

泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	78
§9 开放式基金份额变动	78
§10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议	78
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
10.4 基金投资策略的改变	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	79
10.8 其他重大事件	82
§11 影响投资者决策的其他重要信息	83
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓信混合
基金主代码	002801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月01日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	242,720,079.44份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

	于债券型基金、货币市场基金。
--	----------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	郭明
	联系电话	010-59850177	010-66105799
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-100-888	95588
传真		010-59850195	010-66105798
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区复兴门内大街5号
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区复兴门内大街5号
邮政编码		100088	100140
法定代表人		王德晓	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)
本期已实现收益	-22,469,312.74
本期利润	-38,878,482.18
加权平均基金份额本期利润	-0.1266
本期加权平均净值利润率	-9.88%
本期基金份额净值增长率	-9.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)
期末可供分配利润	57,810,144.28
期末可供分配基金份额利润	0.2382
期末基金资产净值	300,530,223.72
期末基金份额净值	1.2382
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)
基金份额累计净值增长率	54.10%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-5.29%	0.98%	-6.15%	0.86%	0.86%	0.12%
过去三个月	-4.01%	1.10%	-5.73%	1.03%	1.72%	0.07%

过去六个月	-9.12%	1.45%	-7.75%	1.44%	-1.37%	0.01%
过去一年	-11.96%	1.15%	-12.00%	1.05%	0.04%	0.10%
过去三年	-35.87%	1.17%	-20.48%	0.76%	-15.39%	0.41%
自基金合同生效起至今	54.10%	1.13%	14.71%	0.66%	39.39%	0.47%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

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

基准指数的构建原则如下：

（1）中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体状况。

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

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

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

泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年06月01日-2024年06月30日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金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。

泓德基金自成立以来，始终以“客户利益最大化”为己任，聚焦主动投资管理。公司建立了科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳健的运营保障体系，专业高效的市场服务体系，中长期的激励约束机制，致力于成为能持续为客户创造价值的、受人尊重的专业化资产管理公司。泓德基金坚持长期价值投资理念，以更好地保障客户利益为出发点，强调投资长周期性，同时在产品设计以及产品销售环节配合投资理念的落地执行。

公司已覆盖从公募到专户、从股票投资到固定收益投资、从低风险到高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等基金品种。

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	证券	说明
----	----	--------	----	----

		基金经理（助理） 期限		从业 年限	
		任职 日期	离任 日期		
李子昂	本基金的基金经理	2023- 10-26	-	10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 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，宏观经济总体平稳，但外部环境复杂多变，有效内需依然不足，经济面临新旧动能切换的阵痛。资本市场大幅波动，微盘小票下跌明显，只有红利资产一枝独秀。我们在年初遇到了一轮超额收益的回撤，而后随着市场逐渐稳定，叠加我们对深度学习模型做了优化和迭代，产品的Alpha也表现出了修复的态势。今年以来，我们发现传统的基本面模型表现出了更好的收益特性，基本面和量价的有机融合可能更好地适应当前复杂快变的市场环境，同时，因子有效性也受因子拥挤程度影响，大量资金的涌入也会加快量价因子的失效，这就需要我们不断更迭特征、优化模型，找到新的超额逻辑。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德泓信混合基金份额净值为1.2382元，本报告期内，基金份额净值增长率为-9.12%，同期业绩比较基准收益率为-7.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三中全会强调要坚定不移完成全年经济社会发展目标任务，这需要更有力的财政政策支持，短期专项债和3000亿特别国债将更好地推动设备更新和消费品的以旧换新，从而拉动经济增长；人民币汇率相对稳定是货币政策的大前提，随着下半年美联储可能进入降息周期，人民币汇率压力可能迎来边际下降，货币政策的空间也有望随之打开。国内经济依然要做好两大循环，对内扩大内需，提振消费，同时支持新兴产业和未来产业；对外，在推动国内企业“走出去”的同时，也要加速落实“引进来”的政策，当然，下半年的美国大选依旧扑朔迷离，中美贸易也仍有较大的不确定性，外循环的挑战倍增。当前位置，我们长期看好量化投资的价值，新技术的不断涌现也让行业焕发生机，我们也会不断学习，并努力迭代出更好的深度学习模型，力争为投资者创造价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

本基金截至2024年06月30日,期末可供分配利润为57,810,144.28元,其中:未分配利润已实现部分为86,535,281.91元,未分配利润未实现部分为-28,725,137.63元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2024年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	10,852,824.17	18,638,736.00
结算备付金		2,367,038.26	4,541,650.02
存出保证金		111,659.05	880,235.73
交易性金融资产	6.4.7.2	287,864,491.29	388,925,719.17
其中：股票投资		277,096,267.40	377,732,469.50
基金投资		-	-
债券投资		10,768,223.89	11,193,249.67
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	7,148,464.78
应收股利		-	-
应收申购款		30,225.27	1,811.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		301,226,238.04	420,136,616.90
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,152,371.87
应付赎回款		137,381.42	413.83
应付管理人报酬		214,897.82	272,925.72
应付托管费		40,293.33	51,173.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		2.19	3.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	303,439.56	626,488.26
负债合计		696,014.32	5,103,376.75
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	242,720,079.44	304,635,503.75
未分配利润	6.4.7.8	57,810,144.28	110,397,736.40
净资产合计		300,530,223.72	415,033,240.15
负债和净资产总计		301,226,238.04	420,136,616.90

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值1.2382元，基金份额总额242,720,079.44份。

6.2 利润表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		-36,911,903.88	-4,484,759.00
1.利息收入		80,281.34	9,484.14
其中：存款利息收入	6.4.7.9	80,281.34	9,484.14
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）		-21,420,889.25	-23,483,433.16
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-25,121,723.39	-24,891,204.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	176,377.21	136,758.41
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-381,897.52	-
股利收益	6.4.7.13	3,906,354.45	1,271,012.83
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-16,409,169.44	18,969,879.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	837,873.47	19,310.96
减：二、营业总支出		1,966,578.30	837,502.82
1.管理人报酬		1,560,961.02	617,426.60
2.托管费		292,680.14	115,767.52

3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		1.53	0.13
8.其他费用	6.4.7.16	112,935.61	104,308.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-38,878,482.18	-5,322,261.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-38,878,482.18	-5,322,261.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-38,878,482.18	-5,322,261.82

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15
二、本期期初净资产	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-61,915,424.31	-52,587,592.12	-114,503,016.43
（一）、综合收益	-	-38,878,482.18	-38,878,482.18

总额			
(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)	-61,915,424.31	-13,709,109.94	-75,624,534.25
其中: 1.基金申购款	168,476,164.06	51,652,380.55	220,128,544.61
2.基金赎回款	-230,391,588.37	-65,361,490.49	-295,753,078.86
(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	242,720,079.44	57,810,144.28	300,530,223.72
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	95,858,119.39	79,138,764.31	174,996,883.70
二、本期期初净资产	95,858,119.39	79,138,764.31	174,996,883.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-6,296,564.37	-11,936,888.25	-18,233,452.62
(一)、综合收益总额	-	-5,322,261.82	-5,322,261.82
(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)	-6,296,564.37	-6,614,626.43	-12,911,190.80

其中：1.基金申购款	7,485,072.91	5,492,123.79	12,977,196.70
2.基金赎回款	-13,781,637.28	-12,106,750.22	-25,888,387.50
（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	89,561,555.02	67,201,876.06	156,763,431.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

王德晓

李娇

王玲

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、公司债、次级债、可转换债券（含分离交

易可转换债券)、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、中期票据、债券回购和银行存款、同业存单等固定收益类投资工具,股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为:封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为0%-100%;转为开放式运作后股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%。本基金如果投资股指期货、国债期货,则在封闭期内,每个交易日日终扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持不低于交易保证金一倍的现金;转为开放式运作后,每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率 \times 90%+中国债券综合全价指数收益率 \times 10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年1月1日至2024年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款	10,852,824.17	
等于：本金	10,851,361.85	
加：应计利息	1,462.32	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	10,852,824.17	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	296,597,854.23	-	277,096,267.40	-19,501,586.83
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	507,400.00	639.90	623,706.08	115,666.18
	银行间市场	10,065,600.00	81,517.81	10,144,517.81	-2,600.00
	合计	10,573,000.00	82,157.71	10,768,223.89	113,066.18
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		307,170,854.23	82,157.71	287,864,491.29	-19,388,520.65

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	60.82
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	213,871.14
其中：交易所市场	213,696.14
银行间市场	175.00

应付利息	-
预提费用	89,507.60
合计	303,439.56

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,635,503.75	304,635,503.75
本期申购	168,476,164.06	168,476,164.06
本期赎回（以“-”号填列）	-230,391,588.37	-230,391,588.37
本期末	242,720,079.44	242,720,079.44

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	122,816,213.06	-12,418,476.66	110,397,736.40
本期期初	122,816,213.06	-12,418,476.66	110,397,736.40
本期利润	-22,469,312.74	-16,409,169.44	-38,878,482.18
本期基金份额交易产生的变动数	-13,811,618.41	102,508.47	-13,709,109.94
其中：基金申购款	61,918,957.44	-10,266,576.89	51,652,380.55
基金赎回款	-75,730,575.85	10,369,085.36	-65,361,490.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,535,281.91	-28,725,137.63	57,810,144.28

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日

活期存款利息收入	43,430.41
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	35,880.44
其他	970.49
合计	80,281.34

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	1,551,152,671.17
减：卖出股票成本总额	1,574,738,650.18
减：交易费用	1,535,744.38
买卖股票差价收入	-25,121,723.39

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	143,017.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	33,360.04
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	176,377.21

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,942,538.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,594,720.00
减：应计利息总额	314,258.03
减：交易费用	200.19
买卖债券差价收入	33,360.04

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未进行权证投资。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股指期货投资	-381,897.52

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,906,354.45
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	3,906,354.45

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日

1.交易性金融资产	-16,521,429.44
——股票投资	-16,517,875.19
——债券投资	-3,554.25
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	112,260.00
——权证投资	-
——期货投资	112,260.00
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	-16,409,169.44

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	837,748.73
基金转换费收入	124.74
合计	837,873.47

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。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	4,828.01
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	112,935.61

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,560,961.02	617,426.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,951.56	9,202.35
应支付基金管理人的净管理费	1,546,009.46	608,224.25

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	292,680.14	115,767.52

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至	上年度可比期间 2023年01月01日至
----	--------------------	-------------------------

	2024年06月30日	2023年06月30日
报告期初持有的基金份额	35,353,087.68	11,609,107.83
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	8,700,000.00	0.00
报告期末持有的基金份额	26,653,087.68	11,609,107.83
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	10.98%	12.96%

注：期间赎回/卖出总份额为基金转换（出）份额。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
泓德基业（西藏）企业管理有限公司	50,406,325.80	20.77%	30,809,733.01	10.11%
自然人股东	3,374,398.48	1.39%	3,359,385.72	1.10%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	10,852,824.17	43,430.41	10,521,683.80	5,310.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月以上	限售股	126.89	188.01	995	70,170.17	187,069.95	备注2（1）
603285	键邦股份	2024-06-28	5个交易日	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月以上	限售股	86.96	174.93	119	10,348.24	20,816.67	-
603350	安乃达	2024-06-26	5个交易日	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月以上	限售股	15.69	18.79	836	13,116.84	15,708.44	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月以上	限售股	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-

301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月以上	限售股	55.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	备注2(2)
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月以上	限售股	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月以上	限售股	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月以上	限售股	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月以上	限售股	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月以上	限售股	22.66	15.89	591	13,392.06	9,390.99	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月以上	限售股	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月以上	限售股	26.00	37.49	223	5,798.00	8,360.27	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月以上	限售股	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月以上	限售股	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月以上	限售股	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-

601033	永兴股份	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.20	15.96	479	7,759.80	7,644.84	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月以上	限售股	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月以上	限售股	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月以上	限售股	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月以上	限售股	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月以上	限售股	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月以上	限售股	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月以上	限售股	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	限售股	23.35	25.13	140	3,269.00	3,518.20	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月以上	限售股	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月以上	限售股	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-

001379	腾达科技	2024-01-11	6个月以上	限售股	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月以上	限售股	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月以上	限售股	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	备注2(3)
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	新股未上市且限售	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	新股未上市且限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113685	升24转债	2024-06-17	17个交易日	新债未上市	100.00	100.01	470	47,000.00	47,003.50	-

注：1、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。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；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、上述流通受限股票持有期间分红情况如下：

(1) 该股票于2024年5月30日实施权益分派方案：每10股派发现金股利97.00元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增8股。

(2) 该股票于2024年5月22日实施权益分派方案：每10股派发现金股利7.00元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增4股。

(3) 该股票于2024年6月3日实施权益分派方案：每10股派发现金股利3.50元（含税），同时，以资本公积向全体股东每10股转增3股。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2024年6月30日，本基金持有118,400股ST富通(股票代码“000836”)成本总额为人民币209,679.61元。根据相关公告，该股票自2024年6月18日起停牌，于2024年8月12日被终止上市。

基金管理人于2024年6月22日发布《泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告》，经与相关托管人协商一致，自2024年6月21日起，对“ST富通”(股票代码“000836”)按照0元进行估值，详见基金管理人在规定媒介披露的相关公告。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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占基金资产净值的比例为0.21%(上年度末：0.22%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于本报告期期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于本报告期期末，本基金持有流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	10,852,824.17	-	-	-	10,852,824.17
结算备付金	2,367,038.26	-	-	-	2,367,038.26
存出保证金	111,659.05	-	-	-	111,659.05
交易性金融资产	10,144,517.81	-	623,706.08	277,096,267.40	287,864,491.29
应收申购款	-	-	-	30,225.27	30,225.27
资产总计	23,476,039.29	-	623,706.08	277,126,492.67	301,226,238.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	137,381.42	137,381.42
应付管理人报酬	-	-	-	214,897.82	214,897.82
应付托管费	-	-	-	40,293.33	40,293.33
应交税费	-	-	-	2.19	2.19
其他负债	-	-	-	303,439.56	303,439.56
负债总计	-	-	-	696,014.32	696,014.32
利率敏感度缺口	23,476,039.29	-	623,706.08	276,430,478.35	300,530,223.72
上年度末 2023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	18,638,736.00	-	-	-	18,638,736.00
结算备付金	4,541,650.02	-	-	-	4,541,650.02
存出保证金	97,336.53	-	-	782,899.20	880,235.73
交易性金融资产	10,260,071.04	-	933,178.63	377,732,469.50	388,925,719.17
应收清算款	-	-	-	7,148,464.78	7,148,464.78

应收申购款	-	-	-	1,811.20	1,811.20
资产总计	33,537,793.59	-	933,178.63	385,665,644.68	420,136,616.90
负债					
应付清算款	-	-	-	4,152,371.87	4,152,371.87
应付赎回款	-	-	-	413.83	413.83
应付管理人报酬	-	-	-	272,925.72	272,925.72
应付托管费	-	-	-	51,173.60	51,173.60
应交税费	-	-	-	3.47	3.47
其他负债	-	-	-	626,488.26	626,488.26
负债总计	-	-	-	5,103,376.75	5,103,376.75
利率敏感度缺口	33,537,793.59	-	933,178.63	380,562,267.93	415,033,240.15

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期期末，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为3.58%(上年度末：2.70%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	277,096,267.40	92.20	377,732,469.50	91.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	277,096,267.40	92.20	377,732,469.50	91.01

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	13,523,576.24	31,150,837.08
	业绩比较基准下降5%	-13,523,576.24	-31,150,837.08

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	277,214,009.72	378,451,271.29
第二层次	10,237,132.42	10,260,071.04
第三层次	413,349.15	214,376.84
合计	287,864,491.29	388,925,719.17

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	277,096,267.40	91.99
	其中：股票	277,096,267.40	91.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,768,223.89	3.57
	其中：债券	10,768,223.89	3.57
	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	13,219,862.43	4.39
8	其他各项资产	141,884.32	0.05
9	合计	301,226,238.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,234,344.00	0.41
B	采矿业	13,984,437.80	4.65
C	制造业	176,299,161.78	58.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,008,826.00	2.33
E	建筑业	2,205,468.00	0.73
F	批发和零售业	10,105,751.54	3.36

G	交通运输、仓储和邮政业	6,630,707.00	2.21
H	住宿和餐饮业	59,280.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,273,923.40	5.75
J	金融业	25,687,107.84	8.55
K	房地产业	5,770,078.00	1.92
L	租赁和商务服务业	1,648,506.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	1,085,966.00	0.36
N	水利、环境和公共设施管理业	2,215,795.84	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	45,172.00	0.02
Q	卫生和社会工作	334,032.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	4,378,530.20	1.46
S	综合	1,129,180.00	0.38
	合计	277,096,267.40	92.20

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	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	600030	中信证券	91,700	1,671,691.00	0.56
2	601336	新华保险	54,000	1,621,620.00	0.54
3	601128	常熟银行	195,700	1,481,449.00	0.49
4	600941	中国移动	13,100	1,408,250.00	0.47
5	002106	莱宝高科	116,700	1,272,030.00	0.42
6	601319	中国人保	233,700	1,203,555.00	0.40
7	601318	中国平安	28,400	1,174,624.00	0.39
8	600918	中泰证券	206,200	1,169,154.00	0.39
9	600967	内蒙一机	162,300	1,168,560.00	0.39
10	000975	银泰黄金	67,300	1,096,317.00	0.36
11	000786	北新建材	36,700	1,088,522.00	0.36

12	603228	景旺电子	34,100	1,084,380.00	0.36
13	601995	中金公司	35,800	1,060,038.00	0.35
14	600547	山东黄金	38,200	1,045,916.00	0.35
15	603993	洛阳钼业	122,900	1,044,650.00	0.35
16	002128	电投能源	49,000	1,033,900.00	0.34
17	601919	中远海控	65,400	1,013,046.00	0.34
18	002237	恒邦股份	87,900	1,011,729.00	0.34
19	600988	赤峰黄金	60,200	983,668.00	0.33
20	002422	科伦药业	32,300	979,659.00	0.33
21	300059	东方财富	89,664	946,851.84	0.32
22	601058	赛轮轮胎	67,400	943,600.00	0.31
23	601825	沪农商行	139,000	934,080.00	0.31
24	600739	辽宁成大	110,600	925,722.00	0.31
25	600998	九州通	186,068	908,011.84	0.30
26	002532	天山铝业	110,500	896,155.00	0.30
27	601665	齐鲁银行	179,900	883,309.00	0.29
28	000725	京东方 A	214,800	878,532.00	0.29
29	000830	鲁西化工	75,100	870,409.00	0.29
30	603025	大豪科技	62,800	867,896.00	0.29
31	600050	中国联通	179,900	845,530.00	0.28
32	300390	天华新能	48,900	840,102.00	0.28
33	600219	南山铝业	219,200	835,152.00	0.28
34	601717	郑煤机	56,300	833,240.00	0.28
35	600114	东睦股份	57,800	831,742.00	0.28
36	001286	陕西能源	71,500	824,395.00	0.27
37	600066	宇通客车	31,900	823,020.00	0.27
38	600489	中金黄金	55,300	818,440.00	0.27
39	300679	电连技术	20,200	812,646.00	0.27
40	603897	长城科技	46,100	809,055.00	0.27
41	002384	东山精密	39,059	808,521.30	0.27
42	300708	聚灿光电	89,800	808,200.00	0.27

43	601601	中国太保	28,800	802,368.00	0.27
44	600095	湘财股份	133,200	793,872.00	0.26
45	000923	河钢资源	45,400	781,788.00	0.26
46	300783	三只松鼠	35,700	780,759.00	0.26
47	601500	通用股份	145,400	776,436.00	0.26
48	002463	沪电股份	21,100	770,150.00	0.26
49	300752	隆利科技	56,000	760,480.00	0.25
50	603267	鸿远电子	22,000	750,200.00	0.25
51	002558	巨人网络	78,600	741,984.00	0.25
52	601198	东兴证券	91,700	729,932.00	0.24
53	603529	爱玛科技	26,700	729,711.00	0.24
54	600598	北大荒	58,400	729,416.00	0.24
55	688111	金山办公	3,164	719,810.00	0.24
56	300628	亿联网络	19,500	717,015.00	0.24
57	002517	恺英网络	75,000	716,250.00	0.24
58	301165	锐捷网络	24,000	716,160.00	0.24
59	002053	云南能投	58,400	706,056.00	0.23
60	600909	华安证券	167,500	705,175.00	0.23
61	600707	彩虹股份	103,300	703,473.00	0.23
62	002001	新和成	36,600	702,720.00	0.23
63	002035	华帝股份	112,500	700,875.00	0.23
64	300251	光线传媒	82,600	694,666.00	0.23
65	002203	海亮股份	86,700	691,866.00	0.23
66	600399	抚顺特钢	121,500	684,045.00	0.23
67	601138	工业富联	24,900	682,260.00	0.23
68	601607	上海医药	35,100	670,761.00	0.22
69	600938	中国海油	20,300	669,900.00	0.22
70	300760	迈瑞医疗	2,300	669,093.00	0.22
71	600566	济川药业	21,100	669,081.00	0.22
72	600390	五矿资本	164,300	665,415.00	0.22
73	300529	健帆生物	24,100	655,761.00	0.22

74	600673	东阳光	92,900	654,016.00	0.22
75	601857	中国石油	62,800	648,096.00	0.22
76	601865	福莱特	32,200	647,220.00	0.22
77	002938	鹏鼎控股	16,200	644,112.00	0.21
78	003019	宸展光电	25,400	643,382.00	0.21
79	600282	南钢股份	126,200	628,476.00	0.21
80	000739	普洛药业	46,200	626,934.00	0.21
81	603299	苏盐井神	65,300	620,350.00	0.21
82	000738	航发控制	30,700	616,149.00	0.21
83	002636	金安国纪	96,800	614,680.00	0.20
84	300638	广和通	35,900	613,890.00	0.20
85	688208	道通科技	25,200	608,328.00	0.20
86	601633	长城汽车	23,900	604,670.00	0.20
87	002745	木林森	75,000	604,500.00	0.20
88	002318	久立特材	25,900	604,247.00	0.20
89	000338	潍柴动力	37,200	604,128.00	0.20
90	601328	交通银行	80,400	600,588.00	0.20
91	601958	金钼股份	57,600	599,616.00	0.20
92	600887	伊利股份	23,200	599,488.00	0.20
93	000877	天山股份	110,700	597,780.00	0.20
94	600350	山东高速	67,400	596,490.00	0.20
95	600183	生益科技	28,200	593,892.00	0.20
96	601788	光大证券	40,500	592,110.00	0.20
97	600132	重庆啤酒	9,700	588,790.00	0.20
98	688728	格科微	48,600	588,546.00	0.20
99	000166	申万宏源	135,800	585,298.00	0.19
100	300533	冰川网络	42,000	582,960.00	0.19
101	002008	大族激光	28,000	582,400.00	0.19
102	001914	招商积余	58,100	582,162.00	0.19
103	600968	海油发展	140,900	580,508.00	0.19
104	000959	首钢股份	210,800	573,376.00	0.19

105	600694	大商股份	34,030	572,044.30	0.19
106	603156	养元饮品	26,800	570,036.00	0.19
107	300502	新易盛	5,400	569,970.00	0.19
108	600348	华阳股份	57,000	567,720.00	0.19
109	600584	长电科技	17,800	564,438.00	0.19
110	600551	时代出版	79,640	563,851.20	0.19
111	001965	招商公路	47,400	562,164.00	0.19
112	000783	长江证券	114,800	554,484.00	0.18
113	600993	马应龙	20,700	552,069.00	0.18
114	002064	华峰化学	76,800	550,656.00	0.18
115	688169	石头科技	1,400	549,640.00	0.18
116	600285	羚锐制药	22,500	544,725.00	0.18
117	601139	深圳燃气	79,800	533,064.00	0.18
118	002273	水晶光电	31,100	528,078.00	0.18
119	600525	长园集团	123,300	525,258.00	0.17
120	002925	盈趣科技	41,400	524,538.00	0.17
121	603583	捷昌驱动	25,700	523,766.00	0.17
122	601009	南京银行	50,300	522,617.00	0.17
123	300857	协创数据	9,100	518,700.00	0.17
124	002984	森麒麟	21,400	515,526.00	0.17
125	601298	青岛港	53,800	514,328.00	0.17
126	300724	捷佳伟创	9,500	513,095.00	0.17
127	002475	立讯精密	13,000	511,030.00	0.17
128	603707	健友股份	43,000	510,840.00	0.17
129	601600	中国铝业	65,900	502,817.00	0.17
130	301206	三元生物	20,200	496,516.00	0.17
131	601609	金田股份	87,500	495,250.00	0.16
132	601666	平煤股份	44,200	495,040.00	0.16
133	603755	日辰股份	21,400	494,982.00	0.16
134	603766	隆鑫通用	72,200	489,516.00	0.16
135	600737	中粮糖业	50,700	486,213.00	0.16

136	300750	宁德时代	2,700	486,081.00	0.16
137	600782	新钢股份	146,100	485,052.00	0.16
138	000333	美的集团	7,500	483,750.00	0.16
139	688018	乐鑫科技	4,884	481,953.12	0.16
140	002491	通鼎互联	142,400	481,312.00	0.16
141	000630	铜陵有色	132,300	477,603.00	0.16
142	603355	莱克电气	22,000	475,200.00	0.16
143	000532	华金资本	39,400	475,164.00	0.16
144	601636	旗滨集团	73,400	473,430.00	0.16
145	300850	新强联	31,500	473,130.00	0.16
146	000036	华联控股	145,700	472,068.00	0.16
147	002867	周大生	36,100	471,466.00	0.16
148	002724	海洋王	105,900	471,255.00	0.16
149	601231	环旭电子	29,300	470,265.00	0.16
150	000423	东阿阿胶	7,500	469,500.00	0.16
151	601628	中国人寿	15,100	468,855.00	0.16
152	603160	汇顶科技	6,800	467,500.00	0.16
153	603501	韦尔股份	4,700	467,039.00	0.16
154	002032	苏泊尔	9,300	465,930.00	0.16
155	600315	上海家化	26,200	465,836.00	0.16
156	600511	国药股份	15,100	464,929.00	0.15
157	603031	安孚科技	20,525	463,454.50	0.15
158	601608	中信重工	121,100	461,391.00	0.15
159	601989	中国重工	92,600	456,518.00	0.15
160	000782	恒申新材	104,700	456,492.00	0.15
161	600161	天坛生物	18,660	455,304.00	0.15
162	600521	华海药业	26,700	455,235.00	0.15
163	002673	西部证券	73,300	453,727.00	0.15
164	002353	杰瑞股份	12,700	445,516.00	0.15
165	002678	珠江钢琴	123,000	445,260.00	0.15
166	601727	上海电气	119,700	442,890.00	0.15

167	002688	金河生物	121,900	442,497.00	0.15
168	000997	新大陆	31,800	442,338.00	0.15
169	600039	四川路桥	56,000	441,840.00	0.15
170	000509	华塑控股	171,600	441,012.00	0.15
171	600519	贵州茅台	300	440,217.00	0.15
172	601686	友发集团	87,500	440,125.00	0.15
173	002109	兴化股份	136,400	439,208.00	0.15
174	601728	中国电信	71,100	437,265.00	0.15
175	601766	中国中车	58,200	437,082.00	0.15
176	603112	华翔股份	41,500	436,165.00	0.15
177	000529	广弘控股	74,100	435,708.00	0.14
178	002214	大立科技	38,600	435,408.00	0.14
179	300771	智莱科技	49,400	434,226.00	0.14
180	300115	长盈精密	36,100	432,839.00	0.14
181	300212	易华录	25,700	432,531.00	0.14
182	688093	世华科技	23,800	432,446.00	0.14
183	000551	创元科技	49,500	432,135.00	0.14
184	300940	南极光	33,859	431,363.66	0.14
185	603956	威派格	81,200	431,172.00	0.14
186	300976	达瑞电子	9,400	430,990.00	0.14
187	000050	深天马 A	59,200	430,976.00	0.14
188	000933	神火股份	21,300	430,899.00	0.14
189	600997	开滦股份	62,800	430,808.00	0.14
190	601366	利群股份	95,700	430,650.00	0.14
191	002672	东江环保	120,400	427,420.00	0.14
192	002296	辉煌科技	41,300	425,803.00	0.14
193	000510	新金路	153,700	425,749.00	0.14
194	300267	尔康制药	204,600	425,568.00	0.14
195	600062	华润双鹤	21,700	424,886.00	0.14
196	002774	快意电梯	66,900	424,815.00	0.14
197	688008	澜起科技	7,400	422,984.00	0.14

198	301187	欧圣电气	17,400	421,950.00	0.14
199	603323	苏农银行	87,600	421,356.00	0.14
200	002873	新天药业	50,680	420,644.00	0.14
201	603995	甬金股份	24,000	420,480.00	0.14
202	002322	理工能科	26,200	419,724.00	0.14
203	002245	蔚蓝锂芯	54,000	418,500.00	0.14
204	002026	山东威达	50,400	418,320.00	0.14
205	603681	永冠新材	32,800	418,200.00	0.14
206	600488	津药药业	121,900	418,117.00	0.14
207	002139	拓邦股份	39,300	417,366.00	0.14
208	000517	荣安地产	155,700	417,276.00	0.14
209	600346	恒力石化	29,900	417,105.00	0.14
210	600660	福耀玻璃	8,700	416,730.00	0.14
211	001207	联科科技	28,700	416,724.00	0.14
212	000576	甘化科工	69,400	416,400.00	0.14
213	688510	航亚科技	22,600	416,066.00	0.14
214	002083	孚日股份	98,300	415,809.00	0.14
215	600983	惠而浦	55,800	415,710.00	0.14
216	600420	国药现代	38,900	415,452.00	0.14
217	002267	陕天然气	54,900	415,044.00	0.14
218	000758	中色股份	81,700	415,036.00	0.14
219	600019	宝钢股份	62,400	414,960.00	0.14
220	002282	博深股份	64,900	414,711.00	0.14
221	002662	京威股份	136,400	414,656.00	0.14
222	688155	先惠技术	10,472	414,062.88	0.14
223	605599	菜百股份	32,500	413,725.00	0.14
224	300705	九典制药	15,460	413,400.40	0.14
225	601126	四方股份	21,500	413,230.00	0.14
226	300307	慈星股份	69,400	412,930.00	0.14
227	600262	北方股份	25,100	412,393.00	0.14
228	002233	塔牌集团	56,400	412,284.00	0.14

229	300194	福安药业	110,200	412,148.00	0.14
230	600956	新天绿能	50,400	411,768.00	0.14
231	000990	诚志股份	55,300	411,432.00	0.14
232	605018	长华集团	45,400	411,324.00	0.14
233	603986	兆易创新	4,300	411,166.00	0.14
234	603605	珀莱雅	3,700	410,663.00	0.14
235	002835	同为股份	24,300	410,427.00	0.14
236	002020	京新药业	39,200	410,424.00	0.14
237	600351	亚宝药业	73,100	410,091.00	0.14
238	000761	本钢板材	163,300	409,883.00	0.14
239	000797	中国武夷	175,900	409,847.00	0.14
240	002319	乐通股份	47,400	408,588.00	0.14
241	603277	银都股份	13,600	408,544.00	0.14
242	601512	中新集团	53,600	408,432.00	0.14
243	002852	道道全	56,700	408,240.00	0.14
244	000897	津滨发展	198,900	407,745.00	0.14
245	600727	鲁北化工	64,700	407,610.00	0.14
246	603408	建霖家居	30,900	407,571.00	0.14
247	603385	惠达卫浴	74,200	407,358.00	0.14
247	300182	捷成股份	109,800	407,358.00	0.14
249	688766	普冉股份	4,191	407,239.47	0.14
250	600036	招商银行	11,900	406,861.00	0.14
251	688132	邦彦技术	23,429	406,493.15	0.14
252	300100	双林股份	37,700	406,029.00	0.14
253	601975	招商南油	113,000	405,670.00	0.13
254	603171	税友股份	15,000	405,600.00	0.13
255	603337	杰克股份	15,400	405,328.00	0.13
256	688578	艾力斯	6,355	405,067.70	0.13
257	688678	福立旺	37,400	405,042.00	0.13
258	002215	诺普信	54,300	404,535.00	0.13
259	601377	兴业证券	79,900	404,294.00	0.13

260	002140	东华科技	52,100	403,775.00	0.13
261	002365	永安药业	55,900	403,598.00	0.13
262	600866	星湖科技	73,100	403,512.00	0.13
263	002557	洽洽食品	14,300	403,117.00	0.13
264	003006	百亚股份	17,000	402,900.00	0.13
265	300002	神州泰岳	49,500	401,940.00	0.13
266	002845	同兴达	30,400	401,888.00	0.13
267	001338	永顺泰	41,000	401,800.00	0.13
268	002884	凌霄泵业	20,900	401,280.00	0.13
269	688767	博拓生物	16,000	401,120.00	0.13
270	600480	凌云股份	40,800	401,064.00	0.13
271	000596	古井贡酒	1,900	401,033.00	0.13
272	300170	汉得信息	65,300	400,942.00	0.13
273	603609	禾丰股份	61,300	400,902.00	0.13
274	002340	格林美	62,900	400,673.00	0.13
275	002594	比亚迪	1,600	400,400.00	0.13
276	601069	西部黄金	34,400	400,072.00	0.13
277	600096	云天化	20,600	400,052.00	0.13
278	000589	贵州轮胎	78,900	400,023.00	0.13
279	002997	瑞鹄模具	12,500	399,625.00	0.13
280	601808	中海油服	23,200	399,040.00	0.13
281	600916	中国黄金	41,400	398,268.00	0.13
282	000553	安道麦A	87,600	397,704.00	0.13
283	603929	亚翔集成	16,600	396,740.00	0.13
284	688253	英诺特	10,400	396,344.00	0.13
285	002970	锐明技术	11,000	396,330.00	0.13
286	601101	昊华能源	43,120	396,272.80	0.13
287	000651	格力电器	10,100	396,122.00	0.13
288	600507	方大特钢	105,800	395,692.00	0.13
289	688138	清溢光电	18,400	395,600.00	0.13
290	301219	腾远钴业	10,300	394,078.00	0.13

291	000538	云南白药	7,700	393,855.00	0.13
292	000042	中洲控股	99,600	393,420.00	0.13
293	600845	宝信软件	12,316	393,249.88	0.13
294	600475	华光环能	45,100	392,821.00	0.13
295	002507	涪陵榨菜	32,026	392,318.50	0.13
296	688188	柏楚电子	2,118	390,876.90	0.13
297	300841	康华生物	7,700	389,928.00	0.13
298	688123	聚辰股份	6,400	389,312.00	0.13
299	601162	天风证券	178,300	388,694.00	0.13
300	600037	歌华有线	64,800	387,504.00	0.13
301	300418	昆仑万维	12,000	386,880.00	0.13
302	600699	均胜电子	26,100	386,802.00	0.13
303	601001	晋控煤业	23,400	386,568.00	0.13
304	300492	华图山鼎	4,100	386,220.00	0.13
305	002266	浙富控股	137,700	384,183.00	0.13
306	300037	新宙邦	13,400	382,704.00	0.13
307	600038	中直股份	9,300	382,323.00	0.13
308	600269	赣粤高速	73,800	381,546.00	0.13
309	600201	生物股份	52,900	381,409.00	0.13
310	600266	城建发展	101,200	378,488.00	0.13
311	600755	厦门国贸	52,700	377,859.00	0.13
312	688006	杭可科技	21,600	376,920.00	0.13
313	002550	千红制药	69,700	375,683.00	0.13
314	601158	重庆水务	78,200	375,360.00	0.12
315	603056	德邦股份	28,600	374,660.00	0.12
316	002549	凯美特气	73,300	374,563.00	0.12
317	603507	振江股份	11,400	374,148.00	0.12
318	002212	天融信	76,500	372,555.00	0.12
319	603195	公牛集团	4,820	371,718.40	0.12
320	600642	申能股份	42,000	370,860.00	0.12
321	688016	心脉医疗	3,777	370,334.85	0.12

322	300547	川环科技	22,600	369,510.00	0.12
323	603899	晨光股份	11,800	369,104.00	0.12
324	002451	摩恩电气	68,700	368,919.00	0.12
325	600409	三友化工	73,000	366,460.00	0.12
326	300451	创业慧康	105,800	366,068.00	0.12
327	603806	福斯特	24,900	366,030.00	0.12
328	688234	天岳先进	7,800	365,976.00	0.12
329	600487	亨通光电	23,200	365,864.00	0.12
330	002138	顺络电子	13,200	362,472.00	0.12
331	000069	华侨城 A	176,600	360,264.00	0.12
332	601658	邮储银行	70,900	359,463.00	0.12
333	000519	中兵红箭	24,500	359,415.00	0.12
334	000858	五粮液	2,800	358,512.00	0.12
335	001331	胜通能源	25,800	357,330.00	0.12
336	002841	视源股份	12,100	357,313.00	0.12
337	688408	中信博	3,876	356,902.08	0.12
338	002567	唐人神	66,400	355,904.00	0.12
339	300369	绿盟科技	69,500	355,145.00	0.12
340	600676	交运股份	127,800	354,006.00	0.12
341	300001	特锐德	17,500	352,100.00	0.12
342	600576	祥源文旅	79,900	350,761.00	0.12
343	600308	华泰股份	110,200	346,028.00	0.12
344	002683	广东宏大	17,100	344,223.00	0.11
345	002843	泰嘉股份	22,400	342,944.00	0.11
346	002737	葵花药业	14,600	341,348.00	0.11
347	002028	思源电气	5,100	341,190.00	0.11
348	300323	华灿光电	78,400	341,040.00	0.11
349	300919	中伟股份	11,000	340,890.00	0.11
350	002585	双星新材	68,300	338,768.00	0.11
351	603233	大参林	23,600	337,480.00	0.11
352	603486	科沃斯	7,100	334,978.00	0.11

353	300767	震安科技	39,400	334,112.00	0.11
354	601098	中南传媒	26,800	332,856.00	0.11
355	002465	海格通信	32,000	331,520.00	0.11
356	600976	健民集团	6,500	328,250.00	0.11
357	600109	国金证券	43,300	326,915.00	0.11
358	300440	运达科技	62,200	326,550.00	0.11
359	300260	新莱应材	15,400	322,476.00	0.11
360	000825	太钢不锈	95,400	322,452.00	0.11
361	600483	福能股份	27,500	320,650.00	0.11
362	600617	国新能源	127,680	319,200.00	0.11
363	002706	良信股份	46,300	317,618.00	0.11
364	002302	西部建设	60,800	316,160.00	0.11
365	002876	三利谱	13,000	313,560.00	0.10
366	600415	小商品城	42,000	311,640.00	0.10
367	605007	五洲特纸	24,500	309,435.00	0.10
368	300136	信维通信	15,800	309,364.00	0.10
369	601061	中信金属	45,000	309,150.00	0.10
370	002541	鸿路钢构	18,200	308,854.00	0.10
371	300088	长信科技	65,700	308,790.00	0.10
372	600416	湘电股份	31,000	308,140.00	0.10
373	000930	中粮科技	61,200	307,836.00	0.10
374	000726	鲁泰A	46,300	306,506.00	0.10
375	002730	电光科技	43,500	306,240.00	0.10
376	601019	山东出版	25,900	306,138.00	0.10
377	600999	招商证券	22,000	306,020.00	0.10
378	600803	新奥股份	14,700	305,760.00	0.10
379	002120	韵达股份	39,500	305,730.00	0.10
380	000528	柳工	27,300	305,487.00	0.10
381	002588	史丹利	40,400	304,212.00	0.10
382	002274	华昌化工	40,900	303,478.00	0.10
383	301127	天源环保	25,500	301,410.00	0.10

384	688509	正元地信	104,200	301,138.00	0.10
385	603737	三棵树	8,300	301,041.00	0.10
386	002812	恩捷股份	9,500	300,675.00	0.10
387	605188	国光连锁	38,700	299,925.00	0.10
388	603577	汇金通	43,000	298,420.00	0.10
389	002727	一心堂	19,500	294,255.00	0.10
390	300388	节能国祯	53,100	294,174.00	0.10
391	603866	桃李面包	57,900	293,553.00	0.10
392	600885	宏发股份	10,600	293,408.00	0.10
393	601018	宁波港	86,000	292,400.00	0.10
394	000932	华菱钢铁	66,000	292,380.00	0.10
395	000823	超声电子	34,100	290,191.00	0.10
396	300662	科锐国际	17,900	288,727.00	0.10
397	000960	锡业股份	18,600	288,114.00	0.10
398	002096	易普力	24,100	286,790.00	0.10
399	000020	深华发A	28,900	286,110.00	0.10
400	600639	浦东金桥	28,000	285,880.00	0.10
401	600757	长江传媒	35,400	285,324.00	0.09
402	000902	新洋丰	24,000	284,880.00	0.09
403	600160	巨化股份	11,800	284,734.00	0.09
404	601211	国泰君安	20,900	283,195.00	0.09
405	688472	阿特斯	27,800	283,004.00	0.09
406	600018	上港集团	48,800	282,064.00	0.09
407	600332	白云山	9,600	281,568.00	0.09
408	605499	东鹏饮料	1,300	280,475.00	0.09
409	603688	石英股份	9,450	279,814.50	0.09
410	601077	渝农商行	55,700	279,614.00	0.09
411	300673	佩蒂股份	21,300	279,456.00	0.09
412	600456	宝钛股份	10,900	278,277.00	0.09
413	300996	普联软件	18,900	277,263.00	0.09
414	688588	凌志软件	40,242	275,657.70	0.09

415	600809	山西汾酒	1,300	274,144.00	0.09
416	603833	欧派家居	5,100	273,156.00	0.09
417	600888	新疆众和	38,600	272,902.00	0.09
418	002043	兔宝宝	26,200	271,694.00	0.09
419	600529	山东药玻	10,700	271,138.00	0.09
420	002935	天奥电子	22,260	268,900.80	0.09
421	300320	海达股份	32,800	267,648.00	0.09
422	002947	恒铭达	7,600	267,520.00	0.09
423	600058	五矿发展	40,400	266,640.00	0.09
424	603259	药明康德	6,800	266,492.00	0.09
425	002439	启明星辰	15,400	265,804.00	0.09
426	603008	喜临门	15,300	265,149.00	0.09
427	688425	铁建重工	72,000	264,960.00	0.09
428	003021	兆威机电	5,700	263,055.00	0.09
429	688076	诺泰生物	3,357	262,785.96	0.09
430	600126	杭钢股份	63,000	258,930.00	0.09
431	600271	航天信息	34,900	256,864.00	0.09
432	300308	中际旭创	1,860	256,456.80	0.09
433	600704	物产中大	58,900	255,626.00	0.09
434	002739	万达电影	21,100	255,099.00	0.08
435	688772	珠海冠宇	17,014	253,508.60	0.08
436	002225	濮耐股份	61,700	252,353.00	0.08
437	301338	凯格精机	7,800	250,614.00	0.08
438	002399	海普瑞	28,800	249,696.00	0.08
439	603185	弘元绿能	14,500	247,805.00	0.08
440	002152	广电运通	23,500	245,810.00	0.08
441	603933	睿能科技	19,000	244,340.00	0.08
442	603291	联合水务	19,800	242,748.00	0.08
443	002078	太阳纸业	17,300	241,335.00	0.08
444	300737	科顺股份	56,000	240,800.00	0.08
445	600316	洪都航空	14,400	239,472.00	0.08

446	601228	广州港	78,300	238,815.00	0.08
447	688297	中无人机	7,200	237,816.00	0.08
448	300595	欧普康视	15,100	236,768.00	0.08
449	002019	亿帆医药	19,100	236,076.00	0.08
450	603939	益丰药房	9,600	235,680.00	0.08
451	000066	中国长城	26,900	235,375.00	0.08
452	603703	盛洋科技	23,400	234,702.00	0.08
453	002182	宝武镁业	20,640	232,819.20	0.08
454	601108	财通证券	35,000	231,350.00	0.08
455	300253	卫宁健康	39,100	230,690.00	0.08
456	601339	百隆东方	44,100	229,761.00	0.08
457	000039	中集集团	24,800	229,648.00	0.08
458	600795	国电电力	38,300	229,417.00	0.08
459	600517	国网英大	52,900	229,057.00	0.08
460	688036	传音控股	2,987	228,624.98	0.08
461	000636	风华高科	17,500	228,550.00	0.08
462	605377	华旺科技	17,200	227,900.00	0.08
463	600436	片仔癀	1,100	227,887.00	0.08
464	300682	朗新集团	26,700	227,217.00	0.08
465	600312	平高电气	11,600	225,620.00	0.08
466	603166	福达股份	46,000	225,400.00	0.08
467	300227	光韵达	41,200	225,364.00	0.07
468	000096	广聚能源	23,600	224,200.00	0.07
469	600035	楚天高速	52,100	223,509.00	0.07
470	603936	博敏电子	26,600	223,440.00	0.07
471	002690	美亚光电	13,500	222,750.00	0.07
472	002391	长青股份	49,200	222,384.00	0.07
473	600872	中炬高新	9,800	222,362.00	0.07
474	600817	宇通重工	27,100	222,220.00	0.07
475	601616	广电电气	76,300	222,033.00	0.07
476	300439	美康生物	24,200	221,672.00	0.07

477	002616	长青集团	51,200	221,184.00	0.07
478	000059	华锦股份	52,700	220,813.00	0.07
479	600864	哈投股份	46,400	220,400.00	0.07
480	300016	北陆药业	49,900	220,059.00	0.07
481	002911	佛燃能源	24,000	219,360.00	0.07
482	600558	大西洋	60,800	218,880.00	0.07
483	603351	威尔药业	10,800	218,808.00	0.07
484	002275	桂林三金	17,600	218,416.00	0.07
485	002213	大为股份	22,400	218,400.00	0.07
486	000002	万科A	31,500	218,295.00	0.07
487	600386	北巴传媒	78,200	218,178.00	0.07
488	300774	倍杰特	33,400	218,102.00	0.07
489	605222	起帆电缆	14,200	217,828.00	0.07
490	000565	渝三峡A	53,900	217,217.00	0.07
491	600740	山西焦化	55,300	216,776.00	0.07
492	002381	双箭股份	32,300	216,733.00	0.07
493	002519	银河电子	44,100	216,531.00	0.07
494	603863	松炆资源	11,300	216,056.00	0.07
495	600604	市北高新	62,400	215,904.00	0.07
496	603999	读者传媒	45,600	215,688.00	0.07
497	300599	雄塑科技	43,300	215,201.00	0.07
498	002905	金逸影视	34,600	214,520.00	0.07
499	002054	德美化工	43,600	214,076.00	0.07
500	002946	新乳业	24,400	213,744.00	0.07
501	600735	新华锦	55,800	213,714.00	0.07
502	603727	博迈科	16,200	213,192.00	0.07
503	300871	回盛生物	22,300	212,742.00	0.07
504	600423	柳化股份	92,000	212,520.00	0.07
505	600406	国电南瑞	8,500	212,160.00	0.07
506	603558	健盛集团	21,300	211,935.00	0.07
507	603028	赛福天	37,600	211,688.00	0.07

508	688151	华强科技	17,000	211,650.00	0.07
509	600886	国投电力	11,600	211,584.00	0.07
510	600535	天士力	16,800	211,344.00	0.07
511	601117	中国化学	25,600	210,944.00	0.07
512	603858	步长制药	13,900	210,585.00	0.07
513	002082	万邦德	50,000	210,500.00	0.07
514	002793	罗欣药业	58,700	210,146.00	0.07
515	601330	绿色动力	36,100	210,102.00	0.07
516	002298	中电兴发	47,500	209,950.00	0.07
517	300433	蓝思科技	11,500	209,875.00	0.07
518	601669	中国电建	37,500	209,625.00	0.07
519	000955	欣龙控股	71,500	209,495.00	0.07
520	301321	翰博高新	18,200	209,482.00	0.07
521	300866	安克创新	2,940	209,357.40	0.07
522	300289	利德曼	54,300	209,055.00	0.07
523	002004	华邦健康	55,000	209,000.00	0.07
524	603819	神力股份	19,900	208,950.00	0.07
525	600939	重庆建工	90,000	208,800.00	0.07
526	600638	新黄浦	55,300	208,481.00	0.07
527	600925	苏能股份	41,200	208,060.00	0.07
528	601166	兴业银行	11,800	207,916.00	0.07
529	605299	舒华体育	25,600	207,872.00	0.07
530	002922	伊戈尔	9,500	207,670.00	0.07
531	002749	国光股份	13,800	207,552.00	0.07
532	002969	嘉美包装	72,800	207,480.00	0.07
533	002840	华统股份	12,500	207,375.00	0.07
534	002170	芭田股份	34,300	206,143.00	0.07
535	600829	人民同泰	36,700	205,887.00	0.07
536	300453	三鑫医疗	32,200	205,758.00	0.07
537	002773	康弘药业	9,500	205,675.00	0.07
538	600761	安徽合力	9,500	205,580.00	0.07

539	000790	华神科技	59,300	205,178.00	0.07
540	603368	柳药集团	11,700	204,750.00	0.07
541	600595	中孚实业	82,200	204,678.00	0.07
542	300409	道氏技术	23,900	204,584.00	0.07
543	300244	迪安诊断	17,000	204,000.00	0.07
544	002292	奥飞娱乐	34,100	203,918.00	0.07
545	600585	海螺水泥	8,600	202,874.00	0.07
546	300531	优博讯	19,400	202,148.00	0.07
547	600963	岳阳林纸	54,900	201,483.00	0.07
548	301391	卡莱特	4,600	201,388.00	0.07
549	600854	春兰股份	58,800	201,096.00	0.07
549	300181	佐力药业	13,300	201,096.00	0.07
551	000521	长虹美菱	26,500	200,870.00	0.07
552	000887	中鼎股份	16,400	200,736.00	0.07
553	600790	轻纺城	62,300	200,606.00	0.07
554	601598	中国外运	35,600	200,428.00	0.07
555	000999	华润三九	4,700	200,126.00	0.07
556	600718	东软集团	24,100	199,307.00	0.07
557	002048	宁波华翔	15,400	199,276.00	0.07
558	300858	科拓生物	13,500	198,720.00	0.07
559	600057	厦门象屿	29,200	198,560.00	0.07
560	002065	东华软件	43,800	197,976.00	0.07
561	600422	昆药集团	11,100	197,913.00	0.07
562	002787	华源控股	29,200	197,392.00	0.07
563	601916	浙商银行	71,500	197,340.00	0.07
564	000852	石化机械	36,800	197,248.00	0.07
565	600252	中恒集团	90,800	197,036.00	0.07
566	601688	华泰证券	15,900	197,001.00	0.07
567	300080	易成新能	68,400	196,992.00	0.07
568	002714	牧原股份	4,500	196,200.00	0.07
569	603305	旭升集团	18,500	195,360.00	0.07

570	002432	九安医疗	4,800	194,592.00	0.06
571	688223	晶科能源	27,400	194,540.00	0.06
572	603658	安图生物	4,200	193,494.00	0.06
573	688388	嘉元科技	19,800	193,050.00	0.06
574	600877	电科芯片	18,000	192,960.00	0.06
575	600295	鄂尔多斯	19,400	192,448.00	0.06
576	603556	海兴电力	4,100	192,003.00	0.06
577	600486	扬农化工	3,400	191,930.00	0.06
578	300426	唐德影视	28,300	191,874.00	0.06
579	600741	华域汽车	11,700	191,646.00	0.06
580	002372	伟星新材	12,400	191,208.00	0.06
581	688362	甬矽电子	9,800	190,708.00	0.06
582	603298	杭叉集团	9,700	190,508.00	0.06
583	688099	晶晨股份	3,200	189,824.00	0.06
584	600745	闻泰科技	6,700	189,275.00	0.06
585	688083	中望软件	2,600	188,812.00	0.06
586	688590	新致软件	14,600	188,340.00	0.06
587	605555	德昌股份	10,100	187,961.00	0.06
588	300014	亿纬锂能	4,700	187,624.00	0.06
589	002329	皇氏集团	69,200	187,532.00	0.06
590	300978	东箭科技	20,300	187,369.00	0.06
591	600828	茂业商业	79,000	187,230.00	0.06
592	688378	奥来德	7,979	187,187.34	0.06
593	301589	诺瓦星云	995	187,069.95	0.06
594	600403	大有能源	72,400	186,792.00	0.06
595	688232	新点软件	9,420	185,762.40	0.06
596	002441	众业达	24,400	184,952.00	0.06
597	688029	南微医学	3,000	184,680.00	0.06
598	688981	中芯国际	4,000	184,400.00	0.06
599	300642	透景生命	15,810	184,028.40	0.06
600	002837	英维克	8,600	183,954.00	0.06

601	300150	世纪瑞尔	71,100	183,438.00	0.06
602	688019	安集科技	1,457	183,290.60	0.06
603	603551	奥普科技	18,700	183,260.00	0.06
604	300226	上海钢联	10,700	181,258.00	0.06
605	603278	大业股份	28,900	179,469.00	0.06
606	002429	兆驰股份	37,300	179,413.00	0.06
607	000965	天保基建	67,700	177,374.00	0.06
608	002469	三维化学	31,100	177,270.00	0.06
609	688167	炬光科技	3,200	176,000.00	0.06
610	688599	天合光能	10,400	175,968.00	0.06
610	002637	赞宇科技	20,800	175,968.00	0.06
612	300763	锦浪科技	4,200	174,888.00	0.06
613	605196	华通线缆	16,600	174,632.00	0.06
614	000958	电投产融	47,300	173,118.00	0.06
615	002283	天润工业	40,200	172,458.00	0.06
616	600637	东方明珠	28,300	172,064.00	0.06
617	002068	黑猫股份	24,200	171,820.00	0.06
618	000402	金融街	73,100	171,785.00	0.06
619	300113	顺网科技	16,700	171,008.00	0.06
620	000921	海信家电	5,300	170,872.00	0.06
621	600372	中航机载	14,200	169,974.00	0.06
622	002250	联化科技	35,400	169,920.00	0.06
623	000970	中科三环	22,200	169,830.00	0.06
624	601216	君正集团	46,000	169,740.00	0.06
625	600032	浙江新能	23,300	169,624.00	0.06
626	000967	盈峰环境	40,100	169,623.00	0.06
627	600655	豫园股份	32,900	169,435.00	0.06
628	600167	联美控股	32,500	169,325.00	0.06
629	000031	大悦城	72,300	169,182.00	0.06
630	605198	安德利	6,400	168,960.00	0.06
631	600928	西安银行	51,600	168,732.00	0.06

632	601799	星宇股份	1,500	168,060.00	0.06
633	002294	信立泰	6,300	167,769.00	0.06
634	002414	高德红外	28,482	167,758.98	0.06
635	300257	开山股份	16,600	167,660.00	0.06
636	600959	江苏有线	63,100	166,584.00	0.06
637	601568	北元集团	44,900	166,579.00	0.06
638	000401	冀东水泥	41,000	166,460.00	0.06
639	600557	康缘药业	10,500	164,850.00	0.05
640	688333	铂力特	3,400	164,730.00	0.05
641	688017	绿的谐波	2,000	164,200.00	0.05
642	300999	金龙鱼	6,000	164,100.00	0.05
643	600500	中化国际	47,000	164,030.00	0.05
644	601811	新华文轩	11,700	163,917.00	0.05
645	601577	长沙银行	20,000	163,600.00	0.05
646	601106	中国一重	70,500	162,855.00	0.05
647	000703	恒逸石化	22,900	162,361.00	0.05
648	000898	鞍钢股份	76,500	162,180.00	0.05
649	000027	深圳能源	22,200	162,060.00	0.05
650	300454	深信服	3,200	161,696.00	0.05
651	600482	中国动力	8,300	161,684.00	0.05
652	688225	亚信安全	14,200	160,886.00	0.05
653	002373	千方科技	17,700	160,539.00	0.05
654	600377	宁沪高速	12,700	160,020.00	0.05
655	600015	华夏银行	25,000	160,000.00	0.05
656	002966	苏州银行	21,300	159,750.00	0.05
657	003022	联泓新科	11,600	159,036.00	0.05
658	600373	中文传媒	10,700	158,788.00	0.05
659	000568	泸州老窖	1,100	157,839.00	0.05
660	300498	温氏股份	7,800	154,596.00	0.05
661	603595	东尼电子	7,500	154,425.00	0.05
662	300888	稳健医疗	6,100	154,330.00	0.05

663	002299	圣农发展	11,300	154,132.00	0.05
664	601928	凤凰传媒	14,000	153,440.00	0.05
665	000683	远兴能源	22,200	153,402.00	0.05
666	688598	金博股份	5,420	153,386.00	0.05
667	000728	国元证券	25,300	153,318.00	0.05
668	002314	南山控股	74,000	153,180.00	0.05
669	300558	贝达药业	4,700	152,985.00	0.05
670	002996	顺博合金	26,140	152,919.00	0.05
671	001203	大中矿业	15,900	152,799.00	0.05
672	003005	竞业达	7,300	152,132.00	0.05
673	603606	东方电缆	3,100	151,311.00	0.05
674	600668	尖峰集团	19,000	151,050.00	0.05
675	600499	科达制造	17,900	150,897.00	0.05
676	002056	横店东磁	12,100	150,887.00	0.05
677	603883	老百姓	8,190	150,368.40	0.05
678	002508	老板电器	6,800	150,280.00	0.05
679	600110	诺德股份	48,900	149,145.00	0.05
680	002430	杭氧股份	6,700	149,075.00	0.05
681	300677	英科医疗	5,500	147,455.00	0.05
682	600309	万华化学	1,800	145,548.00	0.05
683	601156	东航物流	7,100	144,485.00	0.05
684	688349	三一重能	5,800	144,072.00	0.05
685	603444	吉比特	800	142,408.00	0.05
686	600698	湖南天雁	42,000	142,380.00	0.05
687	688295	中复神鹰	7,000	142,100.00	0.05
688	603937	丽岛新材	18,300	142,008.00	0.05
689	601908	京运通	55,700	140,921.00	0.05
690	002376	新北洋	26,100	140,679.00	0.05
691	603680	今创集团	21,300	140,580.00	0.05
692	603132	金徽股份	10,100	138,976.00	0.05
693	300604	长川科技	5,100	138,567.00	0.05

694	601066	中信建投	7,200	138,528.00	0.05
695	600663	陆家嘴	15,600	137,592.00	0.05
696	600764	中国海防	7,000	137,410.00	0.05
697	600873	梅花生物	13,700	137,274.00	0.05
698	603456	九洲药业	10,000	137,200.00	0.05
699	002572	索菲亚	8,900	136,437.00	0.05
700	300605	恒锋信息	15,000	135,900.00	0.05
701	688586	江航装备	14,600	135,780.00	0.05
702	605050	福然德	15,300	134,793.00	0.04
703	300633	开立医疗	3,400	134,572.00	0.04
704	301116	益客食品	15,000	133,950.00	0.04
705	301236	软通动力	3,800	133,798.00	0.04
706	688153	唯捷创芯	3,600	133,200.00	0.04
707	600273	嘉化能源	18,600	132,804.00	0.04
708	301090	华润材料	20,000	131,600.00	0.04
709	603369	今世缘	2,842	131,300.40	0.04
710	002044	美年健康	34,400	130,032.00	0.04
711	002738	中矿资源	4,800	128,640.00	0.04
712	000060	中金岭南	30,300	128,472.00	0.04
713	603596	伯特利	3,300	128,370.00	0.04
714	002531	天顺风能	14,300	127,842.00	0.04
715	600017	日照港	47,300	126,291.00	0.04
716	001213	中铁特货	31,400	124,030.00	0.04
717	600522	中天科技	7,800	123,630.00	0.04
718	600236	桂冠电力	16,100	123,487.00	0.04
719	002566	益盛药业	20,100	123,012.00	0.04
720	000543	皖能电力	13,700	121,245.00	0.04
721	300896	爱美客	700	120,470.00	0.04
722	002223	鱼跃医疗	3,200	120,320.00	0.04
723	002791	坚朗五金	4,600	119,002.00	0.04
724	605077	华康股份	7,800	118,950.00	0.04

725	600693	东百集团	41,100	115,491.00	0.04
726	002546	新联电子	35,500	115,375.00	0.04
727	002500	山西证券	24,300	114,210.00	0.04
728	600435	北方导航	13,200	113,784.00	0.04
729	002627	三峡旅游	23,400	113,022.00	0.04
730	002436	兴森科技	10,800	111,456.00	0.04
731	002192	融捷股份	3,700	111,074.00	0.04
732	000750	国海证券	36,800	107,088.00	0.04
733	002511	中顺洁柔	15,100	104,492.00	0.03
734	300693	盛弘股份	4,900	102,606.00	0.03
735	300114	中航电测	2,200	99,550.00	0.03
736	002007	华兰生物	6,200	97,898.00	0.03
737	001289	龙源电力	5,600	96,600.00	0.03
738	600618	氯碱化工	10,800	94,824.00	0.03
739	002368	太极股份	4,200	94,710.00	0.03
740	002241	歌尔股份	4,800	93,648.00	0.03
741	300951	博硕科技	2,980	92,827.00	0.03
742	600536	中国软件	3,100	92,752.00	0.03
743	002262	恩华药业	3,900	92,586.00	0.03
744	601233	桐昆股份	5,800	92,568.00	0.03
745	601991	大唐发电	30,600	92,106.00	0.03
746	600025	华能水电	8,500	91,630.00	0.03
747	002608	江苏国信	11,800	91,450.00	0.03
748	002913	奥士康	3,400	91,154.00	0.03
749	300545	联得装备	3,700	90,835.00	0.03
750	603920	世运电路	4,600	90,804.00	0.03
751	600198	大唐电信	17,500	90,125.00	0.03
752	600820	隧道股份	13,800	90,114.00	0.03
753	603379	三美股份	2,300	90,022.00	0.03
754	002010	传化智联	23,400	89,856.00	0.03
755	601611	中国核建	11,100	89,799.00	0.03

756	002281	光迅科技	2,400	89,688.00	0.03
757	002444	巨星科技	3,600	88,920.00	0.03
758	300872	天阳科技	6,700	88,775.00	0.03
759	601698	中国卫通	6,300	88,767.00	0.03
760	603638	艾迪精密	6,300	88,389.00	0.03
761	002472	双环传动	4,000	88,080.00	0.03
762	000598	兴蓉环境	11,500	86,480.00	0.03
763	605128	上海沿浦	3,100	86,459.00	0.03
764	000498	山东路桥	16,500	86,295.00	0.03
765	603218	日月股份	8,400	86,268.00	0.03
766	301123	奕东电子	4,800	86,160.00	0.03
767	300003	乐普医疗	5,800	86,072.00	0.03
768	002756	永兴材料	2,400	85,872.00	0.03
769	600141	兴发集团	4,500	85,860.00	0.03
770	002408	齐翔腾达	15,300	85,680.00	0.03
771	002025	航天电器	1,844	85,524.72	0.03
772	603712	七一二	4,700	85,493.00	0.03
773	600609	金杯汽车	24,600	85,362.00	0.03
774	003035	南网能源	19,300	84,920.00	0.03
775	000892	欢瑞世纪	33,700	84,250.00	0.03
776	600893	航发动力	2,300	84,065.00	0.03
777	000893	亚钾国际	5,200	84,032.00	0.03
778	603816	顾家家居	2,600	83,954.00	0.03
779	601998	中信银行	12,400	83,080.00	0.03
780	600827	百联股份	11,100	81,918.00	0.03
781	600060	海信视像	3,300	81,642.00	0.03
782	300432	富临精工	12,600	81,144.00	0.03
783	002661	克明食品	10,700	79,929.00	0.03
784	002568	百润股份	4,700	79,101.00	0.03
785	600228	返利科技	16,200	78,732.00	0.03
786	603317	天味食品	6,800	77,588.00	0.03

787	600020	中原高速	21,800	77,172.00	0.03
788	600848	上海临港	8,300	75,613.00	0.03
789	002948	青岛银行	21,600	72,792.00	0.02
790	300394	天孚通信	820	72,504.40	0.02
791	600559	老白干酒	3,900	70,902.00	0.02
792	600688	上海石化	27,000	70,470.00	0.02
793	600021	上海电力	7,000	69,230.00	0.02
794	002865	钧达股份	1,800	69,084.00	0.02
795	600123	兰花科创	7,700	68,915.00	0.02
796	000400	许继电气	2,000	68,820.00	0.02
797	601168	西部矿业	3,800	68,210.00	0.02
798	600588	用友网络	6,800	68,000.00	0.02
799	600155	华创云信	11,500	67,965.00	0.02
800	000883	湖北能源	11,300	67,913.00	0.02
801	600299	安迪苏	7,000	67,900.00	0.02
802	600926	杭州银行	5,200	67,860.00	0.02
803	600970	中材国际	5,600	67,536.00	0.02
804	600582	天地科技	9,800	67,522.00	0.02
805	600801	华新水泥	4,900	67,375.00	0.02
806	002265	建设工业	7,800	67,314.00	0.02
807	603345	安井食品	900	66,879.00	0.02
808	600583	海油工程	11,300	66,783.00	0.02
809	301028	东亚机械	7,600	66,652.00	0.02
810	300701	森霸传感	7,900	66,439.00	0.02
811	002487	大金重工	2,900	66,352.00	0.02
812	300772	运达股份	6,900	66,240.00	0.02
813	300009	安科生物	7,700	65,758.00	0.02
814	002244	滨江集团	9,000	65,340.00	0.02
815	688301	奕瑞科技	563	64,874.49	0.02
816	002371	北方华创	200	63,978.00	0.02
817	002563	森马服饰	11,000	63,910.00	0.02

818	300219	鸿利智汇	11,400	63,726.00	0.02
819	002670	国盛金控	7,500	63,525.00	0.02
820	300474	景嘉微	1,000	63,230.00	0.02
821	600546	山煤国际	4,300	62,866.00	0.02
822	002156	通富微电	2,800	62,692.00	0.02
823	601966	玲珑轮胎	3,400	62,458.00	0.02
824	600325	华发股份	9,500	61,750.00	0.02
825	601000	唐山港	13,000	61,100.00	0.02
826	603106	恒银科技	14,300	60,918.00	0.02
827	603000	人民网	3,000	59,970.00	0.02
828	002615	哈尔斯	9,600	59,520.00	0.02
829	605179	一鸣食品	6,500	59,345.00	0.02
830	600258	首旅酒店	4,800	59,280.00	0.02
831	605228	神通科技	6,800	58,344.00	0.02
832	002468	申通快递	6,900	57,960.00	0.02
833	000623	吉林敖东	4,300	57,620.00	0.02
834	002518	科士达	3,200	56,640.00	0.02
835	600863	内蒙华电	12,200	56,608.00	0.02
836	603378	亚士创能	11,000	55,660.00	0.02
837	002832	比音勒芬	2,300	55,591.00	0.02
838	603633	徕木股份	6,700	52,997.00	0.02
839	603826	坤彩科技	1,820	52,725.40	0.02
840	603198	迎驾贡酒	900	51,750.00	0.02
841	000962	东方钨业	5,000	51,050.00	0.02
842	300122	智飞生物	1,800	50,454.00	0.02
843	601838	成都银行	3,300	50,127.00	0.02
844	600418	江淮汽车	3,100	49,104.00	0.02
845	300363	博腾股份	4,100	48,995.00	0.02
846	000513	丽珠集团	1,300	48,373.00	0.02
847	688779	长远锂科	10,400	48,152.00	0.02
848	688372	伟测科技	1,200	47,196.00	0.02

849	688072	拓荆科技	392	47,083.12	0.02
850	000530	冰山冷热	13,000	47,060.00	0.02
851	002030	达安基因	9,200	46,000.00	0.02
852	300192	科德教育	4,600	45,172.00	0.02
853	002993	奥海科技	1,100	40,920.00	0.01
854	002653	海思科	1,300	39,910.00	0.01
855	300821	东岳硅材	5,600	38,304.00	0.01
856	601187	厦门银行	6,800	36,244.00	0.01
857	300414	中光防雷	5,300	35,033.00	0.01
858	001313	粤海饲料	3,600	27,072.00	0.01
859	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
860	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
861	688692	达梦数据	119	20,816.67	0.01
862	688709	成都华微	836	15,708.44	0.01
863	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.01
864	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
865	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
866	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
867	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
868	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
869	688584	上海合晶	591	9,390.99	0.00
870	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
871	603341	龙旗科技	223	8,360.27	0.00
872	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
873	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
874	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
875	601033	永兴股份	479	7,644.84	0.00
876	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
877	301578	辰奕智能	154	6,093.78	0.00
878	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
879	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00

880	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
881	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
882	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
883	688061	灿瑞科技	142	3,902.16	0.00
884	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
885	603381	永臻股份	140	3,518.20	0.00
886	603004	鼎龙科技	195	3,305.25	0.00
887	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
888	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
889	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
890	688568	中科星图	59	2,814.30	0.00
891	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
892	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
893	688606	奥泰生物	33	1,555.29	0.00
894	000836	ST富通	118,400	-	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688111	金山办公	5,196,296.27	1.25
2	300896	爱美客	4,689,114.00	1.13
3	000725	京东方A	4,667,729.00	1.12
4	600887	伊利股份	4,323,303.00	1.04
5	300274	阳光电源	4,252,371.00	1.02
6	002141	*ST贤丰	4,123,866.00	0.99
7	603392	万泰生物	4,065,906.00	0.98
8	000100	TCL科技	4,055,434.00	0.98
9	002128	电投能源	4,052,458.00	0.98

10	000651	格力电器	3,979,325.00	0.96
11	000933	神火股份	3,970,538.77	0.96
12	600919	江苏银行	3,839,818.00	0.93
13	601888	中国中免	3,836,208.00	0.92
14	600050	中国联通	3,768,150.00	0.91
15	603993	洛阳钼业	3,725,007.00	0.90
16	601319	中国人保	3,707,644.00	0.89
17	603501	韦尔股份	3,507,714.00	0.85
18	600865	百大集团	3,483,916.50	0.84
19	002578	闽发铝业	3,390,635.00	0.82
20	605138	盛泰集团	3,341,768.00	0.81

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	5,892,323.00	1.42
2	300502	新易盛	5,677,124.00	1.37
3	600828	茂业商业	5,581,475.00	1.34
4	002594	比亚迪	5,016,550.00	1.21
5	600900	长江电力	5,014,380.00	1.21
6	000725	京东方A	5,006,850.00	1.21
7	002578	闽发铝业	4,846,957.98	1.17
8	002371	北方华创	4,783,374.00	1.15
9	300274	阳光电源	4,687,694.68	1.13
10	300624	万兴科技	4,634,387.00	1.12
11	300394	天孚通信	4,613,641.00	1.11
12	300750	宁德时代	4,568,010.00	1.10
13	000933	神火股份	4,558,515.00	1.10
14	601006	大秦铁路	4,550,437.00	1.10

15	688041	海光信息	4,479,473.34	1.08
16	300512	中亚股份	4,433,293.00	1.07
17	601288	农业银行	4,393,855.00	1.06
18	002996	顺博合金	4,391,109.00	1.06
19	000100	TCL科技	4,369,825.00	1.05
20	300896	爱美客	4,331,117.00	1.04

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,490,620,323.27
卖出股票收入（成交）总额	1,551,152,671.17

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,144,517.81	3.38
	其中：政策性金融债	10,144,517.81	3.38
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)	623,706.08	0.21
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,768,223.89	3.58

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	220403	22农发03	100,000	10,144,517.81	3.38
2	127095	广泰转债	3,022	392,111.21	0.13
3	113671	武进转债	490	59,782.00	0.02
4	123217	富仕转债	425	50,279.63	0.02
5	113685	升24转债	470	47,003.50	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除中信证券（证券代码：600030）、新华保险（证券代码：601336）、中泰证券（证券代码：600918）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2024年05月08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持续督导履职过程中存在以下违规行为对关联关系核查不充分、对真实性核查不充

分、对业务单据审核中未关注到运输合同与船舱计量报告对应的船运公司存在明显差异等被广东证监局出具警示函。

2024年04月30日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因配合客户定增套利的目的提供融券服务被中国证券监督管理委员会合计没收违法所得1,910,680.83元并处以23,250,000元罚款。

2024年04月30日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因未对发行人关联交易情况进行充分核查、发表的核查意见不准确被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2024年04月12日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因相关主体违反限制性规定转让中核钛白2023年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规被中国证券监督管理委员会立案。

2024年01月05日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的可转债项目发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上被中国证券监督管理委员会出具警示函。

2023年10月09日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因组织架构规范整改工作中报送的整改方案不完整、子公司多个待整改项目未按要求完成清理等问题被中国证券监督管理委员会深圳监管局责令改正。

2023年09月22日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因作为财务顾问在重组阶段未对标的公司的主要供应商及主要客户和关联关系等进行审慎核查、持续督导阶段未对上市公司销售真实性等进行审慎核查、内部控制制度执行不严格等被中国证券监督管理委员会采取监管谈话的行政监管措施。

2023年09月22日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因机房基础设施建设安全性不足、信息系统设备可靠性管理疏漏等被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2023年08月29日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因交易及相关系统管理方面存在信息系统设备可靠性管理疏漏、安全运行管理制度执行不到位被上海证券交易所采取书面警示的监管措施。

2024年01月19日，新华保险（证券代码：601336）发行人新华人寿保险股份有限公司因未按照规定履行客户身份识别义务、未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告被中国人民银行北京市分行罚款428.74万元。

2023年12月11日，新华保险（证券代码：601336）发行人新华人寿保险股份有限公司因未按照规定使用经备案的保险条款、未按照规定使用经备案的保险费率被国家金融监督管理总局罚款80万元。

2024年06月19日，中泰证券（证券代码：600918）发行人中泰证券股份有限公司因违反外汇账户管理规定被国家外汇管理局山东省分局给予警告、处90000.00元人民币罚款。

2024年06月05日，中泰证券（证券代码：600918）发行人中泰证券股份有限公司因个别员工私下接受客户委托买卖证券、未担任投资顾问岗位的情况下私下向未与公司签订投资顾问服务协议的客户提供投资建议和具体股票买卖推荐的行为等被中国证券监督管理委员会山东监管局采取出具警示函的行政监督管理措施。

2024年05月28日，中泰证券（证券代码：600918）发行人中泰证券股份有限公司因作为主承销商和受托管理人对存货不存在跌价情况的分析核查不严谨、未制作咨询审计机构工作底稿、未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告等被上海证券交易所予以书面警示。

2024年04月24日，中泰证券（证券代码：600918）发行人中泰证券股份有限公司因作为主承销商和受托管理人对存货不存在跌价情况的分析核查不严谨、未制作咨询审计机构工作底稿、未对发行人重大损失披露临时受托管理事务报告、对发行人立案调查事项披露临时受托管理事务报告不及时被广东证监局责令改正。

2023年12月25日，中泰证券（证券代码：600918）发行人中泰证券股份有限公司因保荐业务违规被北京证券交易所口头警示。

2023年08月08日，中泰证券（证券代码：600918）发行人中泰证券股份有限公司因未有效管理研究所员工记录的未公开会议信息，导致该信息被泄露并在网络上被转发传播被上海证券交易所采取书面警示的监管措施。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	111,659.05
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	30,225.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	141,884.32

7.12.4 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	127095	广泰转债	392,111.21	0.13
2	113671	武进转债	59,782.00	0.02
3	123217	富仕转债	50,279.63	0.02
4	127089	晶澳转债	26,952.81	0.01
5	110094	众和转债	22,187.26	0.01
6	118042	奥维转债	9,513.22	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
14,923	16,264.83	199,524,677.10	82.20%	43,195,402.34	17.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	4,151,570.80	1.71%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年06月01日)基金份额总额	847,544,853.76
本报告期期初基金份额总额	304,635,503.75
本报告期基金总申购份额	168,476,164.06
减：本报告期基金总赎回份额	230,391,588.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	242,720,079.44

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**(1) 基金管理人的重大人事变动**

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所（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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华金证券	2	3,040,115,975.53	100.00%	565,164.12	100.00%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
海通	1	-	-	-	-	-

证券						
西部 证券	1	-	-	-	-	-
长城 证券	2	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	2	-	-	-	-	-
民生 证券	2	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-

申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

- (1) 本基金报告期内新增租用交易单元：甬兴证券。
- (2) 本基金报告期内停止租用交易单元：中泰证券、太平洋证券、华安证券、国投证券、首创证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华金证券	628,538.26	100.00%	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金增加广发证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-10
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-11
3	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-22
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024/05/16,2024/06/24-2024/06/30	30,809,733.01	19,596,592.79	0.00	50,406,325.80	20.77%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

12.3 查阅方式

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

泓德基金管理有限公司
二〇二四年八月二十九日