359	300533	冰川网络	1,000	33,410.00	0.06
360	300408	三环集团	1,000	33,400.00	0.06
361	301151	冠龙节能	1,900	33,155.00	0.06
362	300803	指南针	405	32,667.30	0.06
363	603708	家家悦	3,200	32,640.00	0.06
364	600352	浙江龙盛	3,200	32,512.00	0.06
365	301286	侨源股份	1,300	32,487.00	0.06
366	300852	四会富仕	1,000	32,270.00	0.06
367	301282	金禄电子	1,300	32,227.00	0.06
368	603040	新坐标	800	32,136.00	0.06
369	600803	新奥股份	1,700	32,130.00	0.06
370	601169	北京银行	4,700	32,101.00	0.06
371	300014	亿纬锂能	700	32,067.00	0.06
372	002315	焦点科技	700	31,983.00	0.06
373	688552	航天南湖	800	31,928.00	0.06
374	002099	海翔药业	5,800	31,900.00	0.06
375	601995	中金公司	900	31,824.00	0.06
376	000630	铜陵有色	9,500	31,730.00	0.06
377	600785	新华百货	2,700	31,671.00	0.06
378	600724	宁波富达	6,900	31,395.00	0.06
379	688677	海泰新光	800	31,208.00	0.06
380	301329	信音电子	1,600	31,168.00	0.06
381	002734	利民股份	1,700	31,110.00	0.06
382	300579	数字认证	900	31,059.00	0.06
383	601677	明泰铝业	2,500	31,050.00	0.06
384	603987	康德莱	4,000	30,800.00	0.06
385	600496	精工钢构	9,600	30,720.00	0.06

386	600845	宝信软件	1,300	30,706.00	0.06
387	300196	长海股份	2,500	30,500.00	0.06
388	301386	未来电器	1,400	30,422.00	0.06
389	002863	今飞凯达	6,000	30,420.00	0.06
390	603466	风语筑	3,000	30,270.00	0.06
391	301088	戎美股份	2,200	30,250.00	0.06
392	001203	大中矿业	3,200	30,240.00	0.06
393	600196	复星医药	1,200	30,108.00	0.06
394	000426	兴业银锡	1,900	30,020.00	0.06
395	300017	网宿科技	2,800	30,016.00	0.06
396	603698	航天工程	1,700	29,954.00	0.06
397	300990	同飞股份	600	29,940.00	0.06
398	300360	炬华科技	1,900	29,925.00	0.06
399	301129	瑞纳智能	1,100	29,876.00	0.06
400	301419	阿莱德	1,080	29,808.00	0.06
401	600744	华银电力	6,600	29,766.00	0.06
402	002977	天箭科技	700	29,729.00	0.06
403	601900	南方传媒	1,900	29,716.00	0.06
404	688112	鼎阳科技	800	29,576.00	0.06
405	002823	凯中精密	2,100	29,463.00	0.06
406	002314	南山控股	11,200	29,456.00	0.06
407	002996	顺博合金	4,000	29,440.00	0.06
408	603766	隆鑫通用	2,300	29,348.00	0.06
409	000885	城发环境	2,200	29,304.00	0.06
410	601939	建设银行	3,100	29,264.00	0.06
411	603858	步长制药	1,800	29,232.00	0.06
412	688018	乐鑫科技	200	29,220.00	0.06
413	301526	国际复材	8,000	29,120.00	0.06
414	300484	蓝海华腾	1,300	29,081.00	0.06
415	600983	惠而浦	2,800	29,064.00	0.06
416	600179	安通控股	10,500	28,980.00	0.05

417	002215	诺普信	2,800	28,924.00	0.05
418	002293	罗莱生活	3,300	28,842.00	0.05
419	002373	千方科技	3,100	28,830.00	0.05
420	300581	晨曦航空	1,400	28,658.00	0.05
421	688377	迪威尔	1,200	28,644.00	0.05
422	301338	凯格精机	600	28,626.00	0.05
423	688025	杰普特	400	28,600.00	0.05
424	002728	特一药业	3,400	28,594.00	0.05
425	603898	好莱客	2,600	28,574.00	0.05
426	301215	中汽股份	4,600	28,520.00	0.05
427	601869	长飞光纤	700	28,504.00	0.05
428	300832	新产业	500	28,360.00	0.05
429	002381	双箭股份	4,200	28,350.00	0.05
430	002249	大洋电机	4,300	28,294.00	0.05
431	002956	西麦食品	1,200	28,164.00	0.05
432	300107	建新股份	3,500	28,035.00	0.05
433	002412	汉森制药	4,500	27,990.00	0.05
434	601456	国联民生	2,700	27,945.00	0.05
435	603213	镇洋发展	2,500	27,925.00	0.05
436	603276	恒兴新材	1,700	27,914.00	0.05
437	002516	旷达科技	5,400	27,810.00	0.05
438	605599	菜百股份	1,700	27,795.00	0.05
439	301031	中熔电气	348	27,718.20	0.05
440	301039	中集车辆	3,400	27,642.00	0.05
441	300879	大叶股份	700	27,496.00	0.05
442	002363	隆基机械	3,600	27,396.00	0.05
443	603087	甘李药业	500	27,390.00	0.05
444	603936	博敏电子	2,900	27,347.00	0.05
445	600764	中国海防	800	27,200.00	0.05
446	300394	天孚通信	340	27,145.60	0.05
447	002877	智能自控	3,100	27,125.00	0.05

448	600016	民生银行	5,700	27,075.00	0.05
449	301196	唯科科技	400	27,068.00	0.05
450	001223	欧克科技	600	26,964.00	0.05
451	688108	赛诺医疗	2,400	26,928.00	0.05
452	600383	金地集团	7,100	26,909.00	0.05
453	603713	密尔克卫	500	26,660.00	0.05
454	000596	古井贡酒	200	26,630.00	0.05
455	002772	众兴菌业	3,400	26,554.00	0.05
456	601360	三六零	2,600	26,520.00	0.05
457	301180	万祥科技	1,800	26,514.00	0.05
458	600201	生物股份	3,300	26,466.00	0.05
459	301223	中荣股份	1,600	26,448.00	0.05
460	000690	宝新能源	5,800	26,390.00	0.05
461	302132	中航成飞	300	26,382.00	0.05
462	688188	柏楚电子	200	26,332.00	0.05
463	300979	华利集团	500	26,285.00	0.05
464	601098	中南传媒	2,000	26,240.00	0.05
465	603899	晨光股份	900	26,091.00	0.05
466	002926	华西证券	2,900	25,926.00	0.05
467	002675	东诚药业	1,800	25,902.00	0.05
468	688523	航天环宇	1,200	25,812.00	0.05
469	601881	中国银河	1,500	25,725.00	0.05
470	002025	航天电器	500	25,705.00	0.05
471	603882	金域医学	900	25,704.00	0.05
472	002500	山西证券	4,400	25,696.00	0.05
473	600163	中闽能源	5,000	25,600.00	0.05
474	688800	瑞可达	520	25,584.00	0.05
475	000831	中国稀土	700	25,284.00	0.05
476	002745	木林森	3,200	25,216.00	0.05
477	603256	宏和科技	1,700	25,194.00	0.05
478	601958	金钼股份	2,300	25,162.00	0.05

479	300143	盈康生命	2,600	25,038.00	0.05
480	000733	振华科技	500	25,025.00	0.05
481	605080	浙江自然	900	25,020.00	0.05
482	601799	星宇股份	200	25,000.00	0.05
483	600435	北方导航	1,600	24,944.00	0.05
484	002223	鱼跃医疗	700	24,920.00	0.05
485	600325	华发股份	5,100	24,837.00	0.05
486	603565	中谷物流	2,600	24,830.00	0.05
486	600025	华能水电	2,600	24,830.00	0.05
487	002261	拓维信息	800	24,760.00	0.05
488	688586	江航装备	2,200	24,750.00	0.05
489	600507	方大特钢	5,700	24,738.00	0.05
490	603707	健友股份	2,200	24,530.00	0.05
491	002701	奥瑞金	4,100	24,395.00	0.05
492	601888	中国中免	400	24,388.00	0.05
493	001378	德冠新材	1,100	24,387.00	0.05
494	000983	山西焦煤	3,800	24,320.00	0.05
495	301069	凯盛新材	1,500	24,165.00	0.05
496	000523	红棉股份	7,400	24,124.00	0.05
497	301539	宏鑫科技	1,300	24,076.00	0.05
498	000825	太钢不锈	6,700	24,053.00	0.05
499	688334	西高院	1,400	24,052.00	0.05
500	603856	东宏股份	2,100	24,045.00	0.05
501	300212	易华录	1,100	23,936.00	0.05
502	300798	锦鸡股份	2,200	23,914.00	0.05
503	600909	华安证券	4,100	23,903.00	0.05
504	001872	招商港口	1,200	23,832.00	0.05
505	002958	青农商行	6,600	23,826.00	0.05
506	688362	甬矽电子	800	23,824.00	0.05
507	300573	兴齐眼药	460	23,823.40	0.05
508	688299	长阳科技	1,200	23,724.00	0.04

509	300219	鸿利智汇	3,500	23,520.00	0.04
510	601788	光大证券	1,300	23,374.00	0.04
511	605123	派克新材	300	23,370.00	0.04
512	301028	东亚机械	1,900	23,351.00	0.04
513	301387	光大同创	600	23,340.00	0.04
514	300111	向日葵	7,100	23,288.00	0.04
515	600459	贵研铂业	1,500	23,265.00	0.04
516	688599	天合光能	1,600	23,248.00	0.04
517	600681	百川能源	6,600	23,166.00	0.04
517	002706	良信股份	2,600	23,166.00	0.04
518	603393	新天然气	800	23,160.00	0.04
519	688007	光峰科技	1,600	23,136.00	0.04
520	603519	立霸股份	1,900	23,104.00	0.04
521	603511	爱慕股份	1,500	23,085.00	0.04
522	605228	神通科技	2,100	23,079.00	0.04
523	603053	成都燃气	2,400	23,064.00	0.04
524	300872	天阳科技	1,000	23,060.00	0.04
525	600067	冠城新材	7,700	22,946.00	0.04
526	603231	索宝蛋白	1,400	22,932.00	0.04
526	600583	海油工程	4,200	22,932.00	0.04
527	688696	极米科技	200	22,872.00	0.04
528	600874	创业环保	3,800	22,686.00	0.04
529	300424	航新科技	1,300	22,516.00	0.04
530	600801	华新水泥	1,900	22,496.00	0.04
531	002938	鹏鼎控股	700	22,421.00	0.04
532	600111	北方稀土	900	22,410.00	0.04
533	688685	迈信林	400	22,340.00	0.04
534	001277	速达股份	500	22,330.00	0.04
535	301137	哈焊华通	600	22,230.00	0.04
536	603886	元祖股份	1,700	22,219.00	0.04
537	603607	京华激光	900	22,149.00	0.04

538	300667	必创科技	1,400	22,106.00	0.04
539	600012	皖通高速	1,300	22,074.00	0.04
540	600132	重庆啤酒	400	22,040.00	0.04
541	000799	酒鬼酒	500	21,995.00	0.04
542	688057	金达莱	1,800	21,960.00	0.04
542	600820	隧道股份	3,600	21,960.00	0.04
543	603689	皖天然气	2,600	21,892.00	0.04
544	605577	龙版传媒	1,700	21,862.00	0.04
545	603699	纽威股份	700	21,819.00	0.04
546	001367	海森药业	1,000	21,810.00	0.04
547	600438	通威股份	1,300	21,775.00	0.04
548	002270	华明装备	1,300	21,762.00	0.04
549	600237	铜峰电子	3,000	21,750.00	0.04
550	300011	鼎汉技术	2,900	21,663.00	0.04
551	603129	春风动力	100	21,650.00	0.04
552	301345	涛涛车业	200	21,620.00	0.04
553	300560	中富通	1,600	21,616.00	0.04
554	601100	恒立液压	300	21,600.00	0.04
555	300986	志特新材	1,700	21,420.00	0.04
556	300475	香农芯创	600	21,378.00	0.04
557	603351	威尔药业	800	21,184.00	0.04
558	603187	海容冷链	1,800	21,168.00	0.04
558	301132	满坤科技	600	21,168.00	0.04
559	603019	中科曙光	300	21,120.00	0.04
560	301396	宏景科技	340	21,117.40	0.04
561	301328	维峰电子	500	21,075.00	0.04
562	688239	航宇科技	600	20,988.00	0.04
563	002749	国光股份	1,400	20,888.00	0.04
564	300373	扬杰科技	400	20,760.00	0.04
565	688122	西部超导	400	20,752.00	0.04
566	603529	爱玛科技	600	20,640.00	0.04

567	300259	新天科技	5,800	20,590.00	0.04
568	688127	蓝特光学	800	20,568.00	0.04
569	600675	中华企业	7,100	20,448.00	0.04
570	300492	华图山鼎	300	20,364.00	0.04
571	300251	光线传媒	1,000	20,270.00	0.04
572	603630	拉芳家化	900	20,178.00	0.04
573	600160	巨化股份	700	20,076.00	0.04
574	600236	桂冠电力	3,200	20,064.00	0.04
575	600436	片仔癀	100	20,001.00	0.04
576	601579	会稽山	1,000	19,910.00	0.04
577	000661	长春高新	200	19,836.00	0.04
578	002925	盈趣科技	1,100	19,778.00	0.04
579	600115	中国东航	4,900	19,747.00	0.04
580	301020	密封科技	900	19,647.00	0.04
581	002190	成飞集成	500	19,530.00	0.04
582	300529	健帆生物	900	19,413.00	0.04
583	688258	卓易信息	400	19,372.00	0.04
584	002304	洋河股份	300	19,365.00	0.04
585	300725	药石科技	500	19,350.00	0.04
586	688088	虹软科技	400	19,300.00	0.04
587	600572	康恩贝	4,400	19,272.00	0.04
588	601808	中海油服	1,400	19,264.00	0.04
589	000042	中洲控股	2,700	19,197.00	0.04
590	603528	多伦科技	2,300	19,182.00	0.04
591	301141	中科磁业	300	19,140.00	0.04
592	605158	华达新材	2,300	19,136.00	0.04
593	002705	新宝股份	1,300	19,110.00	0.04
594	301270	汉仪股份	400	19,064.00	0.04
595	688505	复旦张江	2,200	19,052.00	0.04
596	002063	远光软件	3,200	19,040.00	0.04
597	600685	中船防务	700	19,033.00	0.04

598	605580	恒盛能源	1,400	19,026.00	0.04
599	688119	中钢洛耐	4,540	18,977.20	0.04
600	603260	合盛硅业	400	18,960.00	0.04
601	000975	山金国际	1,000	18,940.00	0.04
602	002267	陕天然气	2,500	18,925.00	0.04
603	600917	重庆燃气	3,300	18,876.00	0.04
604	603179	新泉股份	400	18,788.00	0.04
605	600269	赣粤高速	3,700	18,722.00	0.04
606	000901	航天科技	1,500	18,645.00	0.04
607	603328	依顿电子	1,900	18,639.00	0.04
608	688010	福光股份	600	18,624.00	0.04
609	688580	伟思医疗	400	18,596.00	0.04
610	300414	中光防雷	1,200	18,576.00	0.04
611	000061	农产品	2,900	18,531.00	0.04
612	601827	三峰环境	2,200	18,480.00	0.03
613	601369	陕鼓动力	2,100	18,417.00	0.03
614	000554	泰山石油	2,600	18,382.00	0.03
615	301516	中远通	1,100	18,370.00	0.03
616	600655	豫园股份	3,300	18,315.00	0.03
617	301029	怡合达	800	18,288.00	0.03
618	300018	中元股份	2,300	18,285.00	0.03
619	688281	华秦科技	300	18,153.00	0.03
620	002322	理工能科	1,500	18,150.00	0.03
621	600285	羚锐制药	800	18,136.00	0.03
622	000959	首钢股份	5,300	18,020.00	0.03
623	002585	双星新材	3,300	18,018.00	0.03
624	300864	南大环境	900	17,955.00	0.03
625	600795	国电电力	3,700	17,908.00	0.03
626	601928	凤凰传媒	1,600	17,872.00	0.03
627	301550	斯菱股份	200	17,858.00	0.03
628	300779	惠城环保	100	17,849.00	0.03

629	601083	锦江航运	1,600	17,776.00	0.03
630	000404	长虹华意	2,500	17,750.00	0.03
631	001322	箭牌家居	2,100	17,745.00	0.03
631	000011	深物业A	2,100	17,745.00	0.03
632	603153	上海建科	1,000	17,630.00	0.03
633	301025	读客文化	1,600	17,600.00	0.03
634	001216	华瓷股份	1,300	17,550.00	0.03
635	601669	中国电建	3,600	17,532.00	0.03
636	301201	诚达药业	800	17,528.00	0.03
637	002029	七匹狼	2,600	17,524.00	0.03
638	600996	贵广网络	2,100	17,514.00	0.03
639	600023	浙能电力	3,300	17,490.00	0.03
640	603486	科沃斯	300	17,469.00	0.03
641	301100	风光股份	1,000	17,420.00	0.03
642	601901	方正证券	2,200	17,402.00	0.03
642	600066	宇通客车	700	17,402.00	0.03
643	300628	亿联网络	500	17,380.00	0.03
644	300134	大富科技	1,400	17,122.00	0.03
645	600595	中孚实业	3,900	17,082.00	0.03
645	000421	南京公用	2,600	17,082.00	0.03
646	300406	九强生物	1,200	16,980.00	0.03
646	002056	横店东磁	1,200	16,980.00	0.03
647	600704	物产中大	3,200	16,864.00	0.03
648	688602	康鹏科技	2,000	16,760.00	0.03
649	600875	东方电气	1,000	16,740.00	0.03
649	600389	江山股份	900	16,740.00	0.03
650	002912	中新赛克	700	16,695.00	0.03
651	002378	章源钨业	2,100	16,611.00	0.03
652	000657	中钨高新	1,400	16,604.00	0.03
653	688799	华纳药厂	400	16,520.00	0.03
654	600268	国电南自	2,100	16,422.00	0.03

655	688285	高铁电气	2,000	16,400.00	0.03
655	688008	澜起科技	200	16,400.00	0.03
656	301296	新巨丰	1,700	16,337.00	0.03
657	300673	佩蒂股份	1,000	16,320.00	0.03
658	603323	苏农银行	2,900	16,269.00	0.03
659	601311	骆驼股份	1,800	16,254.00	0.03
660	688123	聚辰股份	200	16,198.00	0.03
661	002169	智光电气	2,500	16,175.00	0.03
662	600674	川投能源	1,000	16,040.00	0.03
663	300770	新媒股份	400	15,996.00	0.03
663	000429	粤高速 A	1,200	15,996.00	0.03
664	688418	震有科技	600	15,876.00	0.03
665	002264	新华都	2,500	15,875.00	0.03
666	600908	无锡银行	2,500	15,775.00	0.03
667	301239	普瑞眼科	400	15,680.00	0.03
668	600885	宏发股份	700	15,617.00	0.03
669	603369	今世缘	400	15,572.00	0.03
670	600531	豫光金铅	2,000	15,480.00	0.03
671	002284	亚太股份	1,400	15,470.00	0.03
672	301320	豪江智能	800	15,360.00	0.03
673	300025	华星创业	2,200	15,268.00	0.03
674	300036	超图软件	1,000	15,260.00	0.03
675	301013	利和兴	900	15,255.00	0.03
676	603456	九洲药业	1,000	15,210.00	0.03
677	002328	新朋股份	2,600	15,132.00	0.03
678	002613	北玻股份	4,100	15,129.00	0.03
679	300288	朗玛信息	1,000	15,110.00	0.03
680	688562	航天软件	800	14,992.00	0.03
681	601168	西部矿业	900	14,967.00	0.03
682	300988	津荣天宇	700	14,931.00	0.03
683	603535	嘉诚国际	1,400	14,896.00	0.03

684	600271	航天信息	1,600	14,784.00	0.03
685	300229	拓尔思	800	14,752.00	0.03
686	603737	三棵树	400	14,740.00	0.03
687	301310	鑫宏业	400	14,696.00	0.03
688	603020	爱普股份	1,600	14,688.00	0.03
689	000529	广弘控股	2,400	14,664.00	0.03
690	688609	九联科技	1,400	14,658.00	0.03
691	300973	立高食品	300	14,631.00	0.03
692	600489	中金黄金	1,000	14,630.00	0.03
692	001313	粤海饲料	1,900	14,630.00	0.03
693	002030	达安基因	2,400	14,520.00	0.03
694	603199	九华旅游	400	14,496.00	0.03
695	688159	有方科技	200	14,334.00	0.03
696	002927	泰永长征	1,000	14,310.00	0.03
697	300187	永清环保	2,800	14,280.00	0.03
698	601377	兴业证券	2,300	14,237.00	0.03
699	002552	宝鼎科技	1,000	14,170.00	0.03
700	002910	庄园牧场	1,500	14,130.00	0.03
701	601838	成都银行	700	14,070.00	0.03
702	600109	国金证券	1,600	14,032.00	0.03
703	600491	龙元建设	3,800	13,984.00	0.03
704	300608	思特奇	1,200	13,968.00	0.03
705	603229	奥翔药业	1,600	13,952.00	0.03
706	000717	中南股份	5,700	13,908.00	0.03
707	603180	金牌家居	700	13,629.00	0.03
708	301499	维科精密	500	13,625.00	0.03
709	688095	福昕软件	200	13,582.00	0.03
710	601108	财通证券	1,700	13,447.00	0.03
711	688582	芯动联科	200	13,440.00	0.03
712	601199	江南水务	2,500	13,200.00	0.02
713	600392	盛和资源	1,000	13,170.00	0.02

714	002252	上海莱士	1,900	13,053.00	0.02
715	000153	丰原药业	2,100	12,957.00	0.02
716	300306	远方信息	1,000	12,920.00	0.02
717	300869	康泰医学	900	12,906.00	0.02
718	300467	迅游科技	600	12,882.00	0.02
719	000408	藏格矿业	300	12,801.00	0.02
720	002455	百川股份	1,700	12,716.00	0.02
721	300940	南极光	500	12,625.00	0.02
722	603601	再升科技	3,100	12,586.00	0.02
723	301149	隆华新材	1,100	12,584.00	0.02
724	600475	华光环能	1,200	12,504.00	0.02
725	002948	青岛银行	2,500	12,450.00	0.02
726	002993	奥海科技	300	12,441.00	0.02
727	002644	佛慈制药	1,500	12,375.00	0.02
728	688691	灿芯股份	200	12,372.00	0.02
729	688728	格科微	800	12,320.00	0.02
730	301165	锐捷网络	200	12,292.00	0.02
731	002129	TCL中环	1,600	12,288.00	0.02
732	002955	鸿合科技	500	12,285.00	0.02
733	002296	辉煌科技	1,100	12,265.00	0.02
734	002358	森源电气	2,400	12,216.00	0.02
735	603618	杭电股份	2,000	12,200.00	0.02
736	000876	新希望	1,300	12,194.00	0.02
737	300382	斯莱克	800	12,168.00	0.02
738	002481	双塔食品	2,300	12,167.00	0.02
739	600011	华能国际	1,700	12,138.00	0.02
740	300873	海晨股份	600	12,114.00	0.02
741	688049	炬芯科技	200	12,100.00	0.02
742	300303	聚飞光电	1,900	12,046.00	0.02
743	600588	用友网络	900	12,033.00	0.02
744	601616	广电电气	3,100	11,997.00	0.02

745	600729	重庆百货	400	11,932.00	0.02
746	002483	润邦股份	1,900	11,875.00	0.02
747	605507	国邦医药	600	11,862.00	0.02
747	002867	周大生	900	11,862.00	0.02
748	300239	东宝生物	2,000	11,860.00	0.02
749	301177	迪阿股份	400	11,840.00	0.02
750	603088	宁波精达	1,300	11,817.00	0.02
751	600266	城建发展	2,600	11,804.00	0.02
752	300184	力源信息	1,200	11,784.00	0.02
753	300590	移为通信	900	11,709.00	0.02
754	002631	德尔未来	2,500	11,700.00	0.02
755	002523	天桥起重	3,200	11,680.00	0.02
756	603806	福斯特	900	11,664.00	0.02
757	000933	神火股份	700	11,648.00	0.02
758	600327	大东方	2,400	11,640.00	0.02
759	000058	深赛格	1,400	11,634.00	0.02
760	600725	云维股份	3,600	11,628.00	0.02
760	300110	华仁药业	3,600	11,628.00	0.02
761	600486	扬农化工	200	11,600.00	0.02
762	300558	贝达药业	200	11,590.00	0.02
763	600654	中安科	3,900	11,583.00	0.02
764	688085	三友医疗	600	11,538.00	0.02
765	300425	中建环能	2,200	11,528.00	0.02
766	600060	海信视像	500	11,510.00	0.02
767	600027	华电国际	2,100	11,487.00	0.02
768	600020	中原高速	2,400	11,472.00	0.02
769	000060	中金岭南	2,500	11,450.00	0.02
770	600422	昆药集团	800	11,448.00	0.02
771	300496	中科创达	200	11,444.00	0.02
772	300383	光环新网	800	11,440.00	0.02
773	300226	上海钢联	500	11,420.00	0.02

774	600769	祥龙电业	1,100	11,385.00	0.02
774	002225	濮耐股份	2,300	11,385.00	0.02
775	300866	安克创新	100	11,360.00	0.02
776	000597	东北制药	2,200	11,352.00	0.02
777	300088	长信科技	1,900	11,324.00	0.02
778	603659	璞泰来	600	11,268.00	0.02
779	002068	黑猫股份	1,100	11,231.00	0.02
780	603025	大豪科技	800	11,216.00	0.02
781	002572	索菲亚	800	11,208.00	0.02
782	688778	厦钨新能	200	11,184.00	0.02
783	600008	首创环保	3,700	11,174.00	0.02
784	002139	拓邦股份	800	11,048.00	0.02
785	688347	华虹公司	200	10,982.00	0.02
786	002662	峰璟股份	3,200	10,944.00	0.02
787	300413	芒果超媒	500	10,910.00	0.02
788	002344	海宁皮城	2,500	10,850.00	0.02
789	001300	三柏硕	800	10,840.00	0.02
790	600256	广汇能源	1,800	10,836.00	0.02
791	300221	银禧科技	1,300	10,790.00	0.02
792	601096	宏盛华源	2,600	10,764.00	0.02
793	301195	北路智控	300	10,740.00	0.02
794	002933	新兴装备	300	10,716.00	0.02
795	301321	翰博高新	700	10,703.00	0.02
796	600826	兰生股份	1,300	10,660.00	0.02
797	002392	北京利尔	1,700	10,608.00	0.02
798	300318	博晖创新	1,800	10,602.00	0.02
799	603508	思维列控	400	10,592.00	0.02
800	002890	弘宇股份	800	10,552.00	0.02
801	000534	万泽股份	700	10,444.00	0.02
802	301076	新瀚新材	300	10,434.00	0.02
803	002655	共达电声	800	10,368.00	0.02

804	002524	光正眼科	2,300	10,350.00	0.02
805	600073	光明肉业	1,400	10,332.00	0.02
806	601515	东峰集团	2,700	10,314.00	0.02
807	301359	东南电子	500	10,295.00	0.02
808	688033	天宜新材	1,600	10,256.00	0.02
809	300498	温氏股份	600	10,248.00	0.02
809	300363	博腾股份	600	10,248.00	0.02
810	300778	新城市	800	10,224.00	0.02
811	688598	金博股份	400	10,168.00	0.02
812	300861	美畅股份	500	10,165.00	0.02
813	002330	得利斯	2,200	10,076.00	0.02
814	600717	天津港	2,200	10,032.00	0.02
814	002702	海欣食品	2,400	10,032.00	0.02
815	601872	招商轮船	1,600	10,016.00	0.02
816	002515	金字火腿	1,700	9,962.00	0.02
817	300320	海达股份	1,000	9,940.00	0.02
818	601330	绿色动力	1,300	9,932.00	0.02
819	002096	易普力	800	9,928.00	0.02
820	600284	浦东建设	1,500	9,900.00	0.02
821	300365	恒华科技	1,500	9,885.00	0.02
822	002970	锐明技术	200	9,880.00	0.02
823	600649	城投控股	2,300	9,867.00	0.02
824	300514	友讯达	700	9,856.00	0.02
825	300787	海能实业	704	9,750.40	0.02
826	600684	珠江股份	2,200	9,746.00	0.02
827	600640	国脉文化	800	9,696.00	0.02
828	000902	新洋丰	700	9,681.00	0.02
829	000932	华菱钢铁	2,200	9,680.00	0.02
830	688131	皓元医药	200	9,670.00	0.02
831	600618	氯碱化工	1,000	9,630.00	0.02
832	688196	卓越新能	200	9,614.00	0.02

833	000758	中色股份	1,900	9,557.00	0.02
834	603223	恒通股份	900	9,549.00	0.02
835	600888	新疆众和	1,400	9,548.00	0.02
836	601333	广深铁路	3,300	9,537.00	0.02
837	600497	驰宏锌锗	1,800	9,522.00	0.02
838	300463	迈克生物	800	9,520.00	0.02
839	000823	超声电子	800	9,480.00	0.02
840	601689	拓普集团	200	9,450.00	0.02
841	688396	华润微	200	9,432.00	0.02
842	002597	金禾实业	400	9,420.00	0.02
843	300454	深信服	100	9,418.00	0.02
844	000988	华工科技	200	9,402.00	0.02
845	002539	云图控股	1,000	9,380.00	0.02
846	002726	龙大美食	1,600	9,312.00	0.02
847	605056	咸亨国际	600	9,240.00	0.02
848	601778	晶科科技	3,100	9,207.00	0.02
849	600037	歌华有线	1,200	9,168.00	0.02
850	688690	纳微科技	400	9,132.00	0.02
851	603997	继峰股份	700	9,128.00	0.02
852	300401	花园生物	600	9,126.00	0.02
853	600262	北方股份	400	9,120.00	0.02
854	002019	亿帆医药	700	9,093.00	0.02
855	605128	上海沿浦	300	9,078.00	0.02
856	002985	北摩高科	300	9,075.00	0.02
857	600155	华创云信	1,300	9,048.00	0.02
858	300443	金雷股份	400	9,040.00	0.02
859	300298	三诺生物	400	9,036.00	0.02
860	688721	龙图光罩	200	9,020.00	0.02
861	688063	派能科技	200	9,016.00	0.02
862	601012	隆基绿能	600	9,012.00	0.02
863	300655	晶瑞电材	900	9,009.00	0.02

864	000551	创元科技	700	8,995.00	0.02
865	688519	南亚新材	200	8,960.00	0.02
866	605399	晨光新材	700	8,946.00	0.02
867	688665	四方光电	200	8,944.00	0.02
867	600959	江苏有线	2,600	8,944.00	0.02
868	601607	上海医药	500	8,940.00	0.02
869	301107	瑜欣电子	300	8,925.00	0.02
870	601595	上海电影	300	8,892.00	0.02
871	301103	何氏眼科	400	8,880.00	0.02
872	600216	浙江医药	600	8,874.00	0.02
873	002446	盛路通信	1,200	8,856.00	0.02
874	603636	南威软件	700	8,848.00	0.02
874	601665	齐鲁银行	1,400	8,848.00	0.02
875	002708	光洋股份	800	8,824.00	0.02
876	300997	欢乐家	500	8,820.00	0.02
877	601989	中国重工	1,900	8,816.00	0.02
878	002546	新联电子	1,600	8,784.00	0.02
879	301211	亨迪药业	500	8,780.00	0.02
880	300079	数码视讯	1,500	8,775.00	0.02
881	301217	铜冠铜箔	700	8,757.00	0.02
881	002101	广东鸿图	700	8,757.00	0.02
882	301102	兆讯传媒	800	8,736.00	0.02
883	002003	伟星股份	800	8,728.00	0.02
884	002649	博彦科技	600	8,718.00	0.02
885	600063	皖维高新	1,900	8,702.00	0.02
886	600738	丽尚国潮	1,500	8,700.00	0.02
887	300375	鹏翎股份	1,700	8,687.00	0.02
888	600094	大名城	2,800	8,680.00	0.02
889	001914	招商积余	700	8,659.00	0.02
890	300891	惠云钛业	900	8,658.00	0.02
891	600526	菲达环保	1,800	8,640.00	0.02

892	600410	华胜天成	900	8,631.00	0.02
893	300942	易瑞生物	900	8,622.00	0.02
894	603611	诺力股份	400	8,616.00	0.02
895	301072	中捷精工	400	8,588.00	0.02
896	003015	日久光电	500	8,575.00	0.02
897	688772	珠海冠宇	600	8,574.00	0.02
898	002531	天顺风能	1,200	8,568.00	0.02
899	600667	太极实业	1,300	8,554.00	0.02
900	002636	金安国纪	900	8,532.00	0.02
901	688303	大全能源	400	8,528.00	0.02
902	300224	正海磁材	600	8,490.00	0.02
903	300400	劲拓股份	500	8,420.00	0.02
904	603367	辰欣药业	600	8,412.00	0.02
905	300740	水羊股份	500	8,375.00	0.02
906	002548	金新农	2,200	8,360.00	0.02
907	603966	法兰泰克	900	8,352.00	0.02
908	688015	交控科技	400	8,336.00	0.02
909	605305	中际联合	300	8,334.00	0.02
910	605589	圣泉集团	300	8,325.00	0.02
911	300404	博济医药	900	8,298.00	0.02
912	603733	仙鹤股份	400	8,296.00	0.02
913	688135	利扬芯片	400	8,284.00	0.02
914	002685	华东重机	1,100	8,283.00	0.02
915	300188	国投智能	600	8,280.00	0.02
916	600386	北巴传媒	1,800	8,226.00	0.02
917	600630	龙头股份	1,000	8,200.00	0.02
918	600501	航天晨光	400	8,196.00	0.02
919	688289	圣湘生物	400	8,192.00	0.02
920	300284	苏交科	900	8,190.00	0.02
921	600728	佳都科技	1,500	8,175.00	0.02
922	002540	亚太科技	1,400	8,162.00	0.02

923	000514	渝开发	1,800	8,154.00	0.02
924	301330	熵基科技	300	8,109.00	0.02
925	601088	中国神华	200	8,108.00	0.02
926	603296	华勤技术	100	8,068.00	0.02
927	600035	楚天高速	1,900	8,056.00	0.02
928	002722	物产金轮	500	8,045.00	0.02
929	688388	嘉元科技	400	8,032.00	0.02
930	603075	热威股份	400	7,996.00	0.02
931	688601	力芯微	200	7,990.00	0.02
932	300047	天源迪科	500	7,975.00	0.02
933	601200	上海环境	1,000	7,940.00	0.02
934	600552	凯盛科技	700	7,910.00	0.01
935	300261	雅本化学	1,100	7,865.00	0.01
936	688143	长盈通	200	7,800.00	0.01
937	300755	华致酒行	400	7,720.00	0.01
938	603989	艾华集团	500	7,700.00	0.01
939	600403	大有能源	2,000	7,580.00	0.01
940	301509	金凯生科	200	7,558.00	0.01
941	600502	安徽建工	1,600	7,520.00	0.01
941	002695	煌上煌	800	7,520.00	0.01
942	605366	宏柏新材	1,200	7,512.00	0.01
943	603170	宝立食品	600	7,482.00	0.01
943	301216	万凯新材	600	7,482.00	0.01
944	605089	味知香	300	7,452.00	0.01
945	301566	达利凯普	400	7,420.00	0.01
946	002110	三钢闽光	2,100	7,371.00	0.01
947	605365	立达信	500	7,365.00	0.01
948	603612	索通发展	400	7,352.00	0.01
949	301418	协昌科技	200	7,308.00	0.01
950	603719	良品铺子	600	7,290.00	0.01
950	600731	湖南海利	1,000	7,290.00	0.01

951	600500	中化国际	1,900	7,277.00	0.01
952	688403	汇成股份	699	7,262.61	0.01
953	300420	五洋自控	2,100	7,224.00	0.01
954	688568	中科星图	200	7,202.00	0.01
955	603515	欧普照明	400	7,196.00	0.01
956	688202	美迪西	200	7,186.00	0.01
957	603516	淳中科技	200	7,180.00	0.01
958	300855	图南股份	300	7,134.00	0.01
958	300625	三雄极光	600	7,134.00	0.01
959	600928	西安银行	1,800	7,056.00	0.01
960	002831	裕同科技	300	7,026.00	0.01
961	002971	和远气体	300	6,999.00	0.01
962	601528	瑞丰银行	1,200	6,948.00	0.01
963	603013	亚普股份	400	6,912.00	0.01
964	301230	泓博医药	200	6,884.00	0.01
965	603680	今创集团	600	6,858.00	0.01
966	603063	禾望电气	200	6,772.00	0.01
967	603885	吉祥航空	500	6,735.00	0.01
968	688117	圣诺生物	200	6,730.00	0.01
969	688371	菲沃泰	400	6,624.00	0.01
970	301004	嘉益股份	100	6,623.00	0.01
971	600380	健康元	600	6,618.00	0.01
972	000965	天保基建	1,700	6,596.00	0.01
973	300919	中伟股份	200	6,576.00	0.01
973	300083	创世纪	800	6,576.00	0.01
974	600594	益佰制药	1,700	6,545.00	0.01
975	002790	瑞尔特	900	6,543.00	0.01
976	300166	东方国信	600	6,540.00	0.01
977	688553	汇宇制药	400	6,516.00	0.01
978	300473	德尔股份	200	6,510.00	0.01
979	000063	中兴通讯	200	6,498.00	0.01

980	300049	福瑞股份	200	6,486.00	0.01
981	000729	燕京啤酒	500	6,465.00	0.01
982	688480	赛恩斯	200	6,430.00	0.01
983	600601	方正科技	1,200	6,408.00	0.01
984	002935	天奥电子	400	6,400.00	0.01
985	002324	普利特	600	6,378.00	0.01
986	603071	物产环能	500	6,365.00	0.01
987	688233	神工股份	200	6,354.00	0.01
988	601609	金田股份	900	6,309.00	0.01
989	688475	萤石网络	200	6,304.00	0.01
990	300154	瑞凌股份	700	6,300.00	0.01
991	600167	联美控股	1,100	6,182.00	0.01
992	002454	松芝股份	800	6,176.00	0.01
993	002212	天融信	800	6,160.00	0.01
994	601608	中信重工	1,400	6,118.00	0.01
995	601519	大智慧	600	6,114.00	0.01
996	300448	浩云科技	900	6,102.00	0.01
997	601016	节能风电	2,100	6,069.00	0.01
998	300257	开山股份	600	6,042.00	0.01
999	300139	晓程科技	300	6,030.00	0.01
999	002120	韵达股份	900	6,030.00	0.01
100 0	002600	领益智造	700	6,013.00	0.01
100 1	000012	南 玻 A	1,300	6,006.00	0.01
100 2	002273	水晶光电	300	5,991.00	0.01
100 3	603700	宁水集团	500	5,990.00	0.01
100 4	002459	晶澳科技	600	5,988.00	0.01
100	603037	凯众股份	480	5,971.20	0.01

5					
100 6	002283	天润工业	1,000	5,960.00	0.01
100 7	603185	弘元绿能	400	5,940.00	0.01
100 8	600138	中青旅	600	5,910.00	0.01
100 9	300002	神州泰岳	500	5,900.00	0.01
101 0	000030	富奥股份	1,000	5,890.00	0.01
101 1	600829	人民同泰	800	5,872.00	0.01
101 2	301185	鸥玛软件	300	5,871.00	0.01
101 3	300525	博思软件	400	5,824.00	0.01
101 4	002075	沙钢股份	1,000	5,820.00	0.01
101 5	603877	太平鸟	400	5,800.00	0.01
101 6	600710	苏美达	600	5,766.00	0.01
101 6	301238	瑞泰新材	300	5,766.00	0.01
101 7	300416	苏试试验	400	5,732.00	0.01
101 8	002299	圣农发展	400	5,716.00	0.01
101 9	000505	京粮控股	900	5,697.00	0.01
102 0	600791	京能置业	1,200	5,676.00	0.01
102 1	600469	风神股份	1,000	5,650.00	0.01
102	002660	茂硕电源	600	5,640.00	0.01

2					
102 3	600222	太龙药业	1,000	5,590.00	0.01
102 4	000727	冠捷科技	2,300	5,589.00	0.01
102 5	600516	方大炭素	1,200	5,568.00	0.01
102 5	600398	海澜之家	800	5,568.00	0.01
102 6	002452	长高电新	800	5,560.00	0.01
102 7	000521	长虹美菱	800	5,552.00	0.01
102 8	000936	华西股份	800	5,504.00	0.01
102 9	002219	新里程	2,500	5,500.00	0.01
103 0	300194	福安药业	1,300	5,499.00	0.01
103 1	000950	重药控股	1,100	5,489.00	0.01
103 2	002081	金螳螂	1,600	5,488.00	0.01
103 3	600825	新华传媒	800	5,440.00	0.01
103 4	603527	众源新材	500	5,435.00	0.01
103 5	600824	益民集团	1,300	5,421.00	0.01
103 6	002973	侨银股份	400	5,408.00	0.01
103 7	000680	山推股份	600	5,382.00	0.01
103 8	002410	广联达	400	5,364.00	0.01
103	605016	百龙创园	260	5,363.80	0.01

9					
104 0	002238	天威视讯	600	5,286.00	0.01
104 1	688739	成大生物	200	5,280.00	0.01
104 2	600894	广日股份	500	5,245.00	0.01
104 3	603008	喜临门	300	5,244.00	0.01
104 4	300654	世纪天鸿	500	5,240.00	0.01
104 5	603703	盛洋科技	500	5,185.00	0.01
104 6	002106	莱宝高科	500	5,175.00	0.01
104 7	000921	海信家电	200	5,140.00	0.01
104 8	000682	东方电子	500	5,120.00	0.01
104 9	600169	太原重工	2,100	5,082.00	0.01
105 0	002676	顺威股份	700	5,061.00	0.01
105 1	600713	南京医药	1,000	5,060.00	0.01
105 1	000897	津滨发展	2,200	5,060.00	0.01
105 2	688558	国盛智科	200	5,048.00	0.01
105 3	688089	嘉必优	200	5,030.00	0.01
105 4	002851	麦格米特	100	5,014.00	0.01
105 5	600313	农发种业	800	5,008.00	0.01
105	300806	斯迪克	300	4,950.00	0.01

6					
105 7	300145	南方泵业	1,400	4,900.00	0.01
105 8	688425	铁建重工	1,200	4,896.00	0.01
105 9	603990	麦迪科技	300	4,875.00	0.01
106 0	300292	吴通控股	1,000	4,870.00	0.01
106 1	300238	冠昊生物	300	4,869.00	0.01
106 2	300359	全通教育	800	4,856.00	0.01
106 3	300900	广联航空	200	4,854.00	0.01
106 4	300434	金石亚药	500	4,810.00	0.01
106 5	002350	北京科锐	700	4,802.00	0.01
106 6	603339	四方科技	400	4,800.00	0.01
106 7	000919	金陵药业	700	4,767.00	0.01
106 8	688191	智洋创新	200	4,756.00	0.01
106 9	000672	上峰水泥	600	4,740.00	0.01
107 0	002368	太极股份	200	4,684.00	0.01
107 1	300102	乾照光电	400	4,628.00	0.01
107 2	600033	福建高速	1,300	4,602.00	0.01
107 3	301199	迈赫股份	180	4,593.60	0.01
107	300931	通用电梯	600	4,578.00	0.01

4					
107 5	300435	中泰股份	300	4,554.00	0.01
107 6	601918	新集能源	700	4,522.00	0.01
107 7	301220	亚香股份	100	4,490.00	0.01
107 8	688579	山大地纬	400	4,476.00	0.01
107 9	600529	山东药玻	200	4,428.00	0.01
108 0	601231	环旭电子	300	4,389.00	0.01
108 1	002033	丽江股份	500	4,360.00	0.01
108 2	600170	上海建工	1,800	4,302.00	0.01
108 3	300185	通裕重工	1,500	4,290.00	0.01
108 4	688589	力合微	200	4,278.00	0.01
108 5	002468	申通快递	400	4,276.00	0.01
108 6	600539	狮头股份	400	4,272.00	0.01
108 7	000628	高新发展	100	4,253.00	0.01
108 8	000090	天健集团	1,200	4,248.00	0.01
108 9	600755	厦门国贸	700	4,235.00	0.01
109 0	603883	老百姓	200	4,202.00	0.01
109 1	301210	金杨股份	100	4,154.00	0.01
109	000738	航发控制	200	4,150.00	0.01

2					
109 3	688398	赛特新材	200	4,142.00	0.01
109 4	002054	德美化工	600	4,128.00	0.01
109 5	605050	福然德	300	4,125.00	0.01
109 6	688590	新致软件	200	4,108.00	0.01
109 7	688225	亚信安全	200	4,078.00	0.01
109 8	000550	江铃汽车	200	4,066.00	0.01
109 9	600782	新钢股份	1,100	3,894.00	0.01
110 0	300182	捷成股份	700	3,857.00	0.01
110 1	688292	浩瀚深度	200	3,848.00	0.01
110 2	300045	华力创通	200	3,818.00	0.01
110 3	301018	申菱环境	100	3,794.00	0.01
110 4	600062	华润双鹤	200	3,732.00	0.01
110 5	600694	大商股份	200	3,710.00	0.01
110 6	300231	银信科技	300	3,693.00	0.01
110 7	688317	之江生物	200	3,604.00	0.01
110 8	688106	金宏气体	200	3,578.00	0.01
110 9	300037	新宙邦	100	3,520.00	0.01
111	603313	梦百合	400	3,400.00	0.01

0					
111 1	688378	奥来德	200	3,370.00	0.01
111 2	000828	东莞控股	300	3,207.00	0.01
111 3	600933	爱柯迪	200	3,202.00	0.01
111 4	002978	安宁股份	100	3,158.00	0.01
111 5	002563	森马服饰	600	3,156.00	0.01
111 6	002007	华兰生物	200	3,134.00	0.01
111 7	605296	神农集团	100	3,074.00	0.01
111 8	600106	重庆路桥	500	3,065.00	0.01
111 9	605289	罗曼股份	100	3,005.00	0.01
112 0	601860	紫金银行	1,000	3,000.00	0.01
112 1	300693	盛弘股份	100	2,996.00	0.01
112 2	300244	迪安诊断	200	2,980.00	0.01
112 3	603031	安孚科技	100	2,959.00	0.01
112 4	600528	中铁工业	400	2,952.00	0.01
112 5	605168	三人行	100	2,943.00	0.01
112 6	300968	格林精密	200	2,924.00	0.01
112 7	002349	精华制药	400	2,876.00	0.01
112	001282	三联锻造	140	2,850.40	0.01

8					
112 9	002303	美盈森	800	2,848.00	0.01
113 0	600993	马应龙	100	2,828.00	0.01
113 1	603235	天新药业	100	2,729.00	0.01
113 2	300193	佳士科技	300	2,715.00	0.01
113 3	000650	仁和药业	500	2,710.00	0.01
113 4	002635	安洁科技	200	2,708.00	0.01
113 5	688697	纽威数控	200	2,668.00	0.01
113 6	300862	蓝盾光电	100	2,648.00	0.01
113 7	301153	中科江南	100	2,620.00	0.00
113 8	603496	恒为科技	100	2,574.00	0.00
113 9	300042	朗科科技	100	2,474.00	0.00
114 0	000750	国海证券	600	2,472.00	0.00
114 1	300151	昌红科技	200	2,462.00	0.00
114 2	002014	永新股份	200	2,424.00	0.00
114 3	300532	今天国际	200	2,412.00	0.00
114 4	000709	河钢股份	1,100	2,376.00	0.00
114 5	000728	国元证券	300	2,367.00	0.00
114	000778	新兴铸管	600	2,232.00	0.00

6					
114 7	603815	交建股份	300	2,193.00	0.00
114 8	300685	艾德生物	100	2,153.00	0.00
114 9	300790	宇瞳光学	100	2,091.00	0.00
115 0	601128	常熟银行	280	2,063.60	0.00
115 1	600114	东睦股份	100	2,034.00	0.00
115 2	600929	雪天盐业	400	2,024.00	0.00
115 3	603999	读者传媒	300	1,983.00	0.00
115 4	300119	瑞普生物	100	1,942.00	0.00
115 5	000528	柳 工	200	1,922.00	0.00
115 6	300867	圣元环保	100	1,918.00	0.00
115 7	002508	老板电器	100	1,901.00	0.00
115 8	601208	东材科技	200	1,896.00	0.00
115 9	300499	高澜股份	100	1,780.00	0.00
116 0	600963	岳阳林纸	400	1,772.00	0.00
116 1	000035	中国天楹	400	1,716.00	0.00
116 2	000156	华数传媒	200	1,588.00	0.00
116 3	600487	亨通光电	100	1,530.00	0.00
116	300737	科顺股份	300	1,446.00	0.00

4					
116 5	002803	吉宏股份	100	1,426.00	0.00
116 6	601187	厦门银行	200	1,358.00	0.00
116 7	600480	凌云股份	100	1,217.00	0.00
116 8	300057	万顺新材	200	1,090.00	0.00
116 9	300825	阿尔特	100	1,081.00	0.00
117 0	601619	嘉泽新能	300	1,074.00	0.00
117 1	600153	建发股份	100	1,037.00	0.00
117 2	603299	苏盐井神	100	947.00	0.00
117 3	000560	我爱我家	300	891.00	0.00
117 4	002966	苏州银行	100	878.00	0.00
117 5	000402	金融街	300	846.00	0.00
117 6	600623	华谊集团	100	757.00	0.00
117 7	600509	天富能源	100	645.00	0.00
117 8	000059	华锦股份	100	539.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	600519	贵州茅台	1,721,071.00	3.26
2	300750	宁德时代	1,389,002.00	2.63
3	601318	中国平安	1,134,450.00	2.15
4	600036	招商银行	1,096,342.00	2.07
5	000333	美的集团	864,859.00	1.64
6	600900	长江电力	812,835.00	1.54
7	002594	比亚迪	766,235.00	1.45
8	601899	紫金矿业	756,651.00	1.43
9	600030	中信证券	691,455.46	1.31
10	000725	京东方 A	676,939.00	1.28
11	601166	兴业银行	676,650.00	1.28
12	601398	工商银行	649,997.00	1.23
13	601688	华泰证券	582,164.00	1.10
14	603501	豪威集团	570,937.00	1.08
15	600887	伊利股份	528,422.00	1.00
16	002475	立讯精密	525,461.00	0.99
17	300059	东方财富	518,596.00	0.98
18	000651	格力电器	517,642.00	0.98
19	603259	药明康德	491,230.00	0.93
20	601229	上海银行	487,214.00	0.92

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	919,609.00	1.74
2	300750	宁德时代	693,279.00	1.31
3	600036	招商银行	604,837.00	1.14
4	601318	中国平安	557,876.00	1.06
5	002594	比亚迪	506,119.00	0.96

6	603501	豪威集团	443,253.00	0.84
7	601398	工商银行	441,007.00	0.83
8	000725	京东方 A	427,545.00	0.81
9	000333	美的集团	408,229.00	0.77
10	601601	中国太保	401,752.00	0.76
11	600900	长江电力	396,116.00	0.75
12	300502	新易盛	394,514.00	0.75
13	002475	立讯精密	375,806.00	0.71
14	601899	紫金矿业	372,208.00	0.70
15	600030	中信证券	360,311.00	0.68
16	601288	农业银行	348,096.00	0.66
17	002415	海康威视	339,287.00	0.64
18	603259	药明康德	328,805.00	0.62
19	601688	华泰证券	323,335.00	0.61
20	601229	上海银行	320,655.00	0.61

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	159,425,438.57
卖出股票收入（成交）总额	118,999,044.74

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	9,400.39	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,400.39	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113695	华辰转债	60	6,000.29	0.01
2	118057	甬矽转债	30	3,000.07	0.01
3	123257	安克转债	4	400.03	0.00

注:本基金本报告期末仅持有三只债券。

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
无。

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

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除兴业银行（证券代码：601166）、中信证券（证券代码：600030）、华泰证券（证券代码：601688）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2024年07月17日，兴业银行（证券代码：601166）发行人兴业银行股份有限公司因未严格按照公布的收费价目名录收费、向小微企业贷款客户转嫁抵押评估费、企业划型管理不到位被国家金融监督管理总局福建监管局处以190万元罚款。

2025年05月14日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因再融资项目申请过程中出具的核查意见与实际不符被上海证券交易所予以监管警示。

2024年12月20日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因经纪业务管理存在不足、客户开户信息采集登记不规范、部分账户的可疑交易预警核查及实名制核查不充分等被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2024年08月23日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的安达科技在上市当年即发生亏损被北京证券交易所出具警示函。

2024年08月05日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的贵州安达科技能源股份有限公司上市当年即亏损被中国证券监督管理委员会贵州监管局出具警示函并记入证券期货市场诚信档案。

2024年11月28日，华泰证券（证券代码：601688）发行人华泰证券股份有限公司因与非专业机构投资者开展场外期权交易且未能有效监测参与产品购买场外期权的占比情况、部分分支机构合规管理不到位等被中国证券监督管理委员会江苏监管局出具警示函。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	4,430,103.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,430,103.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
泓德 智选 启鑫 混合A	294	139,659.90	16,464,082.14	40.10%	24,595,927.60	59.90%
泓德 智选	148	61,466.67	1,435,132.03	15.78%	7,661,934.52	84.22%

启鑫混合C						
合计	436	115,039.17	17,899,214.17	35.69%	32,257,862.12	64.31%

注：机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	泓德智选启鑫混合A	529,011.30	1.29%
	泓德智选启鑫混合C	39,586.82	0.44%
	合计	568,598.12	1.13%

注：从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	泓德智选启鑫混合A	0
	泓德智选启鑫混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德智选启鑫混合A	0
	泓德智选启鑫混合C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德智选启鑫混合A	泓德智选启鑫混合C
基金合同生效日(2025年02月05日)基金份额总额	78,875,557.80	131,454,400.84
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	35,766,030.24	9,127,180.05
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	73,581,578.30	131,484,514.34
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	41,060,009.74	9,097,066.55

注：总申购份额含转换入份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动

2025年3月27日，本基金管理人发布《泓德基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，王德晓担任公司首席信息官（兼），童良发离任公司副总经理兼首席信息官。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	2	259,119,816.54	93.07%	48,177.58	93.06%	-
国新证券	2	19,294,334.77	6.93%	3,587.14	6.93%	-
国泰海通证券	2	10,332.00	0.00%	4.51	0.01%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择国泰海通证券、渤海证券、国新证券作为证券经纪商。

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

3、基金专用交易单元的选择标准如下：

（1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；

- (2) 财务状况良好，公司经营状况稳定；
- (3) 具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。

4、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	8,967.95	100.00%	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金新增部分销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-04
2	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金新增中银国际证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-07
3	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金新增东莞证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-17
4	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金延长募集期的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-17

5	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金新增国融证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-01-21
6	泓德智选启鑫混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-06
7	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-06
8	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加海通证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-15
9	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国新证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-21
10	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-26
11	关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金基金托管人法定名称变更并修改基金合同等法律文件的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-07
12	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启鑫混合型证券投资基金的基金经理变更公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-30
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加开源证券股份有限公司为销售机构的	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-05-09

	公告		
14	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

§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	2025/03/21-2025/03/26,2025/04/07-2025/04/13,2025/05/07-2025/06/30	15,000,000.00	0.00	-	15,000,000.00	29.91%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							
在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

2025年4月3日基金托管人名称由“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”，详情可参见基金托管人发布的相关公告。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德智选启鑫混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德智选启鑫混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德智选启鑫混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德智选启鑫混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日