

泓德智选启诚混合型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:国信证券股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2025年3月18日（基金合同生效日）起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	106
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	107
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	108
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	108
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	108
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	108
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	108

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	109
8.12 投资组合报告附注	109
§9 基金份额持有人信息	110
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	110
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	111
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	111
§10 开放式基金份额变动	111
§11 重大事件揭示	112
11.1 基金份额持有人大会决议	112
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	112
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	112
11.4 基金投资策略的改变	112
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	112
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	113
11.8 其他重大事件	114
§12 影响投资者决策的其他重要信息	116
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	116
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	116
§13 备查文件目录	116
13.1 备查文件目录	116
13.2 存放地点	117
13.3 查阅方式	117

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德智选启诚混合型证券投资基金	
基金简称	泓德智选启诚混合	
基金主代码	021726	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年03月18日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	国信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	199,380,363.28份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德智选启诚混合A	泓德智选启诚混合C
下属分级基金的交易代码	021726	021727
报告期末下属分级基金的份额总额	141,160,896.64份	58,219,466.64份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过合理的资产配置，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取"自上而下"的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，动态调整基金资产在股票、债券、货币市场工具等类别资产间的分配比例，控制市场风险，提高配置效率。在股票投资中，本基金运用基金管理人开发的"多因子选股模型"以及基本面选股等多种策略进行股票选择并据此构建股票投资组合。在债券投资中，本基金采取适当的久期配置策略、个券选择策略、可转换债券投资策略、可交换债券配置策略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	国信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李娇	陈世曦
	联系电话	010-59850151	0755-81981012
	电子邮箱	lijiao@hongdefund.com	09817@guosen.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	0755-61897778
传真		010-59850195	0755-22940165
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	深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	深圳市福田区福华一路125号国信金融大厦19楼
邮政编码		100088	518000
法定代表人		王德晓	张纳沙

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期2025年03月18日（基金合同生效日） - 2025年12月31日	
	泓德智选启诚混合 A	泓德智选启诚混合 C
本期已实现收益	37,285,799.06	15,333,896.18
本期利润	43,155,430.73	18,132,713.18
加权平均基金份额本期利润	0.3011	0.2909
本期加权平均净值利润率	25.56%	24.94%
本期基金份额净值增长率	32.23%	31.81%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	
期末可供分配利润	39,909,405.22	16,215,589.68
期末可供分配基金份额利润	0.2827	0.2785
期末基金资产净值	186,659,867.41	76,738,658.83
期末基金份额净值	1.3223	1.3181
3.1.3 累计期末指标	2025年末	
基金份额累计净值增长率	32.23%	31.81%

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3月18日，本期财务报表的实际编制期间为2025年3月18日至2025年12月31日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泓德智选启诚混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	3.23%	0.89%	0.70%	0.91%	2.53%	-0.02%
过去六个月	20.55%	0.84%	17.26%	0.86%	3.29%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	32.23%	0.76%	15.65%	1.00%	16.58%	-0.24%

泓德智选启诚混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	3.13%	0.89%	0.70%	0.91%	2.43%	-0.02%
过去六个月	20.31%	0.84%	17.26%	0.86%	3.05%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	31.81%	0.76%	15.65%	1.00%	16.16%	-0.24%

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%

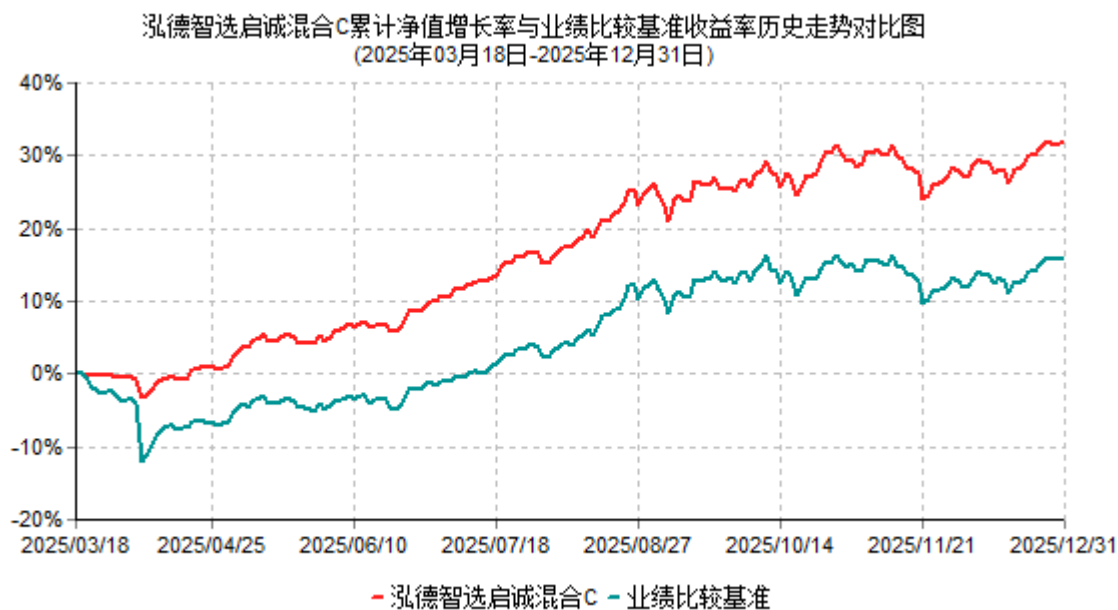
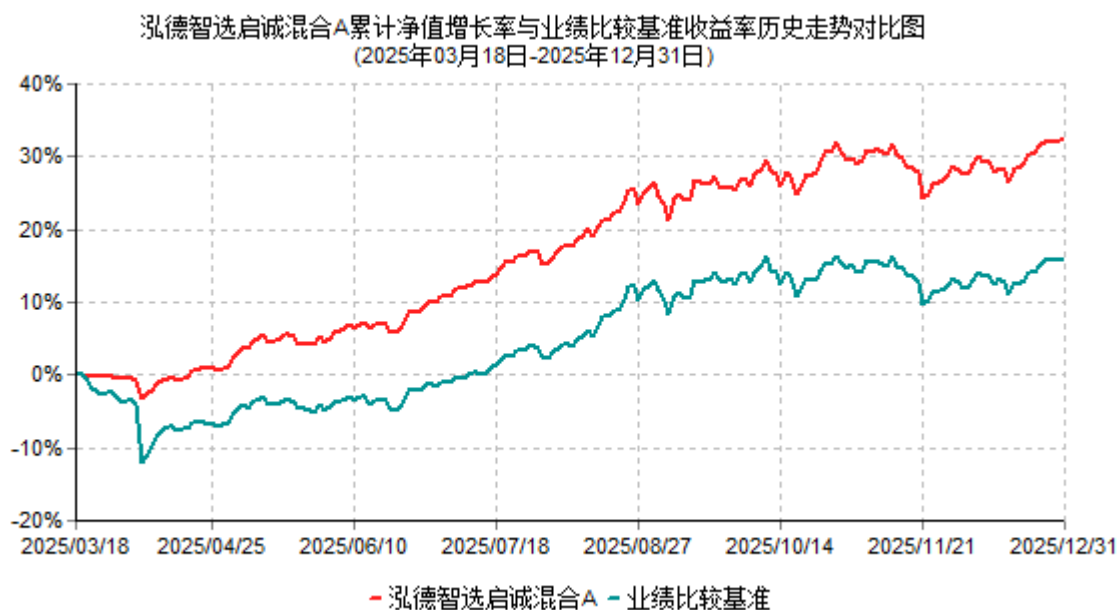
基准指数的构建原则如下：

（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。

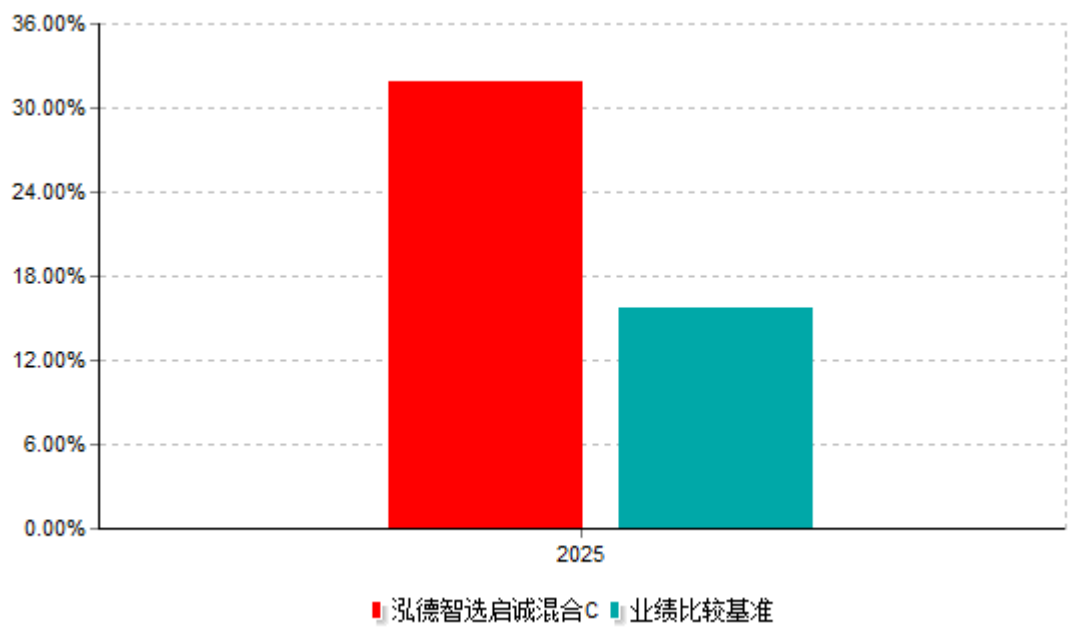
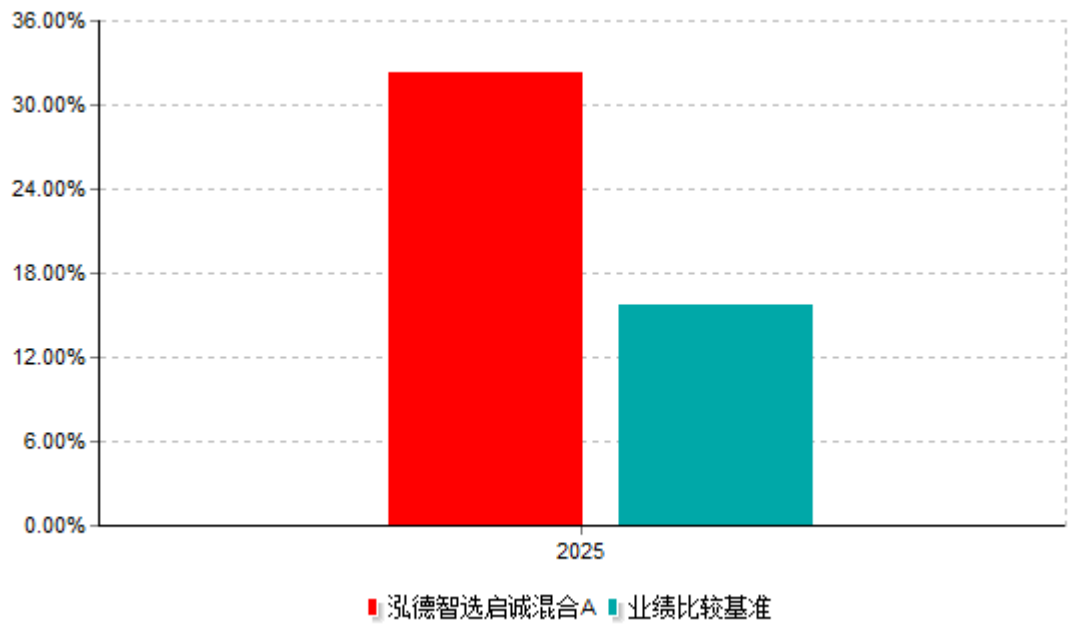
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较



注：1、本基金的基金合同于2025年3月18日生效，截至2025年12月31日止，本基金成立未满1年。

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

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同自2025年3月18日生效，生效当年净值增长率及业绩比较基准收益率按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金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、高风险等不同类型的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	2025-03-18	-	12年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A股整体表现出不错的上涨态势，成长风格占据主导，机器人、创新药、CPO、半导体等科技热点层出不穷且表现出较好的延续性，中小市值股票总体表现更强。市场风险偏好提高，成交量明显抬升，虽有美国“对等关税”事件的短期扰动，但投资者整体获得感较好。我们的投资组合经历了上半年相对稳健的超额积累后，在8、9月份大盘成长集中上涨行情中出现了一定超额回撤，我们对成长因子和成长策略做了相对深入的修正，也使模型在成长环境下有更好表现，当然，我们依然追求一个相对均衡的表现，以免超额收益过分依赖风格与行情。

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诚混合A基金份额净值为1.3223元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为32.23%，同期业绩比较基准收益率为15.65%；截至报告期末泓德智选启诚混合C基金份额净值为1.3181元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为31.81%，同期业绩比较基准收益率为15.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

去年年初，DeepSeek引燃了国产大模型的投资热情，新年伊始，智谱和Minimax在港股的大幅上涨也在一定程度上反映了投资者对国产大模型的认可，毫无疑问，AI已经成为当今最重要的投资主题，技术快速发展迭代，新的应用层出不穷，当AI可以自主编程、校验，一扇新的大门便打开了。虽然越来越多的人开始担心AI泡沫，但我们依然看到巨大的技术进步空间和产业发展空间，当然技术的飞轮在快速转动，一定会有公司被淘汰，也一定会有新的公司涌现，我们需要时刻跟踪产业的发展趋势，才有可能不被落下。宏观方面，2025年，经济增速完成5%的预定目标，整体呈现前高后低特征，出口依然强劲，投资成为拖累项，特别是房地产投资加速滑落，但经济“向新而行”趋势明显，新经济占比已超过旧经济，新质生产力蓬勃发展。新年过后，上海出台楼市新规，进一步调减住房限购政策，上调公积金贷款额度，在推动地产小阳春的同时，也提升了大家对于后续稳楼市政策的预期。2026年是“十五五”开局之年，我们依然面临着复杂的外部环境，地缘政治、贸易摩擦不会停止，我们需要有更强的定力，我们也期待更多的宏观政策落地，不断巩固经济稳中向好的态势。权益市场经历了去年的百花齐放后，依然表现出较好韧性，风险偏好显著抬升，我们也在持续挖掘可能的Alpha特征，努力为投资者创造更好收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和

执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（1）根据法律法规的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

（2）对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

（3）通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

（4）按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

（5）认真贯彻落实反洗钱各项法律法规，切实履行金融机构的反洗钱法定义务，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，2025年度未实施利润分配。

本基金截至2025年12月31日，期末可供分配利润为56,124,994.90元，其中：泓德智选启诚混合A期末可供分配利润为39,909,405.22元（泓德智选启诚混合A的未分配利润已

实现部分为39,909,405.22元，未分配利润未实现部分为5,589,565.55元），泓德智选启诚混合C期末可供分配利润为16,215,589.68元（泓德智选启诚混合C的未分配利润已实现部分为16,215,589.68元，未分配利润未实现部分为2,303,602.51元）。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，国信证券股份有限公司（以下称“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的规定及基金合同的约定，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，托管人根据有关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益分配的情况等方面进行了必要的监督、复核和审查。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人认真复核了本报告中的财务指标、净值表现等财务信息相关内容，认为其不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第80014975_A07号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泓德智选启诚混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了泓德智选启诚混合型证券投资基金

	的财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的泓德智选启诚混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了泓德智选启诚混合型证券投资基金2025年12月31日的财务状况以及2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于泓德智选启诚混合型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	泓德智选启诚混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息

	存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估泓德智选启诚混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督泓德智选启诚混合型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

	(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对泓德智选启诚混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致泓德智选启诚混合型证券投资基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	刘林厂
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室	
审计报告日期	2026-03-24	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泓德智选启诚混合型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年12月31日
资 产：		

货币资金	7.4.7.1	22,158,689.59
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	244,745,779.47
其中：股票投资		244,658,761.70
基金投资		-
债券投资		87,017.77
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		3,962,349.57
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		270,866,818.63
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		6,968,658.37
应付管理人报酬		285,429.34
应付托管费		35,678.67
应付销售服务费		26,419.12
应付投资顾问费		-

应交税费		0.01
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	152,106.88
负债合计		7,468,292.39
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	199,380,363.28
未分配利润	7.4.7.8	64,018,162.96
净资产合计		263,398,526.24
负债和净资产总计		270,866,818.63

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额总额199,380,363.28份，其中A类基金份额总额为141,160,896.64份，基金份额净值为1.3223元；C类基金份额总额为58,219,466.64份，基金份额净值为1.3181元。

7.2 利润表

会计主体：泓德智选启诚混合型证券投资基金

本报告期：2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年03月18日（基金合同 生效日）至2025年12月31 日
一、营业总收入		64,250,669.36
1.利息收入		241,002.15
其中：存款利息收入	7.4.7.9	241,002.15
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）		52,193,391.40
其中：股票投资收益	7.4.7.10	49,093,571.08
基金投资收益		-

债券投资收益	7.4.7.11	3,684.89
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.12	-
股利收益	7.4.7.13	3,096,135.43
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	8,668,448.67
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	3,147,827.14
减：二、营业总支出		2,962,525.45
1.管理人报酬		2,294,463.13
2.托管费		286,807.91
3.销售服务费		229,554.41
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.16	151,700.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		61,288,143.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		61,288,143.91
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		61,288,143.91

7.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选启诚混合型证券投资基金

本报告期：2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	292,684,200.12	-	292,684,200.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-93,303,836.84	64,018,162.96	-29,285,673.88
（一）、综合收益总额	-	61,288,143.91	61,288,143.91
（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）	-93,303,836.84	2,730,019.05	-90,573,817.79
其中：1.基金申购款	583,291,329.61	117,696,618.34	700,987,947.95
2.基金赎回款	-676,595,166.45	-114,966,599.29	-791,561,765.74
（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	199,380,363.28	64,018,162.96	263,398,526.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓

王德晓

王玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泓德智选启诚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[2025]63号《关于准予泓德智选启诚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《泓德智选启诚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292,639,559.51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_A04号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德智选启诚混合型证券投资基金基金合同》于2025年3月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为292,684,200.12份，其中认购资金利息折合44,640.61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，基金托管人为国信证券股份有限公司。

根据《泓德智选启诚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《泓德智选启诚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，力争实现基金资产的长期稳健增值。本基金的投资范围主要包括国内依法发行上市的股票（含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产（含存托凭证）占基金资产的比例为60%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证全指指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人泓德基金管理有限公司于2026年3月24日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则--基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《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》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年3月18日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况以及2025年3月18日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年3月18日(基金合同生效日)至2025年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投

资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年4月24日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的3‰调整为1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自2008年9月19日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

根据财政部、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》的规定，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、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》，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，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

7.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、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。

7.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自2013年1月1日起，证券投资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；持股期限超过1年的，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
活期存款	12,899,739.51
等于：本金	12,894,367.33
加：应计利息	5,372.18

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	9,258,950.08
等于：本金	9,258,608.85
加：应计利息	341.23
减：坏账准备	-
合计	22,158,689.59

注：其他存款为存放在证券经纪机构的证券资金账户中的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		236,018,010.38	-	244,658,761.70	8,640,751.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	59,300.00	20.42	87,017.77	27,697.35
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	59,300.00	20.42	87,017.77	27,697.35
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		236,077,310.38	20.42	244,745,779.47	8,668,448.67

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,210.88
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	144,500.00
其他应付	396.00
合计	152,106.88

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 泓德智选启诚混合A

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启诚混合A)	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
-------------------	--

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	192,599,289.14	192,599,289.14
本期申购	425,815,563.14	425,815,563.14
本期赎回（以“-”号填列）	-477,253,955.64	-477,253,955.64
本期末	141,160,896.64	141,160,896.64

7.4.7.7.2 泓德智选启诚混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启诚混合C)	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	100,084,910.98	100,084,910.98
本期申购	157,475,766.47	157,475,766.47
本期赎回（以“-”号填列）	-199,341,210.81	-199,341,210.81
本期末	58,219,466.64	58,219,466.64

注:1.申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2.本基金自2025年3月3日至2025年3月14日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币292,639,559.51元，折合为292,639,559.51份基金份额(其中A类基金份额192,567,043.40份，C类基金份额100,072,516.11份)。根据《泓德智选启诚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44,640.61元。在本基金成立后，折算为44,640.61份基金份额(其中A类基金份额32,245.74份，C类基金份额12,394.87份)，划入基金份额持有人账户。

3.根据《泓德智选启诚混合型证券投资基金基金合同》、《泓德智选启诚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诚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3月18日(基金合同生效日)至2025年4月13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4月14日起开始办理。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 泓德智选启诚混合A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

(泓德智选启诚混合A)			
上年度末	-	-	-
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	37,285,799.06	5,869,631.67	43,155,430.73
本期基金份额交易产生的变动数	2,623,606.16	-280,066.12	2,343,540.04
其中：基金申购款	67,549,463.09	21,894,586.02	89,444,049.11
基金赎回款	-64,925,856.93	-22,174,652.14	-87,100,509.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,909,405.22	5,589,565.55	45,498,970.77

7.4.7.8.2 泓德智选启诚混合C

单位：人民币元

项目 (泓德智选启诚混合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	15,333,896.18	2,798,817.00	18,132,713.18
本期基金份额交易产生的变动数	881,693.50	-495,214.49	386,479.01
其中：基金申购款	21,904,683.14	6,347,886.09	28,252,569.23
基金赎回款	-21,022,989.64	-6,843,100.58	-27,866,090.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,215,589.68	2,303,602.51	18,519,192.19

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
活期存款利息收入	211,997.32
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	29,004.83
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	241,002.15

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

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	1,122,394,403.25
减：卖出股票成本总额	1,071,653,518.09
减：交易费用	1,647,314.08
买卖股票差价收入	49,093,571.08

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	22.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,662.10
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	3,684.89

7.4.7.11.2 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03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,665.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,000.00
减：应计利息总额	2.38
减：交易费用	0.60
买卖债券差价收入	3,662.10

7.4.7.12 衍生工具收益

无。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,096,135.43
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	3,096,135.43

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	8,668,448.67

——股票投资	8,640,751.32
——债券投资	27,697.35
——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	8,668,448.67

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	3,147,744.45
基金转换费收入	82.69
合计	3,147,827.14

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

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

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	40,000.00

信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
账户维护费	10,500.00
开户费	1,200.00
合计	151,700.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
国信证券股份有限公司（以下简称“国信证券”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人的自然人股东
阳光资产管理股份有限公司	基金管理人股东
珠海市基业长青投资中心（有限合伙）	基金管理人股东
泓德基业（西藏）企业管理有限公司	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东
珠海市崇德企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东
珠海市广业企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
温永鹏	基金管理人的自然人股东
李晓春	基金管理人的自然人股东
王克玉	基金管理人的自然人股东
秦毅	基金管理人的自然人股东

李娇	基金管理人的自然人股东
李操纲	基金管理人的自然人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
国信证券	969,223,488.25	39.91%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交 总额的比例
国信证券	5,299.36	36.14%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
国信证券	422,484.40	45.41%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,294,463.13
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,065,567.75
应支付基金管理人的净管理费	1,228,895.38

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

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	286,807.91

注：支付基金托管人国信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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	泓德智选启诚混合A	泓德智选启诚混合C	合计
国信证券	0.00	64,287.42	64,287.42
合计	0.00	64,287.42	64,287.42

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
国信证券-托管户	12,899,739.51	211,997.32
国信证券-证券户	3,175,244.69	20,584.09

注：本基金托管户的银行存款由基金托管人国信证券存放在交通银行深圳燕南支行，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信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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国信证券	688759	必贝特	公开发行	4,091	72,737.98

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

报告期内，本基金参与了国泰海通证券股份有限公司（基金托管人国信证券股份有限公司的控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的关联方）承销期内承销的锦浪科技股份有限公司的可转换公司债券优先配售，上海友升铝业股份有限公司、苏州汇川联合动力系统股份有限公司、武汉禾元生物科技股份有限公司、大明电子股份有限公司、苏州丰倍生物科技股份有限公司、海安橡胶集团股份公司、江苏锡华新能源科技股份有限公司的首次公开发行人民币普通股（A股）网下申购。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	6个月以上	限售股	114.28	416.18	232	26,512.96	96,553.76	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6个月以上	限售股	104.66	399.31	170	17,792.20	67,882.70	-

301656	联合动力	2025-09-17	6个月以上	限售股	12.48	25.46	2,117	26,420.16	53,898.82	-
688759	必贝特	2025-10-21	6个月以上	限售股	17.78	25.11	1,637	29,105.86	41,105.07	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	6个月以上	限售股	83.06	117.19	200	16,612.00	23,438.00	-
688809	强一股份	2025-12-23	6个月以上	限售股	85.09	203.31	89	7,573.01	18,094.59	-
301638	南网数字	2025-11-11	6个月以上	限售股	5.69	14.21	1,218	6,930.42	17,307.78	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月以上	限售股	51.66	135.56	124	6,405.84	16,809.44	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6个月以上	限售股	13.75	18.53	853	11,728.75	15,806.09	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6个月以上	限售股	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
688783	西安奕材	2025-10-20	6个月以上	限售股	8.62	18.36	668	5,758.16	12,264.48	-
301584	建发致新	2025-09-18	6个月以上	限售股	7.05	26.82	447	3,151.35	11,988.54	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6个月以上	限售股	26.68	42.25	273	7,283.64	11,534.25	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月以上	限售股	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
0012	海安	2025	6个月以	限售	48.00	51.88	192	9,21	9,96	-

33	集团	-11-18	上	股				6.00	0.96	
301667	纳百川	2025-12-10	6个月以上	限售股	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025-12-17	6个月以上	限售股	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月以上	限售股	17.08	48.56	169	2,886.52	8,206.64	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月以上	限售股	21.00	44.80	165	3,465.00	7,392.00	-
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月以上	限售股	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
601026	道生天合	2025-10-09	6个月以上	限售股	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
001369	双欣环保	2025-12-23	6个月以上	限售股	6.85	12.89	485	3,322.25	6,251.65	-
301575	艾芬达	2025-09-03	6个月以上	限售股	27.69	49.55	126	3,488.94	6,243.30	-
603418	友升股份	2025-09-16	6个月以上	限售股	46.36	59.06	86	3,986.96	5,079.16	-
688765	禾元生物	2025-10-16	6个月以上	限售股	29.06	52.62	94	2,731.64	4,946.28	-
603092	德力佳	2025-10-30	6个月以上	限售股	46.68	55.66	84	3,921.12	4,675.44	-
001285	瑞立科密	2025-09-2	6个月以上	限售股	42.28	56.08	80	3,382.40	4,486.40	-

		3								
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月以上	限售股	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603370	华新精科	2025-08-27	6个月以上	限售股	18.60	46.35	82	1,525.20	3,800.70	-
603376	大明电子	2025-10-28	6个月以上	限售股	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月以上	限售股	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
001396	誉帆科技	2025-12-23	6个月以上	限售股	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
111024	澳弘转债	2025-12-12	1-6个月（含）	新债未上市	100.00	100.01	270	27,000.00	27,002.49	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注

				价		价				
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项目	78.81	2026-01-15	86.69	1,700	131,885.00	133,977.00	-
603508	思维列控	2025-12-29	重大事项目	27.82	2026-01-07	27.83	4,500	126,790.31	125,190.00	-

注：本基金截至2025年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，

结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(若有)占基金资产净值的比例为0.03%。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“7.4.12期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	22,158,689.59	-	-	-	22,158,689.59
交易性金融资产	-	-	87,017.77	244,658,761.70	244,745,779.47
应收申购款	-	-	-	3,962,349.57	3,962,349.57
资产总计	22,158,689.59	-	87,017.77	248,621,111.27	270,866,818.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,968,658.37	6,968,658.37
应付管	-	-	-	285,429.34	285,429.34

理人报酬					
应付托管费	-	-	-	35,678.67	35,678.67
应付销售服务费	-	-	-	26,419.12	26,419.12
应交税费	-	-	-	0.01	0.01
其他负债	-	-	-	152,106.88	152,106.88
负债总计	-	-	-	7,468,292.39	7,468,292.39
利率敏感度缺口	22,158,689.59	-	87,017.77	241,152,818.88	263,398,526.24

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为0%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	244,658,761.70	92.89
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	87,017.77	0.03
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	244,745,779.47	92.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日
第一层次	243,943,152.94
第二层次	286,169.49
第三层次	516,457.04
合计	244,745,779.47

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年03月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	604,153.09	604,153.09
转出第三层次	-	4,402.49	4,402.49
当期利得或损失总额	-	-83,293.56	-83,293.56
其中：计入损益的利得或损失	-	-83,293.56	-83,293.56
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	516,457.04	516,457.04
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-82,956.02	-82,956.02

注：于2025年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2025年3月18日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	516,457.04	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	20.86%-307.91%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

无。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	244,658,761.70	90.32
	其中：股票	244,658,761.70	90.32
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,017.77	0.03
	其中：债券	87,017.77	0.03
	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	22,158,689.59	8.18
8	其他各项资产	3,962,349.57	1.46
9	合计	270,866,818.63	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,173,302.00	0.45
B	采矿业	13,883,807.00	5.27
C	制造业	150,056,440.87	56.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,199,633.00	2.35
E	建筑业	2,934,102.00	1.11
F	批发和零售业	4,315,406.44	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	6,092,577.00	2.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,709,216.41	5.20
J	金融业	33,607,205.50	12.76
K	房地产业	2,356,932.00	0.89

L	租赁和商务服务业	2,788,058.00	1.06
M	科学研究和技术服务业	3,229,612.76	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,359,443.72	0.52
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	521,400.00	0.20
Q	卫生和社会工作	546,109.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	1,793,908.00	0.68
S	综合	91,608.00	0.03
	合计	244,658,761.70	92.89

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	62,600	4,281,840.00	1.63
2	300750	宁德时代	11,500	4,223,490.00	1.60
3	600519	贵州茅台	2,800	3,856,104.00	1.46
4	601899	紫金矿业	92,300	3,181,581.00	1.21
5	300308	中际旭创	4,100	2,501,000.00	0.95
6	300502	新易盛	5,340	2,300,899.20	0.87
7	600036	招商银行	47,700	2,008,170.00	0.76
8	000333	美的集团	25,100	1,961,565.00	0.74
9	601166	兴业银行	92,600	1,950,156.00	0.74
10	600030	中信证券	66,300	1,903,473.00	0.72
11	300274	阳光电源	9,800	1,676,192.00	0.64
12	601600	中国铝业	125,700	1,536,054.00	0.58
13	601398	工商银行	191,500	1,518,595.00	0.58
14	000725	京东方 A	340,300	1,432,663.00	0.54
15	300059	东方财富	53,300	1,235,494.00	0.47
16	603019	中科曙光	14,400	1,233,216.00	0.47

17	603259	药明康德	13,400	1,214,576.00	0.46
18	601688	华泰证券	51,400	1,212,526.00	0.46
19	601288	农业银行	155,200	1,191,936.00	0.45
20	601857	中国石油	114,400	1,190,904.00	0.45
21	600887	伊利股份	40,200	1,149,720.00	0.44
22	000100	TCL科技	241,000	1,094,140.00	0.42
23	002027	分众传媒	144,400	1,064,228.00	0.40
24	600900	长江电力	37,600	1,022,344.00	0.39
25	300033	同花顺	3,100	998,758.00	0.38
26	002415	海康威视	32,900	981,736.00	0.37
27	600989	宝丰能源	48,400	950,092.00	0.36
28	601138	工业富联	14,900	924,545.00	0.35
29	002475	立讯精密	15,800	896,018.00	0.34
30	603993	洛阳钼业	44,700	894,000.00	0.34
31	600919	江苏银行	83,600	869,440.00	0.33
32	600660	福耀玻璃	12,700	822,579.00	0.31
33	600039	四川路桥	81,800	813,910.00	0.31
34	688256	寒武纪	600	813,330.00	0.31
35	002142	宁波银行	27,500	772,475.00	0.29
36	601328	交通银行	106,100	769,225.00	0.29
37	601601	中国太保	18,000	754,380.00	0.29
38	601988	中国银行	129,900	744,327.00	0.28
39	000338	潍柴动力	43,200	743,040.00	0.28
40	300162	雷曼光电	90,000	731,700.00	0.28
41	600011	华能国际	97,100	724,366.00	0.28
42	600549	厦门钨业	17,600	722,656.00	0.27
43	688041	海光信息	3,200	718,112.00	0.27
44	600938	中国海油	23,700	715,266.00	0.27
45	600276	恒瑞医药	11,919	710,014.83	0.27
46	601336	新华保险	9,900	690,030.00	0.26
47	600183	生益科技	9,600	685,536.00	0.26

48	600000	浦发银行	54,900	682,956.00	0.26
49	600941	中国移动	6,700	677,035.00	0.26
50	000776	广发证券	30,700	676,014.00	0.26
51	002594	比亚迪	6,900	674,268.00	0.26
52	601881	中国银河	42,800	672,816.00	0.26
53	600019	宝钢股份	90,100	671,245.00	0.25
54	000792	盐湖股份	23,800	670,208.00	0.25
55	688981	中芯国际	5,451	669,546.33	0.25
56	600050	中国联通	130,600	667,366.00	0.25
57	601225	陕西煤业	31,200	665,184.00	0.25
58	000166	申万宏源	123,400	650,318.00	0.25
59	601898	中煤能源	51,700	643,148.00	0.24
60	600795	国电电力	127,400	642,096.00	0.24
61	601728	中国电信	101,400	638,820.00	0.24
62	600547	山东黄金	16,000	619,360.00	0.24
63	601919	中远海控	39,500	599,610.00	0.23
64	002414	高德红外	40,600	595,602.00	0.23
65	601319	中国人保	66,400	594,280.00	0.23
66	601088	中国神华	14,600	591,300.00	0.22
67	300407	凯发电气	52,200	590,904.00	0.22
68	600406	国电南瑞	25,900	582,232.00	0.22
69	002236	大华股份	30,300	573,882.00	0.22
70	688223	晶科能源	101,400	571,896.00	0.22
71	000895	双汇发展	21,400	566,458.00	0.22
72	300124	汇川技术	7,500	564,975.00	0.21
73	002916	深南电路	2,390	555,173.10	0.21
74	600488	津药药业	135,700	555,013.00	0.21
75	603444	吉比特	1,300	551,005.00	0.21
76	603699	纽威股份	10,600	550,882.00	0.21
77	002714	牧原股份	10,800	546,264.00	0.21
78	600958	东方证券	49,900	543,910.00	0.21

79	002028	思源电气	3,500	541,065.00	0.21
80	002384	东山精密	6,300	533,295.00	0.20
81	000651	格力电器	13,200	530,904.00	0.20
82	600029	南方航空	65,500	524,655.00	0.20
83	002367	康力电梯	64,600	520,676.00	0.20
84	000708	中信特钢	31,000	507,470.00	0.19
85	600309	万华化学	6,600	506,088.00	0.19
86	600690	海尔智家	19,300	503,537.00	0.19
87	002111	威海广泰	47,500	499,700.00	0.19
88	603390	通达电气	37,600	491,432.00	0.19
89	000600	建投能源	57,200	487,916.00	0.19
90	002625	光启技术	10,000	487,600.00	0.19
91	002001	新 和 成	19,200	483,648.00	0.18
92	688055	龙腾光电	134,000	482,400.00	0.18
93	600415	小商品城	30,000	478,500.00	0.18
94	000553	安道麦A	86,300	472,924.00	0.18
95	601168	西部矿业	17,100	472,644.00	0.18
96	000301	东方盛虹	43,300	471,537.00	0.18
97	600876	凯盛新能	47,800	471,308.00	0.18
98	002724	海洋王	68,500	464,430.00	0.18
99	600066	宇通客车	14,200	464,340.00	0.18
100	688072	拓荆科技	1,400	462,000.00	0.18
101	301535	浙江华远	21,000	459,900.00	0.17
102	600084	中信尼雅	87,500	459,375.00	0.17
103	300857	协创数据	2,700	455,436.00	0.17
104	601598	中国外运	75,100	455,106.00	0.17
105	300787	海能实业	38,600	453,550.00	0.17
106	600926	杭州银行	29,000	443,120.00	0.17
107	002436	兴森科技	20,900	442,453.00	0.17
108	600489	中金黄金	18,700	436,832.00	0.17
109	000858	五 粮 液	4,100	434,354.00	0.16

110	601999	出版传媒	63,200	434,184.00	0.16
111	601865	福莱特	27,700	434,059.00	0.16
112	300476	胜宏科技	1,500	431,370.00	0.16
113	300628	亿联网络	12,000	427,800.00	0.16
114	601628	中国人寿	9,400	427,700.00	0.16
115	601009	南京银行	37,200	425,196.00	0.16
116	300972	万辰集团	2,100	422,247.00	0.16
117	600801	华新建材	17,200	422,088.00	0.16
118	600999	招商证券	25,200	419,328.00	0.16
119	300442	润泽科技	7,900	417,120.00	0.16
120	688009	中国通号	75,600	413,532.00	0.16
121	600970	中材国际	39,800	413,522.00	0.16
122	605098	行动教育	9,900	413,424.00	0.16
123	002412	汉森制药	64,400	412,804.00	0.16
124	300999	金龙鱼	14,300	410,982.00	0.16
125	601808	中海油服	29,200	409,968.00	0.16
126	603629	利通电子	15,200	405,080.00	0.15
127	601111	中国国航	42,100	394,477.00	0.15
128	688425	铁建重工	77,200	391,404.00	0.15
129	601066	中信建投	14,600	390,842.00	0.15
130	002022	科华生物	65,700	390,258.00	0.15
131	603309	维力医疗	28,300	384,597.00	0.15
132	000933	神火股份	14,000	384,580.00	0.15
133	002079	苏州固锝	40,200	383,910.00	0.15
134	002314	南山控股	134,700	383,895.00	0.15
135	001914	招商积余	35,800	382,344.00	0.15
136	300115	长盈精密	8,200	381,300.00	0.14
137	601555	东吴证券	41,600	376,896.00	0.14
138	688127	蓝特光学	9,642	371,120.58	0.14
139	603167	渤海轮渡	39,200	369,656.00	0.14
140	600299	安迪苏	41,200	369,564.00	0.14

141	603989	艾华集团	22,000	369,160.00	0.14
142	601766	中国中车	54,100	368,962.00	0.14
143	300014	亿纬锂能	5,600	368,256.00	0.14
144	603379	三美股份	6,000	364,320.00	0.14
145	600096	云天化	10,800	360,828.00	0.14
146	601658	邮储银行	66,200	360,790.00	0.14
147	300515	三德科技	18,300	359,778.00	0.14
148	000063	中兴通讯	9,500	359,480.00	0.14
149	601998	中信银行	46,500	358,050.00	0.14
150	601939	建设银行	38,400	356,352.00	0.14
151	603558	健盛集团	31,700	355,991.00	0.14
152	002552	宝鼎科技	21,500	354,965.00	0.13
153	002758	浙农股份	35,200	354,464.00	0.13
154	600848	上海临港	29,800	348,660.00	0.13
155	600851	海欣股份	50,800	346,964.00	0.13
156	000020	深华发 A	24,900	345,363.00	0.13
157	300394	天孚通信	1,700	345,151.00	0.13
158	688008	澜起科技	2,929	345,036.20	0.13
159	688183	生益电子	3,600	344,484.00	0.13
160	688208	道通科技	9,309	342,571.20	0.13
161	600716	凤凰股份	88,400	342,108.00	0.13
162	300433	蓝思科技	11,300	342,051.00	0.13
163	003816	中国广核	90,900	341,784.00	0.13
164	300639	凯普生物	63,250	340,285.00	0.13
165	600067	冠城新材	81,900	339,885.00	0.13
166	600935	华塑股份	137,100	335,895.00	0.13
167	603527	众源新材	30,200	334,918.00	0.13
168	002463	沪电股份	4,500	328,815.00	0.12
169	002371	北方华创	715	328,242.20	0.12
170	000717	中南股份	125,400	324,786.00	0.12
171	600061	国投资本	42,400	324,360.00	0.12

172	603986	兆易创新	1,500	321,375.00	0.12
173	603010	万盛股份	30,500	320,860.00	0.12
174	300447	全信股份	17,700	320,016.00	0.12
175	000977	浪潮信息	4,800	319,680.00	0.12
176	603889	新澳股份	40,200	319,590.00	0.12
177	300932	三友联众	26,600	318,934.00	0.12
178	002835	同为股份	19,400	317,772.00	0.12
179	002678	珠江钢琴	59,500	317,135.00	0.12
180	603912	佳力图	36,900	316,233.00	0.12
181	002466	天齐锂业	5,700	315,666.00	0.12
182	601816	京沪高铁	61,100	314,665.00	0.12
183	002950	奥美医疗	28,700	313,404.00	0.12
184	603519	立霸股份	25,900	311,577.00	0.12
185	300709	精研科技	6,600	311,256.00	0.12
186	601698	中国卫通	8,700	310,851.00	0.12
187	300136	信维通信	5,000	310,000.00	0.12
188	002039	黔源电力	17,000	308,890.00	0.12
189	600188	兖矿能源	23,400	307,710.00	0.12
190	300365	恒华科技	48,200	304,624.00	0.12
191	600118	中国卫星	3,200	303,840.00	0.12
192	300102	乾照光电	11,000	303,160.00	0.12
193	603231	索宝蛋白	16,500	302,280.00	0.11
194	600613	神奇制药	49,600	301,072.00	0.11
195	600025	华能水电	33,100	300,548.00	0.11
196	605305	中际联合	7,200	299,952.00	0.11
197	002238	天威视讯	36,800	299,184.00	0.11
198	002241	歌尔股份	10,400	298,792.00	0.11
199	301339	通行宝	20,500	298,070.00	0.11
200	605266	健之佳	15,500	297,910.00	0.11
201	600115	中国东航	49,600	297,600.00	0.11
202	688278	特宝生物	3,555	297,482.40	0.11

203	301200	大族数控	2,500	296,925.00	0.11
204	605138	盛泰集团	42,600	296,496.00	0.11
205	600150	中国船舶	8,900	296,014.00	0.11
206	601233	桐昆股份	17,100	294,291.00	0.11
207	002493	荣盛石化	25,100	293,921.00	0.11
208	002050	三花智控	5,300	293,143.00	0.11
209	600057	厦门象屿	34,400	293,088.00	0.11
210	688095	福昕软件	3,283	293,073.41	0.11
211	688372	伟测科技	2,679	292,252.11	0.11
212	603501	豪威集团	2,300	289,570.00	0.11
213	600160	巨化股份	7,500	288,150.00	0.11
214	002996	顺博合金	37,900	286,524.00	0.11
215	600018	上港集团	52,800	286,176.00	0.11
216	300369	绿盟科技	38,100	284,988.00	0.11
217	001979	招商蛇口	32,900	284,256.00	0.11
218	688119	中钢洛耐	50,800	283,972.00	0.11
219	600016	民生银行	74,000	283,420.00	0.11
220	002709	天赐材料	6,100	282,613.00	0.11
221	001289	龙源电力	18,700	281,248.00	0.11
222	601668	中国建筑	54,700	280,611.00	0.11
223	600909	华安证券	41,300	280,014.00	0.11
224	000975	山金国际	11,500	279,795.00	0.11
225	300239	东宝生物	47,600	278,936.00	0.11
226	603967	中创物流	20,300	278,719.00	0.11
227	000001	平安银行	24,400	278,404.00	0.11
228	000543	皖能电力	35,000	278,250.00	0.11
229	300105	龙源技术	38,800	277,808.00	0.11
230	000988	华工科技	3,500	277,655.00	0.11
231	601019	山东出版	31,300	270,432.00	0.10
232	601018	宁波港	74,400	270,072.00	0.10
233	000807	云铝股份	8,200	269,288.00	0.10

234	002849	威星智能	16,900	268,710.00	0.10
235	002149	西部材料	5,900	268,509.00	0.10
236	603206	嘉环科技	15,300	264,537.00	0.10
237	603766	隆鑫通用	16,400	264,204.00	0.10
238	601121	宝地矿业	35,500	261,990.00	0.10
239	603103	横店影视	15,800	261,964.00	0.10
240	300803	指南针	2,000	261,740.00	0.10
241	000408	藏格矿业	3,100	261,640.00	0.10
242	603132	金徽股份	17,700	259,659.00	0.10
243	000589	贵州轮胎	49,900	258,482.00	0.10
244	600111	北方稀土	5,600	258,272.00	0.10
245	002782	可立克	14,200	257,872.00	0.10
246	300752	隆利科技	14,100	257,325.00	0.10
247	600419	天润乳业	25,900	256,410.00	0.10
248	688002	睿创微纳	2,540	256,032.00	0.10
249	600741	华域汽车	12,800	256,000.00	0.10
250	300681	英搏尔	10,200	255,612.00	0.10
251	601963	重庆银行	23,600	255,588.00	0.10
252	000655	金岭矿业	26,900	255,550.00	0.10
253	002452	长高电新	31,000	255,130.00	0.10
254	300223	北京君正	2,400	254,496.00	0.10
255	300604	长川科技	2,500	253,275.00	0.10
256	002106	莱宝高科	23,100	253,176.00	0.10
257	603306	华懋科技	4,000	252,040.00	0.10
258	002600	领益智造	16,200	251,748.00	0.10
259	300390	天华新能	4,600	251,206.00	0.10
260	688057	金达莱	20,526	250,827.72	0.10
261	603551	奥普科技	21,600	250,344.00	0.10
262	600725	云维股份	59,800	249,964.00	0.09
263	603170	宝立食品	17,500	249,900.00	0.09
264	601208	东材科技	9,200	249,228.00	0.09

265	605376	博迁新材	3,800	248,520.00	0.09
266	601995	中金公司	7,100	248,500.00	0.09
267	601333	广深铁路	81,600	248,064.00	0.09
268	002407	多氟多	7,300	247,543.00	0.09
269	600685	中船防务	8,700	247,515.00	0.09
270	002545	东方铁塔	13,200	243,540.00	0.09
271	601900	南方传媒	18,100	242,721.00	0.09
272	603060	国检集团	39,900	242,592.00	0.09
273	300389	艾比森	14,900	241,827.00	0.09
274	300187	永清环保	49,600	241,552.00	0.09
275	605116	奥锐特	9,600	240,480.00	0.09
276	300682	朗新科技	15,800	240,318.00	0.09
277	300257	开山股份	17,100	240,255.00	0.09
278	600886	国投电力	18,300	240,096.00	0.09
279	300533	冰川网络	6,900	239,637.00	0.09
280	601877	正泰电器	8,500	237,065.00	0.09
281	601169	北京银行	43,200	236,736.00	0.09
282	300317	珈伟新能	61,600	236,544.00	0.09
283	603856	东宏股份	18,900	235,683.00	0.09
284	300219	鸿利智汇	32,500	234,325.00	0.09
285	000048	京基智农	13,300	234,080.00	0.09
286	000529	广弘控股	38,900	233,789.00	0.09
287	301500	飞南资源	14,900	233,781.00	0.09
288	300636	同和药业	31,100	233,561.00	0.09
289	002588	史丹利	23,200	231,536.00	0.09
290	000960	锡业股份	8,300	231,404.00	0.09
291	603737	三棵树	5,000	231,350.00	0.09
292	600362	江西铜业	4,200	230,664.00	0.09
293	603187	海容冷链	14,700	230,643.00	0.09
294	688017	绿的谐波	1,200	230,520.00	0.09
295	603979	金诚信	3,000	228,450.00	0.09

296	603088	宁波精达	22,000	227,260.00	0.09
297	601888	中国中免	2,400	226,944.00	0.09
298	688025	杰普特	1,600	226,512.00	0.09
299	600845	宝信软件	10,900	225,739.00	0.09
300	600282	南钢股份	42,900	225,654.00	0.09
301	000426	兴业银锡	6,300	224,280.00	0.09
302	301015	百洋医药	9,500	224,200.00	0.09
303	601229	上海银行	22,100	223,210.00	0.08
304	300435	中泰股份	10,000	222,200.00	0.08
305	600988	赤峰黄金	7,100	221,804.00	0.08
306	603816	顾家家居	7,200	221,328.00	0.08
307	600346	恒力石化	9,800	220,794.00	0.08
308	688362	甬矽电子	6,800	220,388.00	0.08
309	300573	兴齐眼药	3,120	219,304.80	0.08
310	600724	宁波富达	37,500	216,000.00	0.08
311	600623	华谊集团	28,000	215,880.00	0.08
312	300048	合康新能	36,200	215,390.00	0.08
313	301529	福赛科技	1,900	214,890.00	0.08
314	600469	风神股份	30,900	214,446.00	0.08
315	603229	奥翔药业	21,600	214,272.00	0.08
316	002460	赣锋锂业	3,400	213,826.00	0.08
317	301239	普瑞眼科	6,500	213,785.00	0.08
318	600760	中航沈飞	3,800	213,370.00	0.08
319	003025	思进智能	14,800	212,676.00	0.08
320	600819	耀皮玻璃	26,300	212,504.00	0.08
321	300532	今天国际	18,000	212,040.00	0.08
322	002156	通富微电	5,600	211,120.00	0.08
323	300583	赛托生物	15,400	210,826.00	0.08
324	300824	北鼎股份	18,600	210,366.00	0.08
325	300450	先导智能	4,200	209,916.00	0.08
326	688410	山外山	14,000	209,580.00	0.08

327	301186	超达装备	4,300	208,808.00	0.08
328	001313	粤海饲料	28,500	208,620.00	0.08
329	688609	九联科技	20,400	208,284.00	0.08
330	601633	长城汽车	9,200	208,196.00	0.08
331	603121	华培动力	9,800	207,368.00	0.08
332	600479	千金药业	20,400	207,264.00	0.08
333	688677	海泰新光	4,800	207,168.00	0.08
334	600386	北巴传媒	47,100	206,769.00	0.08
335	603897	长城科技	7,600	206,720.00	0.08
336	603701	德宏股份	10,200	205,632.00	0.08
337	002353	杰瑞股份	2,900	205,407.00	0.08
338	002913	奥士康	4,800	205,152.00	0.08
339	603799	华友钴业	3,000	204,780.00	0.08
340	002738	中矿资源	2,600	204,230.00	0.08
341	002402	和而泰	5,200	203,424.00	0.08
342	600028	中国石化	32,800	202,704.00	0.08
343	300130	新国都	7,300	202,429.00	0.08
344	000931	中关村	41,500	202,105.00	0.08
345	603529	爱玛科技	6,800	201,960.00	0.08
346	600873	梅花生物	19,900	201,587.00	0.08
347	600141	兴发集团	5,800	200,564.00	0.08
348	688048	长光华芯	1,600	200,560.00	0.08
349	601800	中国交建	24,000	197,760.00	0.08
350	000887	中鼎股份	8,500	197,285.00	0.07
351	603633	徕木股份	19,400	196,522.00	0.07
352	301031	中熔电气	1,744	195,659.36	0.07
353	600956	新天绿能	26,900	195,025.00	0.07
354	000959	首钢股份	39,700	194,530.00	0.07
355	605008	长鸿高科	13,600	194,072.00	0.07
356	603611	诺力股份	7,900	193,155.00	0.07
357	688536	思瑞浦	1,200	191,856.00	0.07

358	001322	箭牌家居	21,600	191,592.00	0.07
359	002162	悦心健康	41,000	191,060.00	0.07
360	002601	龙佰集团	9,700	189,926.00	0.07
361	605058	澳弘电子	6,200	189,224.00	0.07
362	603569	长久物流	24,700	188,955.00	0.07
363	688281	华秦科技	2,557	188,706.60	0.07
364	600219	南山铝业	35,000	188,300.00	0.07
365	300080	易成新能	38,700	188,082.00	0.07
366	002487	大金重工	3,600	186,948.00	0.07
367	600580	卧龙电驱	3,800	186,580.00	0.07
368	688772	珠海冠宇	8,600	185,158.00	0.07
369	603697	有友食品	15,100	184,975.00	0.07
370	300073	当升科技	3,200	184,960.00	0.07
371	688111	金山办公	600	184,242.00	0.07
372	300693	盛弘股份	4,800	183,744.00	0.07
373	688029	南微医学	2,243	182,939.08	0.07
374	603399	永杉锂业	17,600	182,864.00	0.07
375	301225	恒勃股份	1,100	182,050.00	0.07
376	302132	中航成飞	2,300	181,700.00	0.07
377	603296	华勤技术	2,000	181,480.00	0.07
378	601127	赛力斯	1,500	181,440.00	0.07
379	605117	德业股份	2,100	181,020.00	0.07
380	601958	金钼股份	11,600	180,728.00	0.07
381	600739	辽宁成大	16,100	179,998.00	0.07
382	601339	百隆东方	31,000	179,490.00	0.07
383	301299	卓创资讯	3,300	179,454.00	0.07
384	300775	三角防务	5,900	179,360.00	0.07
385	301193	家联科技	8,300	179,031.00	0.07
386	601377	兴业证券	24,100	178,822.00	0.07
387	300408	三环集团	3,900	178,425.00	0.07
388	603043	广州酒家	10,100	178,063.00	0.07

389	688698	伟创电气	1,800	177,984.00	0.07
390	600132	重庆啤酒	3,400	177,616.00	0.07
391	300562	乐心医疗	13,300	177,289.00	0.07
392	301345	涛涛车业	700	175,924.00	0.07
393	002293	罗莱生活	17,100	175,617.00	0.07
394	300619	金银河	4,000	175,600.00	0.07
395	600031	三一重工	8,300	175,379.00	0.07
396	601390	中国中铁	32,400	175,284.00	0.07
397	601298	青岛港	21,000	175,140.00	0.07
398	688167	炬光科技	1,000	175,070.00	0.07
399	300543	朗科智能	15,700	174,584.00	0.07
400	601696	中银证券	11,600	173,884.00	0.07
401	601108	财通证券	19,900	173,528.00	0.07
402	688598	金博股份	5,886	172,812.96	0.07
403	002690	美亚光电	8,400	172,788.00	0.07
404	300755	华致酒行	9,800	172,676.00	0.07
405	688036	传音控股	2,600	172,016.00	0.07
406	300363	博腾股份	7,400	171,976.00	0.07
407	002170	芭田股份	14,100	171,738.00	0.07
408	688213	思特威	1,800	171,162.00	0.06
409	300228	富瑞特装	17,300	171,097.00	0.06
410	603890	春秋电子	10,600	170,978.00	0.06
411	300805	电声股份	16,200	170,910.00	0.06
412	688007	光峰科技	9,200	170,844.00	0.06
413	688595	芯海科技	5,200	170,560.00	0.06
414	300395	菲利华	1,700	170,510.00	0.06
415	002624	完美世界	10,400	170,456.00	0.06
416	002661	克明食品	18,600	170,004.00	0.06
417	002518	科士达	3,500	169,820.00	0.06
418	600732	爱旭股份	12,600	168,840.00	0.06
419	603885	吉祥航空	11,300	168,144.00	0.06

420	000062	深圳华强	6,800	167,416.00	0.06
421	002458	益生股份	19,900	166,762.00	0.06
422	002396	星网锐捷	5,500	166,650.00	0.06
423	601021	春秋航空	2,800	166,600.00	0.06
424	300938	信测标准	5,100	166,260.00	0.06
425	601077	渝农商行	25,700	166,022.00	0.06
426	300789	唐源电气	7,200	165,600.00	0.06
427	601818	光大银行	47,400	165,426.00	0.06
428	002534	西子洁能	9,800	164,346.00	0.06
429	600918	中泰证券	25,200	163,800.00	0.06
430	002138	顺络电子	4,600	163,438.00	0.06
431	601886	江河集团	20,000	163,200.00	0.06
432	688279	峰昭科技	800	162,792.00	0.06
433	000568	泸州老窖	1,400	162,708.00	0.06
434	600273	嘉化能源	18,600	162,564.00	0.06
435	600251	冠农股份	17,600	162,448.00	0.06
436	688630	芯碁微装	1,200	161,436.00	0.06
437	600662	外服控股	32,100	161,142.00	0.06
438	600176	中国巨石	9,400	160,740.00	0.06
439	601678	滨化股份	37,900	160,696.00	0.06
440	688312	燕麦科技	4,819	159,894.42	0.06
441	600389	江山股份	6,300	159,264.00	0.06
442	301029	怡合达	6,000	159,120.00	0.06
443	688391	钜泉科技	5,600	158,648.00	0.06
444	300868	杰美特	5,000	158,500.00	0.06
445	600814	杭州解百	19,500	157,950.00	0.06
446	000039	中集集团	15,600	157,404.00	0.06
447	002905	金逸影视	13,800	155,940.00	0.06
448	300784	利安科技	3,100	155,682.00	0.06
449	002824	和胜股份	8,000	155,200.00	0.06
450	688187	时代电气	3,000	153,870.00	0.06

451	601968	宝钢包装	28,800	153,792.00	0.06
452	002004	华邦健康	32,100	153,438.00	0.06
453	300347	泰格医药	2,700	153,090.00	0.06
454	002074	国轩高科	3,900	152,529.00	0.06
455	301149	隆华新材	14,300	152,152.00	0.06
456	000990	诚志股份	19,200	152,064.00	0.06
457	688200	华峰测控	799	151,969.80	0.06
458	300140	节能环保	22,400	151,648.00	0.06
459	002541	鸿路钢构	9,200	151,248.00	0.06
460	603886	元祖股份	10,800	150,876.00	0.06
461	601020	华钰矿业	5,600	150,416.00	0.06
462	000938	紫光股份	6,100	150,060.00	0.06
463	688411	海博思创	600	150,024.00	0.06
464	301102	兆讯传媒	14,300	150,007.00	0.06
465	603588	高能环境	19,400	149,768.00	0.06
466	002311	海大集团	2,700	149,526.00	0.06
467	300438	鹏辉能源	2,800	149,016.00	0.06
468	600032	浙江新能	20,100	148,941.00	0.06
469	688509	正元地信	27,100	148,779.00	0.06
470	300193	佳士科技	16,600	148,570.00	0.06
471	002182	宝武镁业	9,700	148,410.00	0.06
472	600262	北方股份	5,700	148,371.00	0.06
473	000901	航天科技	5,200	148,044.00	0.06
474	001335	信凯科技	3,000	147,960.00	0.06
475	600210	紫江企业	20,100	147,735.00	0.06
476	002322	理工能科	12,300	147,723.00	0.06
477	600015	华夏银行	21,500	147,705.00	0.06
478	300453	三鑫医疗	16,900	147,368.00	0.06
479	603365	水星家纺	7,000	147,280.00	0.06
480	002884	凌霄泵业	8,300	146,827.00	0.06
481	603323	苏农银行	28,990	146,399.50	0.06

482	600546	山煤国际	14,500	146,305.00	0.06
483	688508	芯朋微	2,400	146,160.00	0.06
484	603556	海兴电力	4,000	145,600.00	0.06
485	300227	光韵达	15,800	145,518.00	0.06
486	300633	开立医疗	5,500	145,310.00	0.06
487	000951	中国重汽	8,500	143,650.00	0.05
488	301162	国能日新	2,800	143,528.00	0.05
489	301007	德迈仕	3,500	141,820.00	0.05
490	688568	中科星图	2,400	141,600.00	0.05
491	003009	中天火箭	1,800	141,372.00	0.05
492	600803	新奥股份	6,800	141,168.00	0.05
493	600498	烽火通信	4,400	141,152.00	0.05
494	600328	中盐化工	17,100	140,904.00	0.05
495	002483	润邦股份	19,700	140,658.00	0.05
496	688602	康鹏科技	16,200	140,616.00	0.05
497	603380	易德龙	3,700	140,600.00	0.05
498	002148	北纬科技	15,700	139,730.00	0.05
499	300005	探路者	12,900	139,707.00	0.05
500	002064	华峰化学	12,700	139,700.00	0.05
501	002444	巨星科技	4,100	139,482.00	0.05
502	002948	青岛银行	31,000	138,880.00	0.05
503	002099	海翔药业	22,100	137,904.00	0.05
504	603661	恒林股份	4,300	137,643.00	0.05
505	600361	创新新材	32,400	137,376.00	0.05
506	301348	蓝箭电子	6,800	137,292.00	0.05
507	300882	万胜智能	7,300	137,240.00	0.05
508	301367	瑞迈特	1,600	137,136.00	0.05
509	002428	云南锗业	4,300	136,525.00	0.05
510	688131	皓元医药	1,894	136,519.52	0.05
511	002635	安洁科技	9,800	135,828.00	0.05
512	000750	国海证券	32,000	135,680.00	0.05

513	600261	阳光照明	40,200	135,474.00	0.05
514	600104	上汽集团	8,900	135,458.00	0.05
515	002759	天际股份	2,900	134,647.00	0.05
516	688510	航亚科技	5,000	134,500.00	0.05
517	002558	巨人网络	3,100	134,199.00	0.05
518	002352	顺丰控股	3,500	134,120.00	0.05
519	002049	紫光国微	1,700	133,977.00	0.05
520	003019	宸展光电	4,000	133,920.00	0.05
521	601825	沪农商行	14,400	133,776.00	0.05
522	688226	威腾电气	3,600	133,560.00	0.05
523	601991	大唐发电	38,200	133,318.00	0.05
524	300011	鼎汉技术	15,500	132,990.00	0.05
525	002532	天山铝业	8,200	132,676.00	0.05
526	600482	中国动力	6,400	132,480.00	0.05
527	002956	西麦食品	4,700	132,164.00	0.05
528	300656	民德电子	6,000	132,120.00	0.05
529	601100	恒立液压	1,200	131,892.00	0.05
530	002128	电投能源	4,700	131,177.00	0.05
531	688378	奥来德	4,800	131,040.00	0.05
532	688569	铁科轨道	5,952	130,765.44	0.05
533	002839	张家港行	28,600	130,702.00	0.05
534	301180	万祥科技	7,800	130,260.00	0.05
535	000603	盛达资源	4,200	130,032.00	0.05
536	600278	东方创业	17,100	129,960.00	0.05
537	002616	长青集团	23,800	129,948.00	0.05
538	688519	南亚新材	1,600	129,376.00	0.05
539	000915	华特达因	3,900	128,856.00	0.05
540	600817	宇通重工	11,300	128,481.00	0.05
541	688498	源杰科技	200	128,398.00	0.05
542	002837	英维克	1,200	128,268.00	0.05
543	300567	精测电子	1,400	127,680.00	0.05

544	688292	浩瀚深度	4,400	127,600.00	0.05
545	688578	艾力斯	1,223	127,375.45	0.05
546	300559	佳发教育	10,100	127,361.00	0.05
547	688576	西山科技	2,021	127,242.16	0.05
548	001213	中铁特货	31,400	127,170.00	0.05
549	301608	博实结	1,400	126,756.00	0.05
550	600113	浙江东日	2,000	126,340.00	0.05
551	688123	聚辰股份	1,000	125,580.00	0.05
551	601012	隆基绿能	6,900	125,580.00	0.05
552	603508	思维列控	4,500	125,190.00	0.05
553	300909	汇创达	2,600	125,060.00	0.05
554	600352	浙江龙盛	11,700	124,722.00	0.05
555	000631	顺发恒能	38,300	124,475.00	0.05
556	600089	特变电工	5,600	124,432.00	0.05
557	600997	开滦股份	21,600	124,200.00	0.05
558	688799	华纳药厂	2,600	124,020.00	0.05
559	600100	同方股份	13,900	123,988.00	0.05
560	002048	宁波华翔	3,900	122,694.00	0.05
561	600426	华鲁恒升	3,900	122,577.00	0.05
562	002043	兔宝宝	8,500	122,485.00	0.05
563	300373	扬杰科技	1,800	122,400.00	0.05
564	002299	圣农发展	7,400	122,396.00	0.05
565	600467	好当家	46,800	121,680.00	0.05
566	600925	苏能股份	26,800	121,672.00	0.05
567	002036	联创电子	11,000	121,220.00	0.05
568	688103	国力电子	2,000	121,180.00	0.05
569	603083	剑桥科技	900	120,942.00	0.05
570	688348	昱能科技	2,400	120,936.00	0.05
571	301087	可孚医疗	2,700	120,609.00	0.05
572	002375	亚厦股份	31,800	120,522.00	0.05
573	300047	天源迪科	9,600	120,480.00	0.05

574	000425	徐工机械	10,400	120,432.00	0.05
575	688005	容百科技	3,400	120,360.00	0.05
576	688168	安博通	1,600	120,256.00	0.05
577	300206	理邦仪器	9,400	120,226.00	0.05
578	600507	方大特钢	20,400	120,156.00	0.05
579	300346	南大光电	2,800	120,120.00	0.05
580	688636	智明达	2,800	119,952.00	0.05
581	002737	葵花药业	8,100	119,637.00	0.05
582	600339	中油工程	35,700	119,595.00	0.05
583	002556	辉隆股份	19,800	119,592.00	0.05
584	300358	楚天科技	12,200	119,438.00	0.05
585	301223	中荣股份	6,500	119,405.00	0.05
586	600588	用友网络	9,000	119,340.00	0.05
587	300357	我武生物	4,200	119,070.00	0.05
588	002281	光迅科技	1,700	118,915.00	0.05
589	605277	新亚电子	5,400	118,800.00	0.05
590	000707	双环科技	19,600	118,580.00	0.05
591	601928	凤凰传媒	11,800	118,472.00	0.04
592	002222	福晶科技	2,100	118,314.00	0.04
593	000570	苏常柴A	21,200	117,872.00	0.04
594	003013	地铁设计	8,300	117,611.00	0.04
595	000528	柳工	9,900	117,513.00	0.04
596	301606	绿联科技	2,000	117,480.00	0.04
597	688588	凌志软件	8,200	117,342.00	0.04
598	300487	蓝晓科技	1,900	117,325.00	0.04
599	300425	中建环能	23,700	117,315.00	0.04
600	002895	川恒股份	3,200	117,312.00	0.04
601	001337	四川黄金	4,200	117,012.00	0.04
602	688228	开普云	600	116,766.00	0.04
603	000657	中钨高新	4,200	116,382.00	0.04
604	002922	伊戈尔	3,800	116,356.00	0.04

605	603882	金域医学	4,100	116,276.00	0.04
606	605599	菜百股份	7,100	116,227.00	0.04
607	601368	绿城水务	23,400	116,064.00	0.04
608	603185	弘元绿能	3,800	115,900.00	0.04
609	688191	智洋创新	3,600	115,848.00	0.04
610	300850	新强联	2,800	115,836.00	0.04
611	601689	拓普集团	1,500	115,770.00	0.04
612	300475	香农芯创	800	115,472.00	0.04
613	000919	金陵药业	14,500	115,275.00	0.04
614	300454	深信服	1,000	115,160.00	0.04
615	603929	亚翔集成	1,200	114,600.00	0.04
616	600560	金自天正	6,900	112,746.00	0.04
617	300925	法本信息	5,300	112,572.00	0.04
618	002823	凯中精密	7,000	112,420.00	0.04
619	002926	华西证券	12,100	112,288.00	0.04
620	301320	豪江智能	6,600	112,002.00	0.04
621	600316	洪都航空	3,200	111,712.00	0.04
622	600391	航发科技	3,000	111,300.00	0.04
623	603233	大参林	6,300	111,006.00	0.04
624	601038	一拖股份	7,800	110,526.00	0.04
625	000822	山东海化	21,000	110,250.00	0.04
626	000733	振华科技	2,100	110,061.00	0.04
627	000534	万泽股份	5,000	110,000.00	0.04
628	603609	禾丰股份	15,500	109,895.00	0.04
629	001380	华纬科技	4,800	109,824.00	0.04
630	688383	新益昌	1,400	109,578.00	0.04
631	601137	博威合金	5,100	108,987.00	0.04
632	600378	昊华科技	3,400	108,664.00	0.04
633	301183	东田微	700	108,563.00	0.04
634	002244	滨江集团	10,800	108,540.00	0.04
635	000968	蓝焰控股	16,400	108,404.00	0.04

636	300318	博晖创新	17,200	107,844.00	0.04
637	301179	泽宇智能	6,800	107,508.00	0.04
638	300041	回天新材	9,700	107,476.00	0.04
639	300375	鹏翎股份	20,400	107,304.00	0.04
640	002940	昂利康	3,200	107,264.00	0.04
641	688290	景业智能	1,800	106,992.00	0.04
642	300719	安达维尔	5,900	106,849.00	0.04
643	600558	大西洋	17,500	106,750.00	0.04
644	603328	依顿电子	9,700	106,312.00	0.04
645	300989	蕾奥规划	6,000	105,900.00	0.04
646	000923	河钢资源	5,000	105,850.00	0.04
647	002540	亚太科技	14,900	105,492.00	0.04
648	000726	鲁泰A	14,800	105,376.00	0.04
649	000791	甘肃能源	16,300	105,135.00	0.04
650	001283	豪鹏科技	1,500	105,000.00	0.04
651	002598	山东章鼓	9,800	104,762.00	0.04
652	603012	创力集团	17,300	104,492.00	0.04
653	002843	泰嘉股份	5,200	104,208.00	0.04
654	603733	仙鹤股份	4,300	103,931.00	0.04
655	000612	焦作万方	9,400	103,588.00	0.04
656	301215	中汽股份	15,100	103,435.00	0.04
657	002841	视源股份	2,600	103,038.00	0.04
658	300620	光库科技	700	102,935.00	0.04
659	300145	南方泵业	21,700	102,424.00	0.04
660	603228	景旺电子	1,400	102,326.00	0.04
661	301596	瑞迪智驱	1,300	102,206.00	0.04
662	002902	铭普光磁	4,500	102,105.00	0.04
663	301060	兰卫医学	11,000	101,750.00	0.04
664	600738	丽尚国潮	19,700	101,652.00	0.04
665	300016	北陆药业	12,800	101,632.00	0.04
666	002430	杭氧股份	3,400	101,558.00	0.04

667	688088	虹软科技	2,048	101,376.00	0.04
668	688300	联瑞新材	1,632	101,330.88	0.04
669	603225	新凤鸣	5,200	101,192.00	0.04
670	300143	盈康生命	10,200	100,776.00	0.04
671	601456	国联民生	9,900	100,683.00	0.04
672	600380	健康元	8,700	100,485.00	0.04
673	300231	银信科技	9,500	100,035.00	0.04
674	000877	天山股份	18,800	100,016.00	0.04
675	002137	实益达	11,600	99,528.00	0.04
676	300986	志特新材	8,900	99,502.00	0.04
677	000751	锌业股份	24,300	99,387.00	0.04
678	000050	深天马 A	11,000	99,330.00	0.04
679	603277	银都股份	5,900	99,297.00	0.04
680	301330	熵基科技	3,000	99,150.00	0.04
681	300232	洲明科技	13,900	98,551.00	0.04
682	002216	三全食品	8,700	98,223.00	0.04
683	600196	复星医药	3,700	98,013.00	0.04
684	600020	中原高速	23,000	97,980.00	0.04
685	300404	博济医药	10,500	97,965.00	0.04
686	001389	广合科技	1,200	97,956.00	0.04
687	688090	瑞松科技	2,200	97,856.00	0.04
687	603489	八方股份	3,200	97,856.00	0.04
688	600512	腾达建设	40,400	97,768.00	0.04
689	300185	通裕重工	34,300	97,412.00	0.04
690	688068	热景生物	600	97,200.00	0.04
691	600862	中航高科	4,100	96,883.00	0.04
692	605020	永和股份	3,600	96,804.00	0.04
693	688795	摩尔线程	232	96,553.76	0.04
694	300154	瑞凌股份	9,800	96,530.00	0.04
695	000818	航锦科技	5,000	96,500.00	0.04
696	601665	齐鲁银行	16,800	96,432.00	0.04

697	688550	瑞联新材	2,124	96,238.44	0.04
698	300498	温氏股份	5,700	96,216.00	0.04
699	002290	禾盛新材	2,100	95,970.00	0.04
700	000957	中通客车	8,400	95,928.00	0.04
701	002379	宏桥控股	4,000	95,680.00	0.04
702	600129	太极集团	5,300	95,665.00	0.04
703	300288	朗玛信息	7,100	95,566.00	0.04
704	300448	浩云科技	12,200	95,526.00	0.04
705	300979	华利集团	1,900	95,399.00	0.04
706	300760	迈瑞医疗	500	95,225.00	0.04
707	688239	航宇科技	1,400	94,738.00	0.04
708	002850	科达利	600	94,716.00	0.04
709	600496	精工钢构	22,800	94,620.00	0.04
710	002080	中材科技	2,600	94,484.00	0.04
711	688116	天奈科技	2,000	94,300.00	0.04
712	002174	游族网络	7,700	94,248.00	0.04
713	002935	天奥电子	4,200	93,870.00	0.04
714	603939	益丰药房	4,300	93,396.00	0.04
715	600320	振华重工	18,100	93,215.00	0.04
716	300275	梅安森	7,000	93,170.00	0.04
717	002443	金洲管道	11,400	93,024.00	0.04
718	603948	建业股份	3,400	92,820.00	0.04
719	601519	大智慧	7,200	92,664.00	0.04
720	002006	精工科技	4,000	92,640.00	0.04
721	000029	深深房 A	4,200	92,484.00	0.04
722	002063	远光软件	15,200	92,264.00	0.04
723	600853	龙建股份	21,300	92,229.00	0.04
724	600166	福田汽车	31,500	91,980.00	0.03
725	301238	瑞泰新材	4,500	91,800.00	0.03
726	003028	振邦智能	3,100	91,729.00	0.03
727	603788	宁波高发	5,600	91,504.00	0.03

728	688779	五矿新能	12,200	91,378.00	0.03
729	301499	维科精密	3,100	91,233.00	0.03
730	002489	浙江永强	23,800	91,154.00	0.03
731	603014	威高血净	2,300	91,149.00	0.03
732	688615	合合信息	400	91,032.00	0.03
733	002373	千方科技	7,700	90,629.00	0.03
734	601117	中国化学	12,000	90,360.00	0.03
735	002441	众业达	9,600	90,240.00	0.03
736	688120	华海清科	600	90,048.00	0.03
737	002852	道道全	8,500	89,675.00	0.03
738	603606	东方电缆	1,500	89,625.00	0.03
739	301316	慧博云通	2,000	89,360.00	0.03
740	000066	中国长城	6,200	89,342.00	0.03
741	605388	均瑶健康	12,000	89,280.00	0.03
742	688685	迈信林	1,600	88,768.00	0.03
743	603486	科沃斯	1,100	88,748.00	0.03
744	601500	通用股份	18,400	88,688.00	0.03
745	002349	精华制药	12,200	88,572.00	0.03
746	601717	中创智领	3,600	88,380.00	0.03
747	301337	亚华电子	3,200	88,032.00	0.03
748	605399	晨光新材	6,500	87,880.00	0.03
749	600585	海螺水泥	4,000	87,440.00	0.03
750	002993	奥海科技	2,000	87,420.00	0.03
751	688236	春立医疗	3,810	87,172.80	0.03
752	688708	佳驰科技	1,400	87,150.00	0.03
753	000900	现代投资	21,300	87,117.00	0.03
754	603112	华翔股份	5,000	86,850.00	0.03
755	300015	爱尔眼科	7,900	86,742.00	0.03
756	603719	良品铺子	7,400	86,654.00	0.03
757	300667	必创科技	4,900	86,632.00	0.03
758	600908	无锡银行	14,600	86,578.00	0.03

759	600798	宁波海运	24,500	86,240.00	0.03
759	002479	富春环保	17,600	86,240.00	0.03
760	601022	宁波远洋	9,400	86,198.00	0.03
761	601101	昊华能源	12,000	85,920.00	0.03
762	000531	穗恒运 A	13,400	85,894.00	0.03
763	002967	广电计量	3,900	85,839.00	0.03
764	600750	华润江中	3,700	85,729.00	0.03
765	600600	青岛啤酒	1,400	85,680.00	0.03
766	002746	仙坛股份	14,100	85,587.00	0.03
767	600961	株冶集团	5,300	85,330.00	0.03
768	601918	新集能源	12,900	85,269.00	0.03
769	601866	中远海发	33,800	85,176.00	0.03
770	002986	宇新股份	7,900	85,004.00	0.03
771	300982	苏文电能	4,200	84,798.00	0.03
772	300529	健帆生物	4,300	84,581.00	0.03
773	300267	尔康制药	24,800	84,568.00	0.03
774	300596	利安隆	2,000	84,420.00	0.03
775	601827	三峰环境	9,900	83,853.00	0.03
776	600054	黄山旅游	7,400	83,768.00	0.03
777	603713	密尔克卫	1,500	83,655.00	0.03
778	300148	天舟文化	18,900	82,971.00	0.03
779	300625	三雄极光	7,000	82,950.00	0.03
780	301296	新巨丰	9,700	82,644.00	0.03
781	688739	成大生物	3,200	82,432.00	0.03
782	301062	上海艾录	10,000	82,400.00	0.03
783	600332	白云山	3,200	82,368.00	0.03
784	300292	吴通控股	18,200	82,082.00	0.03
785	605218	伟时电子	4,400	81,180.00	0.03
786	600229	城市传媒	12,800	81,152.00	0.03
787	603392	万泰生物	1,800	80,892.00	0.03
788	688258	卓易信息	1,051	80,475.07	0.03

789	300866	安克创新	700	80,073.00	0.03
790	300039	上海凯宝	13,200	79,596.00	0.03
791	601128	常熟银行	11,300	79,552.00	0.03
792	600418	江淮汽车	1,600	79,200.00	0.03
792	300026	红日药业	22,500	79,200.00	0.03
793	301160	翔楼新材	1,100	79,079.00	0.03
794	300224	正海磁材	5,100	78,846.00	0.03
795	300919	中伟新材	1,700	78,761.00	0.03
796	688061	灿瑞科技	2,415	78,753.15	0.03
797	600298	安琪酵母	1,800	78,732.00	0.03
798	300359	全通教育	14,600	78,256.00	0.03
799	000881	中广核技	8,600	77,830.00	0.03
800	603288	海天味业	2,100	77,742.00	0.03
801	688238	和元生物	11,633	77,475.78	0.03
802	300138	晨光生物	6,200	76,942.00	0.03
803	300806	斯迪克	2,500	76,850.00	0.03
804	000630	铜陵有色	12,700	76,327.00	0.03
805	688766	普冉股份	600	76,326.00	0.03
806	002609	捷顺科技	8,200	76,178.00	0.03
807	300002	神州泰岳	6,600	76,032.00	0.03
808	603071	物产环能	5,700	75,354.00	0.03
809	688271	联影医疗	600	75,300.00	0.03
810	300488	恒锋工具	2,300	75,072.00	0.03
811	300017	网宿科技	7,300	74,825.00	0.03
812	600839	四川长虹	8,200	74,620.00	0.03
813	688375	国博电子	800	74,488.00	0.03
814	688686	奥普特	600	74,478.00	0.03
815	002179	中航光电	2,100	74,424.00	0.03
816	002345	潮宏基	5,900	73,750.00	0.03
817	600578	京能电力	14,400	73,440.00	0.03
818	002577	雷柏科技	4,100	73,021.00	0.03

819	300747	锐科激光	2,700	72,981.00	0.03
820	601006	大秦铁路	14,100	72,756.00	0.03
821	002631	德尔未来	12,100	72,358.00	0.03
822	600300	维维股份	20,500	71,955.00	0.03
823	001216	华瓷股份	4,200	71,862.00	0.03
824	603298	杭叉集团	2,700	71,739.00	0.03
825	603855	华荣股份	3,700	71,595.00	0.03
826	300057	万顺新材	12,500	71,125.00	0.03
827	601872	招商轮船	7,900	70,942.00	0.03
828	688371	菲沃泰	3,839	70,906.33	0.03
829	603970	中农立华	5,500	70,730.00	0.03
830	688063	派能科技	1,244	70,684.08	0.03
831	002056	横店东磁	3,600	70,200.00	0.03
832	688386	泛亚微透	800	70,080.00	0.03
833	688499	利元亨	1,200	69,264.00	0.03
834	301280	珠城科技	1,300	69,238.00	0.03
835	300691	联合光电	4,000	69,080.00	0.03
836	688802	沐曦股份	170	67,882.70	0.03
837	601901	方正证券	8,700	67,860.00	0.03
838	002273	水晶光电	2,700	67,824.00	0.03
839	600201	生物股份	4,500	67,815.00	0.03
840	688153	唯捷创芯	1,800	67,752.00	0.03
841	688035	德邦科技	1,400	67,550.00	0.03
842	301552	科力装备	1,800	67,482.00	0.03
843	002399	海普瑞	5,700	67,203.00	0.03
844	000963	华东医药	1,700	67,065.00	0.03
845	000825	太钢不锈	13,600	66,504.00	0.03
846	600885	宏发股份	2,180	66,272.00	0.03
847	002757	南兴股份	3,400	66,198.00	0.03
848	601311	骆驼股份	7,200	66,024.00	0.03
849	601878	浙商证券	6,100	65,941.00	0.03

850	688403	汇成股份	4,013	65,732.94	0.02
851	300926	博俊科技	2,000	65,560.00	0.02
852	600315	上海家化	2,900	65,308.00	0.02
853	300445	康斯特	2,500	65,150.00	0.02
854	605268	王力安防	6,100	65,087.00	0.02
855	300531	优博讯	3,600	64,944.00	0.02
856	688687	凯因科技	2,600	64,792.00	0.02
857	600198	大唐电信	6,700	64,655.00	0.02
858	600928	西安银行	17,400	64,380.00	0.02
859	300921	南凌科技	2,800	64,316.00	0.02
860	300079	数码视讯	11,800	63,602.00	0.02
861	603639	海利尔	5,000	63,500.00	0.02
862	300043	星辉娱乐	11,200	63,280.00	0.02
863	600563	法拉电子	600	62,970.00	0.02
864	603998	方盛制药	5,600	62,944.00	0.02
865	002103	广博股份	6,900	62,928.00	0.02
866	300075	数字政通	4,100	62,894.00	0.02
867	688248	南网科技	1,400	62,636.00	0.02
868	300101	振芯科技	2,200	62,546.00	0.02
869	000623	吉林敖东	3,200	62,496.00	0.02
870	300739	明阳电路	3,400	62,492.00	0.02
871	300894	火星人	5,300	62,487.00	0.02
872	002091	江苏国泰	6,900	62,307.00	0.02
873	002734	利民股份	3,900	62,166.00	0.02
874	601518	吉林高速	22,000	62,040.00	0.02
875	300420	五洋自控	15,400	61,446.00	0.02
876	600078	澄星股份	6,400	61,376.00	0.02
877	688361	中科飞测	400	61,196.00	0.02
878	300852	四会富仕	1,600	61,088.00	0.02
879	688160	步科股份	400	61,000.00	0.02
880	000709	河钢股份	26,400	60,984.00	0.02

881	600875	东方电气	2,500	60,700.00	0.02
882	300279	和晶科技	8,400	60,648.00	0.02
883	301176	逸豪新材	2,400	60,408.00	0.02
884	688507	索辰科技	600	60,174.00	0.02
885	300247	融捷健康	11,700	60,021.00	0.02
886	002279	久其软件	7,400	59,126.00	0.02
887	600312	平高电气	3,400	58,990.00	0.02
888	601607	上海医药	3,300	58,938.00	0.02
889	600866	星湖科技	8,400	58,380.00	0.02
890	601186	中国铁建	7,600	58,292.00	0.02
891	688552	航天南湖	1,600	58,112.00	0.02
892	601838	成都银行	3,600	58,032.00	0.02
893	600593	大连圣亚	1,400	57,988.00	0.02
894	000928	中钢国际	8,700	57,507.00	0.02
895	600007	中国国贸	2,900	57,478.00	0.02
896	002899	英派斯	2,100	57,477.00	0.02
897	300415	伊之密	2,200	57,332.00	0.02
898	000060	中金岭南	9,800	57,330.00	0.02
899	600710	苏美达	5,300	57,293.00	0.02
900	002612	朗姿股份	2,800	57,232.00	0.02
901	002014	永新股份	4,800	57,216.00	0.02
902	605118	力鼎光电	1,900	57,209.00	0.02
903	605099	共创草坪	1,600	57,104.00	0.02
904	600572	康恩贝	12,800	57,088.00	0.02
905	002705	新宝股份	4,000	57,040.00	0.02
906	000576	甘化科工	5,400	56,862.00	0.02
907	600737	中粮糖业	3,300	56,793.00	0.02
908	002779	中坚科技	500	56,780.00	0.02
909	601512	中新集团	6,300	56,700.00	0.02
910	300910	瑞丰新材	1,000	56,550.00	0.02
911	301209	联合化学	500	56,445.00	0.02

912	600745	闻泰科技	1,500	55,920.00	0.02
913	603129	春风动力	200	55,736.00	0.02
914	603173	福斯达	1,300	55,666.00	0.02
915	000899	赣能股份	5,600	55,440.00	0.02
916	603040	新坐标	600	55,194.00	0.02
917	003002	壶化股份	1,700	55,029.00	0.02
918	002668	TCL智家	5,300	55,014.00	0.02
919	688016	心脉医疗	600	54,996.00	0.02
920	688202	美迪西	974	54,933.60	0.02
921	001367	海森药业	2,500	54,875.00	0.02
922	300127	银河磁体	1,800	54,594.00	0.02
923	301017	漱玉平民	3,700	54,575.00	0.02
924	301035	润丰股份	800	54,408.00	0.02
925	301656	联合动力	2,117	53,898.82	0.02
926	688728	格科微	3,600	53,784.00	0.02
927	002946	新乳业	2,900	53,737.00	0.02
928	300860	锋尚文化	2,000	53,600.00	0.02
929	000863	三湘印象	8,600	53,578.00	0.02
930	605555	德昌股份	2,900	53,070.00	0.02
931	300818	耐普矿机	1,400	53,018.00	0.02
932	301110	青木科技	800	52,944.00	0.02
933	688433	华曙高科	800	52,936.00	0.02
934	002032	苏泊尔	1,200	52,896.00	0.02
935	688533	上声电子	1,800	52,632.00	0.02
936	688317	之江生物	2,600	52,442.00	0.02
937	688590	新致软件	2,800	52,248.00	0.02
938	300994	久祺股份	3,300	52,107.00	0.02
939	600335	国机汽车	8,000	52,080.00	0.02
940	605123	派克新材	500	51,950.00	0.02
941	002548	金新农	8,500	51,680.00	0.02
942	688093	世华科技	1,400	51,590.00	0.02

943	002296	辉煌科技	4,600	51,520.00	0.02
944	603276	恒兴新材	3,100	51,460.00	0.02
945	601528	瑞丰银行	9,000	51,300.00	0.02
946	002912	中新赛克	1,700	51,238.00	0.02
947	603901	永创智能	3,600	51,120.00	0.02
948	688306	均普智能	4,400	51,040.00	0.02
949	002237	恒邦股份	3,800	50,996.00	0.02
950	300084	海默科技	5,100	50,949.00	0.02
951	002535	林州重机	13,100	50,828.00	0.02
952	600971	恒源煤电	8,100	50,544.00	0.02
953	002334	英威腾	5,600	50,512.00	0.02
954	300320	海达股份	5,400	50,382.00	0.02
955	300811	铂科新材	700	49,917.00	0.02
956	002422	科伦药业	1,700	49,895.00	0.02
957	600758	辽宁能源	13,700	49,868.00	0.02
958	603195	公牛集团	1,220	49,812.60	0.02
959	601330	绿色动力	7,400	49,802.00	0.02
960	600577	精达股份	4,000	49,720.00	0.02
961	600377	宁沪高速	4,100	49,651.00	0.02
962	002090	金智科技	4,200	49,560.00	0.02
963	002987	京北方	2,300	49,519.00	0.02
964	688700	东威科技	1,400	49,392.00	0.02
965	600446	金证股份	3,100	49,352.00	0.02
966	301359	东南电子	2,580	49,329.60	0.02
967	600596	新安股份	4,300	49,321.00	0.02
968	002344	海宁皮城	10,400	49,296.00	0.02
969	603239	浙江仙通	2,400	49,224.00	0.02
970	601388	怡球资源	16,300	49,063.00	0.02
971	002368	太极股份	2,000	48,980.00	0.02
972	603015	弘讯科技	3,900	48,945.00	0.02
973	300304	云意电气	4,200	48,888.00	0.02

974	600114	东睦股份	1,600	48,880.00	0.02
975	600403	大有能源	7,000	48,860.00	0.02
976	000739	普洛药业	3,000	48,810.00	0.02
977	603861	白云电器	4,000	48,680.00	0.02
978	600602	云赛智联	2,600	48,594.00	0.02
979	002706	良信股份	4,500	48,510.00	0.02
980	600986	浙文互联	6,200	48,484.00	0.02
981	688626	翔宇医疗	800	48,400.00	0.02
982	603315	福鞍股份	3,100	48,143.00	0.02
983	688100	威胜信息	1,224	48,103.20	0.02
984	603915	国茂股份	2,600	47,866.00	0.02
985	301219	腾远钴业	700	47,796.00	0.02
986	301301	川宁生物	4,700	47,658.00	0.02
987	601577	长沙银行	4,900	47,530.00	0.02
988	300082	奥克股份	4,800	47,520.00	0.02
989	000970	中科三环	3,500	47,460.00	0.02
990	002326	永太科技	1,900	47,348.00	0.02
991	301210	金杨精密	1,300	47,320.00	0.02
992	600796	钱江生化	7,800	47,268.00	0.02
993	300496	中科创达	700	47,250.00	0.02
994	605378	野马电池	2,100	47,208.00	0.02
995	002202	金风科技	2,300	46,920.00	0.02
996	300131	英唐智控	3,200	46,912.00	0.02
997	688581	安杰思	800	46,904.00	0.02
998	000006	深振业 A	4,700	46,765.00	0.02
999	000532	华金资本	2,900	46,748.00	0.02
100 0	688819	天能股份	1,400	46,508.00	0.02
100 1	600939	重庆建工	14,600	46,282.00	0.02
100 2	605080	浙江自然	2,000	46,000.00	0.02

100 3	600521	华海药业	2,700	45,819.00	0.02
100 4	000925	众合科技	5,100	45,798.00	0.02
100 5	002434	万里扬	4,800	45,744.00	0.02
100 6	603936	博敏电子	3,600	45,720.00	0.02
100 7	002886	沃特股份	2,100	45,612.00	0.02
100 8	002286	保龄宝	5,100	45,594.00	0.02
100 9	603987	康德莱	5,300	45,580.00	0.02
101 0	600366	宁波韵升	3,300	45,507.00	0.02
101 1	600063	皖维高新	7,700	45,353.00	0.02
101 2	688097	博众精工	1,200	45,300.00	0.02
101 2	600522	中天科技	2,500	45,300.00	0.02
101 3	603111	康尼机电	6,600	45,210.00	0.02
101 4	600618	氯碱化工	3,800	45,144.00	0.02
101 5	002270	华明装备	1,800	45,072.00	0.02
101 6	000682	东方电子	3,800	45,068.00	0.02
101 7	300443	金雷股份	1,600	45,008.00	0.02
101 8	300689	澄天伟业	1,000	44,950.00	0.02
101 9	600673	东阳光	2,000	44,860.00	0.02

102 0	600846	同济科技	3,400	44,710.00	0.02
102 1	002896	中大力德	500	44,680.00	0.02
102 2	688161	威高骨科	1,600	44,672.00	0.02
102 3	603871	嘉友国际	3,200	44,640.00	0.02
102 4	002409	雅克科技	600	44,460.00	0.02
102 5	002335	科华数据	800	44,424.00	0.02
102 6	002506	协鑫集成	15,800	44,240.00	0.02
102 7	601156	东航物流	2,400	44,184.00	0.02
102 8	603105	芯能科技	4,800	44,112.00	0.02
102 9	600182	S佳通	2,900	43,993.00	0.02
103 0	301039	中集车辆	4,800	43,920.00	0.02
103 1	688758	赛分科技	2,473	43,846.29	0.02
103 2	000403	派林生物	3,200	43,808.00	0.02
103 3	601599	浙文影业	11,000	43,780.00	0.02
103 4	603683	晶华新材	1,700	43,486.00	0.02
103 5	000058	深赛格	4,600	43,240.00	0.02
103 6	688717	艾罗能源	700	43,120.00	0.02
103 7	300241	瑞丰光电	7,700	43,043.00	0.02

103 8	603165	荣晟环保	3,400	43,010.00	0.02
103 9	000795	英洛华	4,300	42,871.00	0.02
104 0	300314	戴维医疗	3,400	42,772.00	0.02
104 1	002554	惠博普	13,400	42,746.00	0.02
104 2	603600	永艺股份	3,600	42,732.00	0.02
104 3	000729	燕京啤酒	3,800	42,674.00	0.02
104 4	300548	长芯博创	300	42,600.00	0.02
104 5	001965	招商公路	4,200	42,336.00	0.02
104 6	300735	光弘科技	1,700	42,262.00	0.02
104 7	003015	日久光电	2,700	42,120.00	0.02
104 8	002745	木林森	4,400	42,108.00	0.02
104 9	688049	炬芯科技	800	42,080.00	0.02
105 0	601058	赛轮轮胎	2,600	42,068.00	0.02
105 1	000800	一汽解放	6,200	42,036.00	0.02
105 2	000686	东北证券	4,500	41,940.00	0.02
105 3	002110	三钢闽光	9,500	41,705.00	0.02
105 4	601616	广电电气	10,800	41,688.00	0.02
105 5	300942	易瑞生物	4,400	41,404.00	0.02

105 6	688621	阳光诺和	665	41,329.75	0.02
105 7	688653	康希通信	3,400	41,310.00	0.02
105 8	688759	必贝特	1,637	41,105.07	0.02
105 9	002847	盐津铺子	600	40,986.00	0.02
106 0	688388	嘉元科技	1,000	40,980.00	0.02
106 1	688579	地纬智能	3,800	40,964.00	0.02
106 2	000550	江铃汽车	2,200	40,920.00	0.02
106 3	000636	风华高科	2,500	40,700.00	0.02
106 4	605128	上海沿浦	1,100	40,546.00	0.02
106 5	600269	赣粤高速	7,800	40,482.00	0.02
106 6	300382	斯莱克	2,600	40,456.00	0.02
106 7	603520	司太立	4,300	40,420.00	0.02
106 8	300174	元力股份	2,600	40,300.00	0.02
106 9	603038	华立股份	2,500	40,250.00	0.02
107 0	002215	诺普信	3,800	40,242.00	0.02
107 1	300434	金石亚药	3,900	40,092.00	0.02
107 2	688105	诺唯赞	2,000	40,040.00	0.02
107 3	688522	纳睿雷达	1,000	39,930.00	0.02

107 4	688209	英集芯	2,000	39,880.00	0.02
107 5	603878	武进不锈	4,300	39,818.00	0.02
107 6	600962	国投中鲁	1,800	39,474.00	0.01
107 7	300779	惠城环保	300	39,033.00	0.01
107 8	300790	宇瞳光学	1,300	38,883.00	0.01
107 9	301295	美硕科技	1,300	38,740.00	0.01
108 0	688013	天臣医疗	800	38,464.00	0.01
108 1	688178	万德斯	1,600	38,448.00	0.01
108 2	300724	捷佳伟创	400	38,240.00	0.01
108 3	300440	运达科技	3,100	38,161.00	0.01
108 4	600820	隧道股份	5,800	37,642.00	0.01
108 5	300134	大富科技	3,000	37,500.00	0.01
108 6	601198	东兴证券	2,700	37,476.00	0.01
108 7	600037	歌华有线	5,100	37,230.00	0.01
108 8	002539	云图控股	3,100	36,642.00	0.01
108 9	000898	鞍钢股份	14,400	36,432.00	0.01
109 0	002030	达安基因	6,100	36,356.00	0.01
109 1	000157	中联重科	4,200	36,246.00	0.01

109 2	002267	陕天然气	4,800	36,144.00	0.01
109 3	688179	阿拉丁	2,892	36,121.08	0.01
109 4	603025	大豪科技	2,000	35,920.00	0.01
109 5	002599	盛通股份	4,200	35,868.00	0.01
109 6	300451	创业慧康	7,400	35,816.00	0.01
109 7	688313	仕佳光子	400	35,512.00	0.01
109 8	603360	百傲化学	1,100	35,442.00	0.01
109 9	002938	鹏鼎控股	700	35,406.00	0.01
110 0	002461	珠江啤酒	3,800	35,302.00	0.01
110 1	301458	钧崴电子	1,100	35,299.00	0.01
110 2	000965	天保基建	8,900	34,888.00	0.01
110 3	300570	太辰光	300	34,665.00	0.01
110 4	688126	沪硅产业	1,600	34,624.00	0.01
110 5	603619	中曼石油	1,500	34,575.00	0.01
110 6	000937	冀中能源	6,400	34,432.00	0.01
110 7	688018	乐鑫科技	200	34,000.00	0.01
110 8	300406	九强生物	2,600	33,982.00	0.01
110 9	301286	侨源股份	800	33,832.00	0.01

111 0	601098	中南传媒	3,000	33,780.00	0.01
111 1	001269	欧晶科技	1,400	33,712.00	0.01
111 2	300510	金冠股份	8,100	33,453.00	0.01
111 3	603565	中谷物流	3,200	32,128.00	0.01
111 4	600693	东百集团	1,800	32,076.00	0.01
111 5	600731	湖南海利	4,700	31,819.00	0.01
111 6	600535	天士力	2,100	31,647.00	0.01
111 7	002615	哈尔斯	4,100	31,447.00	0.01
111 8	002284	亚太股份	2,100	31,353.00	0.01
111 9	300825	阿尔特	3,200	30,976.00	0.01
112 0	688690	纳微科技	1,200	30,972.00	0.01
112 1	002468	申通快递	2,300	30,866.00	0.01
112 2	688656	浩欧博	200	30,760.00	0.01
112 3	688299	长阳科技	1,800	30,456.00	0.01
112 4	300083	创世纪	3,300	30,393.00	0.01
112 5	300663	科蓝软件	1,700	29,988.00	0.01
112 6	688472	阿特斯	2,000	29,820.00	0.01
112 7	300492	华图山鼎	400	29,720.00	0.01

112 8	600023	浙能电力	6,000	29,700.00	0.01
112 9	688556	高测股份	2,600	29,692.00	0.01
113 0	002627	三峡旅游	3,900	28,938.00	0.01
113 1	600517	国网英大	4,800	28,848.00	0.01
113 2	603050	科林电气	1,600	28,832.00	0.01
113 3	002164	宁波东力	1,800	28,818.00	0.01
113 4	300772	运达股份	1,500	28,590.00	0.01
113 5	300244	迪安诊断	1,800	28,530.00	0.01
113 6	000813	德展健康	7,400	28,416.00	0.01
113 7	300480	光力科技	1,700	28,407.00	0.01
113 8	600195	中牧股份	3,600	28,332.00	0.01
113 9	301090	华润材料	4,000	28,160.00	0.01
114 0	002206	海利得	4,800	28,080.00	0.01
114 1	003018	金富科技	1,600	27,872.00	0.01
114 2	002302	西部建设	4,500	27,540.00	0.01
114 3	601375	中原证券	6,400	27,520.00	0.01
114 4	300217	东方电热	5,300	27,454.00	0.01
114 5	688311	盟升电子	600	27,360.00	0.01

114 6	605319	无锡振华	1,300	27,352.00	0.01
114 7	300139	晓程科技	900	27,324.00	0.01
114 8	603926	铁流股份	1,600	27,312.00	0.01
114 9	601636	旗滨集团	4,600	27,278.00	0.01
115 0	002252	上海莱士	4,300	27,262.00	0.01
115 1	002955	鸿合科技	900	27,243.00	0.01
115 2	688188	柏楚电子	200	27,178.00	0.01
115 3	600570	恒生电子	900	27,135.00	0.01
115 4	002372	伟星新材	2,600	27,118.00	0.01
115 5	603712	七一二	1,300	27,001.00	0.01
115 6	600694	大商股份	1,500	26,895.00	0.01
115 7	688303	大全能源	1,000	26,820.00	0.01
115 8	300110	华仁药业	8,500	26,775.00	0.01
115 9	300911	亿田智能	800	26,640.00	0.01
116 0	002109	兴化股份	7,500	26,625.00	0.01
116 1	002386	天原股份	4,900	26,607.00	0.01
116 2	688599	天合光能	1,600	26,480.00	0.01
116 3	688582	芯动联科	400	26,444.00	0.01

116 4	300769	德方纳米	600	26,406.00	0.01
116 5	603599	广信股份	2,300	26,404.00	0.01
116 6	603260	合盛硅业	500	26,350.00	0.01
116 7	688148	芳源股份	3,000	26,310.00	0.01
116 8	600810	神马股份	2,900	26,071.00	0.01
116 9	002318	久立特材	900	26,055.00	0.01
117 0	300329	海伦钢琴	1,600	25,904.00	0.01
117 1	600323	瀚蓝环境	900	25,740.00	0.01
117 2	600379	宝光股份	2,200	25,652.00	0.01
117 3	688591	泰凌微	600	25,536.00	0.01
117 4	300931	通用电梯	2,300	25,461.00	0.01
117 5	300991	创益通	600	25,308.00	0.01
117 6	301216	万凯新材	1,500	25,290.00	0.01
117 7	600993	马应龙	900	25,200.00	0.01
117 8	300315	掌趣科技	5,100	25,194.00	0.01
117 9	002133	广宇集团	7,400	25,086.00	0.01
118 0	000601	韶能股份	5,300	24,910.00	0.01
118 1	300798	锦鸡股份	3,500	24,885.00	0.01

118 2	002890	弘宇股份	1,700	24,820.00	0.01
118 3	300426	华智数媒	3,200	24,704.00	0.01
118 4	688067	爱威科技	1,000	24,560.00	0.01
118 5	002970	锐明技术	500	24,250.00	0.01
118 6	003030	祖名股份	1,200	24,228.00	0.01
118 7	000513	丽珠集团	700	24,122.00	0.01
118 8	300590	移为通信	1,900	24,092.00	0.01
118 9	300653	正海生物	1,200	23,964.00	0.01
119 0	002732	燕塘乳业	1,400	23,828.00	0.01
119 1	603027	千禾味业	2,400	23,592.00	0.01
119 2	000498	山东路桥	3,900	23,517.00	0.01
119 3	688326	经纬恒润	200	23,500.00	0.01
119 4	688790	昂瑞微	200	23,438.00	0.01
119 5	300161	华中数控	800	23,232.00	0.01
119 6	688787	海天瑞声	200	23,198.00	0.01
119 7	002755	奥赛康	1,400	22,862.00	0.01
119 8	300845	捷安高科	2,000	22,540.00	0.01
119 9	300685	艾德生物	1,100	22,506.00	0.01

120 0	601916	浙商银行	7,300	22,192.00	0.01
120 1	688210	统联精密	400	22,128.00	0.01
120 2	688450	光格科技	800	22,064.00	0.01
120 3	600746	江苏索普	3,200	22,016.00	0.01
120 4	688589	力合微	960	21,840.00	0.01
120 5	002486	嘉麟杰	7,000	21,770.00	0.01
120 6	002989	中天精装	700	21,588.00	0.01
120 7	688347	华虹公司	200	21,574.00	0.01
120 8	603368	柳药集团	1,200	21,384.00	0.01
120 9	688329	艾隆科技	1,000	21,290.00	0.01
121 0	300310	宜通世纪	3,600	21,276.00	0.01
121 1	001872	招商港口	1,100	21,263.00	0.01
121 2	600601	方正科技	1,800	21,096.00	0.01
121 3	603081	大丰实业	1,500	21,045.00	0.01
121 4	002869	金溢科技	900	20,934.00	0.01
121 5	605577	龙版传媒	1,600	20,912.00	0.01
121 6	603833	欧派家居	400	20,836.00	0.01
121 7	301362	民爆光电	500	20,795.00	0.01

121 8	605089	味知香	800	20,368.00	0.01
121 9	000930	中粮科技	3,500	20,195.00	0.01
122 0	000920	沃顿科技	1,600	19,920.00	0.01
122 1	688612	威迈斯	600	19,782.00	0.01
122 2	605066	天正电气	2,700	19,710.00	0.01
122 3	600233	圆通速递	1,200	19,704.00	0.01
122 4	002557	洽洽食品	900	19,458.00	0.01
122 5	688577	浙海德曼	200	19,372.00	0.01
122 6	301318	维海德	700	19,348.00	0.01
122 7	688309	恒誉环保	800	19,304.00	0.01
122 8	688380	中微半导	600	19,290.00	0.01
122 9	600429	三元股份	3,700	19,166.00	0.01
123 0	301018	申菱环境	300	19,056.00	0.01
123 1	300614	百川畅银	1,500	19,020.00	0.01
123 2	603536	惠发食品	1,700	18,904.00	0.01
123 3	002446	盛路通信	1,800	18,882.00	0.01
123 4	300171	东富龙	1,200	18,840.00	0.01
123 5	300393	中来股份	2,800	18,760.00	0.01

123 6	002418	康盛股份	3,900	18,603.00	0.01
123 7	600586	金晶科技	3,300	18,579.00	0.01
123 8	002918	蒙娜丽莎	1,300	18,499.00	0.01
123 9	002258	利尔化学	1,400	18,270.00	0.01
124 0	688809	强一股份	89	18,094.59	0.01
124 1	002075	沙钢股份	3,100	17,825.00	0.01
124 2	001202	炬申股份	1,100	17,446.00	0.01
124 3	301282	金禄电子	600	17,436.00	0.01
124 4	301638	南网数字	1,218	17,307.78	0.01
124 5	600809	山西汾酒	100	17,170.00	0.01
124 6	688358	祥生医疗	567	17,066.70	0.01
124 7	603988	中电电机	700	17,010.00	0.01
124 8	603130	云中马	300	16,995.00	0.01
124 9	688807	优迅股份	124	16,809.44	0.01
125 0	600191	华资实业	1,300	16,705.00	0.01
125 1	600674	川投能源	1,200	16,680.00	0.01
125 2	688530	欧莱新材	1,000	16,440.00	0.01
125 3	002965	祥鑫科技	400	16,272.00	0.01

125 4	300711	广哈通信	700	16,254.00	0.01
125 5	300113	顺网科技	800	16,192.00	0.01
125 6	601096	宏盛华源	3,900	16,185.00	0.01
125 7	301196	唯科科技	200	16,114.00	0.01
125 8	002985	北摩高科	500	15,865.00	0.01
125 9	001386	马可波罗	853	15,806.09	0.01
126 0	000402	金融街	5,700	15,675.00	0.01
126 1	600729	重庆百货	600	15,600.00	0.01
126 2	002376	新北洋	2,000	15,440.00	0.01
126 3	000868	安凯客车	3,100	15,438.00	0.01
126 4	301212	联盛化学	500	14,980.00	0.01
126 5	301448	开创电气	300	14,952.00	0.01
126 6	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.01
126 7	688553	汇宇制药	800	14,232.00	0.01
126 8	300940	南极光	500	14,230.00	0.01
126 9	300896	爱美客	100	14,172.00	0.01
127 0	601609	金田股份	1,300	14,040.00	0.01
127 1	300922	天秦装备	600	13,722.00	0.01

127 2	688257	新锐股份	400	13,712.00	0.01
127 3	688631	莱斯信息	200	13,616.00	0.01
127 4	600373	中文传媒	1,400	13,076.00	0.00
127 5	688639	华恒生物	400	13,032.00	0.00
127 6	000927	中国铁物	4,900	12,789.00	0.00
127 7	688783	西安奕材	668	12,264.48	0.00
127 8	002204	大连重工	1,600	12,240.00	0.00
127 9	002304	洋河股份	200	12,148.00	0.00
128 0	600372	中航机载	900	12,078.00	0.00
128 1	301584	建发致新	447	11,988.54	0.00
128 2	601777	千里科技	1,100	11,693.00	0.00
128 3	605168	三人行	300	11,574.00	0.00
128 4	688796	百奥赛图	273	11,534.25	0.00
128 5	300687	赛意信息	500	11,485.00	0.00
128 6	300031	宝通科技	500	11,365.00	0.00
128 7	600782	新钢股份	2,900	11,252.00	0.00
128 8	300316	晶盛机电	300	11,025.00	0.00
128 9	002866	传艺科技	600	10,806.00	0.00

129 0	301687	新广益	195	10,606.05	0.00
129 1	600027	华电国际	2,100	10,416.00	0.00
129 2	301307	美利信	300	10,374.00	0.00
129 3	688080	映翰通	200	10,100.00	0.00
129 4	001233	海安集团	192	9,960.96	0.00
129 5	600009	上海机场	300	9,828.00	0.00
129 6	300717	华信新材	500	9,520.00	0.00
129 7	688658	悦康药业	400	9,044.00	0.00
129 8	600368	五洲交通	2,300	9,016.00	0.00
129 9	601677	明泰铝业	600	8,874.00	0.00
130 0	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
130 1	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
130 2	300458	全志科技	200	8,406.00	0.00
130 3	300761	立华股份	400	8,300.00	0.00
130 4	603175	超颖电子	169	8,206.64	0.00
130 5	001211	双枪科技	300	7,932.00	0.00
130 6	300068	南都电源	500	7,770.00	0.00
130 7	688479	友车科技	400	7,532.00	0.00

130 8	000404	长虹华意	1,100	7,447.00	0.00
130 9	301668	昊创瑞通	165	7,392.00	0.00
131 0	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
131 1	300841	康华生物	100	7,226.00	0.00
131 2	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
131 3	001369	双欣环保	485	6,251.65	0.00
131 4	301575	艾芬达	126	6,243.30	0.00
131 5	688345	博力威	200	6,240.00	0.00
131 6	603685	晨丰科技	300	5,847.00	0.00
131 7	603418	友升股份	86	5,079.16	0.00
131 8	688765	禾元生物	94	4,946.28	0.00
131 9	603092	德力佳	84	4,675.44	0.00
132 0	001285	瑞立科密	80	4,486.40	0.00
132 1	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
132 2	603370	华新精科	82	3,800.70	0.00
132 3	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
132 4	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
132 5	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	12,131,705.00	4.61
2	300750	宁德时代	8,505,641.20	3.23
3	601318	中国平安	7,433,231.00	2.82
4	600036	招商银行	5,724,239.00	2.17
5	601899	紫金矿业	5,360,232.00	2.04
6	000333	美的集团	4,800,233.10	1.82
7	601166	兴业银行	4,792,620.00	1.82
8	600030	中信证券	4,405,051.00	1.67
9	600900	长江电力	4,336,769.00	1.65
10	601398	工商银行	4,139,927.00	1.57
11	002594	比亚迪	4,134,520.00	1.57
12	603259	药明康德	4,130,015.00	1.57
13	000725	京东方 A	3,856,204.00	1.46
14	601288	农业银行	3,643,849.00	1.38
15	300274	阳光电源	3,523,815.60	1.34
16	600887	伊利股份	3,467,911.00	1.32
17	300308	中际旭创	3,419,082.00	1.30
18	300502	新易盛	3,373,686.00	1.28
19	000651	格力电器	3,330,439.81	1.26
20	601138	工业富联	3,271,908.00	1.24

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

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

1	600519	贵州茅台	8,067,968.00	3.06
2	300750	宁德时代	6,252,606.37	2.37
3	601318	中国平安	4,081,912.00	1.55
4	601899	紫金矿业	3,929,695.01	1.49
5	600036	招商银行	3,643,850.00	1.38
6	601138	工业富联	3,597,321.00	1.37
7	300308	中际旭创	3,383,447.00	1.28
8	002594	比亚迪	3,336,676.00	1.27
9	300476	胜宏科技	3,248,496.00	1.23
10	300502	新易盛	3,246,327.00	1.23
11	600900	长江电力	3,238,677.00	1.23
12	603259	药明康德	3,217,846.00	1.22
13	603993	洛阳钼业	3,095,179.00	1.18
14	000333	美的集团	3,068,366.00	1.16
15	002475	立讯精密	2,816,161.00	1.07
16	300274	阳光电源	2,804,399.00	1.06
17	601398	工商银行	2,778,360.00	1.05
18	601288	农业银行	2,763,862.00	1.05
19	601166	兴业银行	2,717,449.00	1.03
20	002714	牧原股份	2,664,054.00	1.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,307,671,528.47
卖出股票收入（成交）总额	1,122,394,403.25

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"卖出股票收入"）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	87,017.77	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	87,017.77	0.03

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	111024	澳弘转债	270	27,002.49	0.01
2	113699	金25转债	100	17,445.13	0.01
3	118058	微导转债	40	13,075.80	0.00
4	113695	华辰转债	80	12,832.44	0.00
5	118057	甬矽转债	50	8,082.14	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除招商银行（证券代码：600036）、兴业银行（证券代码：601166）、中信证券（证券代码：600030）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2025年09月12日，招商银行（证券代码：600036）发行人招商银行股份有限公司因数据安全管理工作不到位被国家金融监督管理总局警告并罚款60万元。

2025年12月05日，兴业银行（证券代码：601166）发行人兴业银行股份有限公司因外包机构管理不到位、企业划型不准确被国家金融监督管理总局罚款720万元。

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在上海证券交易所相关上市公司再融资项目申请过程中出具的核查意见与实际情况不符被上海证券交易所予以监管警示。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,962,349.57

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,962,349.57

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113695	华辰转债	12,832.44	0.00
2	127109	电化转债	1,179.48	0.00
3	123257	安克转债	954.40	0.00

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
泓德 智选 启诚 混合A	2,118	66,648.20	2,037,065.37	1.44%	139,123,831.27	98.56%

泓德智选启诚混合C	1,073	54,258.59	0.00	0.00%	58,219,466.64	100.00%
合计	3,143	63,436.32	2,037,065.37	1.02%	197,343,297.91	98.98%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	泓德智选启诚混合A	0
	泓德智选启诚混合C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	泓德智选启诚混合A	0
	泓德智选启诚混合C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德智选启诚混合A	泓德智选启诚混合C
基金合同生效日(2025年03月18日)基金份额总额	192,599,289.14	100,084,910.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	425,815,563.14	157,475,766.47

减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	477,253,955.64	199,341,210.81
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	141,160,896.64	58,219,466.64

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动

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），童良发退休离任公司副总经理兼首席信息官。

2025年7月12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》，李娇担任公司督察长，不再担任公司副总经理；李晓春退休离任公司督察长。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金托管人于2025年12月30日发布公告，景佳自2025年12月22日起担任国信证券股份有限公司资产托管部临时负责人。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为40,000.00元。目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为1年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人高级管理人员及其他从业人员受调查或处罚的情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券	3	969,223,488.25	39.91%	422,484.40	45.41%	-
方正证券	2	945,772,083.93	38.94%	412,281.28	44.32%	-
第一创业证券	3	513,756,870.90	21.15%	95,558.48	10.27%	-

注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择国信证券、方正证券、第一创业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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国信证券	5,299.36	36.14%	-	-	-	-	-	-
方正证券	2,649.68	18.07%	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	6,716.04	45.80%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德智选启诚混合型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-02-21
2	泓德智选启诚混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-03-19
3	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启诚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、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-04-11
4	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、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-06-27

5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-09
6	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启诚混合型证券投资基金增加湘财证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-07-30
7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国泰海通证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-08-28
8	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-09-17
9	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-09-18
10	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-17
11	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-21
12	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-22
13	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-23
14	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-29

	内承销证券的公告		
15	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-10-30
16	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中国邮政储蓄银行股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-12
17	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-19
18	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-11-19
19	泓德基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	公司官网、中国证券报、中国证监会基金电子披露网站	2025-12-17

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准泓德智选启诚混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德智选启诚混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德智选启诚混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德智选启诚混合型证券投资基金托管协议》；

- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

13.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司
二〇二六年三月二十八日