

泓德智选启航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:中国光大银行股份有限公司

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。

基金托管人中国光大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3月19日(基金合同生效日)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	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	84
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	86
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	86
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	87
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	87
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	87
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	87
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	87
7.12 投资组合报告附注	87
§8 基金份额持有人信息	88
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	88
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	89

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	89
§9 开放式基金份额变动	90
§10 重大事件揭示	90
10.1 基金份额持有人大会决议	90
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	90
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	91
10.4 基金投资策略的改变	91
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	91
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	91
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	91
10.8 其他重大事件	92
§11 影响投资者决策的其他重要信息	93
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	93
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	93
§12 备查文件目录	93
12.1 备查文件目录	93
12.2 存放地点	94
12.3 查阅方式	94

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德智选启航混合型证券投资基金	
基金简称	泓德智选启航混合	
基金主代码	020567	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年03月19日	
基金管理人	泓德基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	167,858,143.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	泓德智选启航混合A	泓德智选启航混合C
下属分级基金的交易代码	020567	020568
报告期末下属分级基金的份额总额	103,010,283.90份	64,847,859.40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、证券公司短期公司债券投资策略和资产支持证券投资策略。此外，本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适度参与股指期货与国债期货投资，以调整投资组合的风险暴露程度，降低系统性风险。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×90%+中国债券综合全价

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泓德基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春	石立平
	联系电话	010-59850177	010-63639180
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com	shiliping@cebbank.com
客户服务电话		4009-100-888	95595
传真		010-59850195	010-63639132
注册地址		西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1206室	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市西城区德胜门外大街125号	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100088	100033
法定代表人		王德晓	吴利军

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03月19日(基金合同生效日)-2024年06月30日)	
	泓德智选启航混合 A	泓德智选启航混合 C
本期已实现收益	669,227.66	390,464.56
本期利润	-2,581,423.29	-1,828,813.29
加权平均基金份额本期利润	-0.0204	-0.0205
本期加权平均净值利润率	-2.04%	-2.06%
本期基金份额净值增长率	-2.18%	-2.29%
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	-2,244,557.31	-1,484,687.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0218	-0.0229
期末基金资产净值	100,765,726.59	63,363,172.11
期末基金份额净值	0.9782	0.9771
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	-2.18%	-2.29%

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2024年3月19日，本年度财务报表的实际编制期间为2024年3月19日至2024年6月30日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

泓德智选启航混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-2.48%	0.52%	-5.16%	0.72%	2.68%	-0.20%
过去三个月	-2.04%	0.47%	-5.54%	0.92%	3.50%	-0.45%
自基金合同 生效起至今	-2.18%	0.45%	-7.83%	0.92%	5.65%	-0.47%

泓德智选启航混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-2.51%	0.52%	-5.16%	0.72%	2.65%	-0.20%
过去三个月	-2.14%	0.47%	-5.54%	0.92%	3.40%	-0.45%
自基金合同 生效起至今	-2.29%	0.45%	-7.83%	0.92%	5.54%	-0.47%

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央国债登记结算有限责任公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

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

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



- 注：1、本基金的基金合同于2024年3月19日生效，截至2024年6月30日止，本基金成立未满1年。
- 2、本基金建仓期为6个月，截至2024年6月30日止，本基金建仓期尚未结束。
- 3、建仓期结束后，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金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	2024-03-19	-	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，有效内需仍然不足，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。我们自产品成立以来，稳健建仓，在风险敞口上保持了相对的谨慎，没有受到风格大幅波动的影响，同时Alpha也有所表现。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。中证全指覆盖了A

股绝大部分股票，能够较好地表征A股的beta，我们希望通过人工智能的方法，挖掘出更多有效的Alpha因子，从而超越基准。

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航混合A基金份额净值为0.9782元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.18%，同期业绩比较基准收益率为-7.83%；截至报告期末泓德智选启航混合C基金份额净值为0.9771元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-2.29%，同期业绩比较基准收益率为-7.83%。

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-3,729,244.60元，其中：泓德智选启航混合A期末可供分配利润为-2,244,557.31元（泓德智选启航混合A的未分配利润已实现部分为500,252.76元，未分配利润未实现部分为-2,744,810.07元），泓德智选启航混合C期末可供分配利润为-1,484,687.29元（泓德智选启航混合C的未分配利润已实现部分为241,542.85元，未分配利润未实现部分为-1,726,230.14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，中国光大银行股份有限公司在泓德智选启航混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。

该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

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

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《泓德智选启航混合型证券投资基金2024年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：泓德智选启航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
资产：		
货币资金	6.4.7.1	52,431,478.64
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	113,869,079.43
其中：股票投资		113,865,079.13
基金投资		-
债券投资		4,000.30
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-

应收申购款		84,578.06
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		166,385,136.13
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		1,935,121.65
应付管理人报酬		199,506.09
应付托管费		33,251.00
应付销售服务费		27,062.77
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	61,295.92
负债合计		2,256,237.43
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	167,858,143.30
未分配利润	6.4.7.8	-3,729,244.60
净资产合计		164,128,898.70
负债和净资产总计		166,385,136.13

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额167,858,143.30份，其中A类基金份额总额为103,010,283.90份，基金份额净值为0.9782元；C类基金份额总额为64,847,859.40份，基金份额净值为0.9771元。

6.2 利润表

会计主体：泓德智选启航混合型证券投资基金

本报告期：2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年03月19日（基金合同 生效日）至2024年06月30 日
一、营业总收入		-3,402,106.73
1.利息收入		140,529.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	140,529.51
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,862,819.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	559,077.51
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	0.30
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-
股利收益	6.4.7.13	1,303,741.50
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	-5,469,928.80
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	64,473.25
减：二、营业总支出		1,008,129.85
1.管理人报酬		728,676.31
2.托管费		121,446.02

3.销售服务费		100,230.32
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失		-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.16	57,777.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,410,236.58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-4,410,236.58
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-4,410,236.58

6.3 净资产变动表

会计主体：泓德智选启航混合型证券投资基金

本报告期：2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2024年03月19日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	220,461,163.73	-	220,461,163.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,603,020.43	-3,729,244.60	-56,332,265.03
（一）、综合收益总额	-	-4,410,236.58	-4,410,236.58
（二）、本期基金份额交易产生的净	-52,603,020.43	680,991.98	-51,922,028.45

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	354,101.42	-7,407.81	346,693.61
2.基金赎回款	-52,957,121.85	688,399.79	-52,268,722.06
（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	167,858,143.30	-3,729,244.60	164,128,898.70

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

泓德智选启航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[2023]2901号《关于准予泓德智选启航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《泓德智选启航混合型证券投资基金合同》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220,441,631.57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(2024)第0107号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同》于2024年3月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为220,461,163.73份，其中认购资金利息折合19,532.16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，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据《泓德智选启航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、销售服务费收取方式等不同，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《泓德智选启航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、证券公司短期公司债券等）、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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德智选启航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3月19日（基金合同生效日）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3月19日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2024年3月19日（基金合同生效日）至2024年6月30日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业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商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

权益工具

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

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变

动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净

资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服

务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	9,872,559.85
等于：本金	9,868,334.68
加：应计利息	4,225.17
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	42,558,918.79
等于：本金	42,554,452.24
加：应计利息	4,466.55
减：坏账准备	-
合计	52,431,478.64

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	119,335,007.93	-	113,865,079.13	-5,469,928.80	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,000.00	0.30	4,000.30	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,000.00	0.30	4,000.30	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	119,339,007.93	0.30	113,869,079.43	-5,469,928.80	

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	2,697.72
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	57,777.20
其他应付	821.00
合计	61,295.92

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 泓德智选启航混合A**

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合A)	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

基金合同生效日	128,991,605.26	128,991,605.26
本期申购	147,732.90	147,732.90
本期赎回（以“-”号填列）	-26,129,054.26	-26,129,054.26
本期末	103,010,283.90	103,010,283.90

6.4.7.7.2 泓德智选启航混合C

金额单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合C)	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	91,469,558.47	91,469,558.47
本期申购	206,368.52	206,368.52
本期赎回（以“-”号填列）	-26,828,067.59	-26,828,067.59
本期末	64,847,859.40	64,847,859.40

注：1.本基金于2024年3月1日至2024年3月15日期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币220,441,631.57元，折合为220,441,631.57份基金份额(其中A类基金份额128,979,288.21份，C类基金份额91,462,343.36份)。根据《泓德智选启航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19,532.16元。在本基金成立后，折算为19,532.16份基金份额(其中A类基金份额12,317.05份，C类基金份额7,215.11份)，划入基金份额持有人账户。

2.根据《泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同》、《泓德智选启航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航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2024年3月19日(基金合同生效日)至2024年6月18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2024年6月19日起开始办理。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 泓德智选启航混合A

单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	669,227.66	-3,250,650.95	-2,581,423.29
本期基金份额交易产生的变动数	-168,974.90	505,840.88	336,865.98
其中：基金申购款	849.91	-4,299.20	-3,449.29
基金赎回款	-169,824.81	510,140.08	340,315.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	500,252.76	-2,744,810.07	-2,244,557.31

6.4.7.8.2 泓德智选启航混合C

单位：人民币元

项目 (泓德智选启航混合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	390,464.56	-2,219,277.85	-1,828,813.29
本期基金份额交易产生的变动数	-148,921.71	493,047.71	344,126.00
其中：基金申购款	989.06	-4,947.58	-3,958.52
基金赎回款	-149,910.77	497,995.29	348,084.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	241,542.85	-1,726,230.14	-1,484,687.29

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日
活期存款利息收入	66,388.86
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	74,140.65
结算备付金利息收入	-

其他	-
合计	140,529.51

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日
卖出股票成交总额	138,286,962.77
减：卖出股票成本总额	137,351,929.69
减：交易费用	375,955.57
买卖股票差价收入	559,077.51

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03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	0.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	0.30

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,303,741.50
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,303,741.50

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03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-5,469,928.80
——股票投资	-5,469,928.80
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-5,469,928.80

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日

基金赎回费收入	64,473.25
合计	64,473.25

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

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日
审计费用	21,666.32
信息披露费	36,110.88
证券出借违约金	-
合计	57,777.20

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
中国光大银行股份有限公司（以下简称“中国光大银行”）	基金托管人、基金销售机构

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03月19日（基金合同生效日）至2024年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	728,676.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	280,315.72
应支付基金管理人的净管理费	448,360.59

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	121,446.02

注：支付基金托管人中国光大银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方	本期 2024年03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

名称	泓德智选启航混合A	泓德智选启航混合C	合计
泓德基金	0.00	57.54	57.54
中国光大银行	0.00	12,451.21	12,451.21
合计	0.00	12,508.75	12,508.75

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末除管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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03月19日（基金合同生效日）至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国光大银行	9,872,559.85	66,388.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，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
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	-
603285	键邦股份	2024-06-28	5个交易日	新股未上市	18.65	18.65	820	15,293.00	15,293.00	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6个月以上	限售股	23.35	25.13	93	2,171.55	2,337.09	-
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	-
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	92	1,715.80	1,715.80	-
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	2024-06-17	17个	新债	100.00	100.01	40	4,000.00	4,000.30	-

	转债		交易 日	未上 市						
--	----	--	---------	---------	--	--	--	--	--	--

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。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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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0.00%。

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约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	52,431,478.64	-	-	-	52,431,478.64
交易性金融资产	-	-	4,000.30	113,865,079.13	113,869,079.43
应收申购款	-	-	-	84,578.06	84,578.06
资产总计	52,431,478.64	-	4,000.30	113,949,657.19	166,385,136.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,935,121.65	1,935,121.65
应付管理人报酬	-	-	-	199,506.09	199,506.09
应付托管费	-	-	-	33,251.00	33,251.00
应付销售服务费	-	-	-	27,062.77	27,062.77
其他负债	-	-	-	61,295.92	61,295.92
负债总计	-	-	-	2,256,237.43	2,256,237.43

计					
利率敏感度缺口	52,431,478.64	-	4,000.30	111,693,419.76	164,128,898.70

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0.00%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

		值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	113,865,079.13	69.38
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	113,865,079.13	69.38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日
第一层次	113,824,124.68
第二层次	42,617.66
第三层次	2,337.09
合计	113,869,079.43

6.4.14.2 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。

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	113,865,079.13	68.43
	其中：股票	113,865,079.13	68.43
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,000.30	0.00
	其中：债券	4,000.30	0.00
	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	52,431,478.64	31.51
8	其他各项资产	84,578.06	0.05
9	合计	166,385,136.13	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	711,729.00	0.43
B	采矿业	6,832,198.00	4.16
C	制造业	68,631,738.69	41.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,215,768.00	2.57
E	建筑业	1,742,328.00	1.06
F	批发和零售业	2,179,815.00	1.33
G	交通运输、仓储和邮政业	2,958,567.00	1.80
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,921,863.74	3.61
J	金融业	14,863,424.30	9.06
K	房地产业	1,700,198.00	1.04
L	租赁和商务服务业	1,169,525.00	0.71
M	科学研究和技术服务业	652,295.00	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	716,448.00	0.44
O	居民服务、修理和其他服务业	21,060.00	0.01
P	教育	80,436.00	0.05
Q	卫生和社会工作	166,718.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	1,007,401.40	0.61
S	综合	293,566.00	0.18
	合计	113,865,079.13	69.38

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600519	贵州茅台	1,900	2,788,041.00	1.70
2	601318	中国平安	39,100	1,617,176.00	0.99
3	300750	宁德时代	8,400	1,512,252.00	0.92
4	000333	美的集团	15,800	1,019,100.00	0.62
5	600900	长江电力	33,800	977,496.00	0.60
6	600036	招商银行	28,500	974,415.00	0.59
7	000725	京东方 A	211,800	866,262.00	0.53
8	601166	兴业银行	47,900	843,998.00	0.51
9	601328	交通银行	105,300	786,591.00	0.48
10	600887	伊利股份	30,100	777,784.00	0.47
11	000651	格力电器	19,800	776,556.00	0.47
12	601919	中远海控	49,400	765,206.00	0.47
13	601211	国泰君安	52,800	715,440.00	0.44
14	603993	洛阳钼业	82,800	703,800.00	0.43
15	600941	中国移动	6,300	677,250.00	0.41
16	601899	紫金矿业	38,400	674,688.00	0.41
17	600030	中信证券	35,600	648,988.00	0.40
18	300760	迈瑞医疗	2,200	640,002.00	0.39
19	002475	立讯精密	15,900	625,029.00	0.38
20	601336	新华保险	20,800	624,624.00	0.38
21	601138	工业富联	22,300	611,020.00	0.37
22	000338	潍柴动力	37,500	609,000.00	0.37
23	601398	工商银行	106,400	606,480.00	0.37
24	600019	宝钢股份	86,600	575,890.00	0.35
25	000858	五粮液	4,200	537,768.00	0.33
26	002594	比亚迪	2,100	525,525.00	0.32
27	601169	北京银行	84,000	490,560.00	0.30
28	002384	东山精密	23,300	482,310.00	0.29

29	000100	TCL科技	110,900	479,088.00	0.29
30	600015	华夏银行	73,500	470,400.00	0.29
31	601601	中国太保	16,800	468,048.00	0.29
32	601288	农业银行	105,400	459,544.00	0.28
33	601717	郑煤机	30,600	452,880.00	0.28
34	601229	上海银行	60,200	437,052.00	0.27
35	601728	中国电信	69,400	426,810.00	0.26
36	600795	国电电力	69,800	418,102.00	0.25
37	600690	海尔智家	14,100	400,158.00	0.24
38	601225	陕西煤业	15,300	394,281.00	0.24
39	600346	恒力石化	28,000	390,600.00	0.24
40	600039	四川路桥	49,500	390,555.00	0.24
41	601857	中国石油	37,500	387,000.00	0.24
42	601058	赛轮轮胎	27,500	385,000.00	0.23
43	601600	中国铝业	50,300	383,789.00	0.23
44	603897	长城科技	21,800	382,590.00	0.23
45	603501	韦尔股份	3,800	377,606.00	0.23
46	600547	山东黄金	13,700	375,106.00	0.23
47	601688	华泰证券	30,100	372,939.00	0.23
48	601088	中国神华	8,400	372,708.00	0.23
49	601658	邮储银行	73,200	371,124.00	0.23
50	601633	长城汽车	14,600	369,380.00	0.23
51	601766	中国中车	48,600	364,986.00	0.22
52	002027	分众传媒	60,200	364,812.00	0.22
53	600050	中国联通	77,600	364,720.00	0.22
54	600999	招商证券	26,200	364,442.00	0.22
55	600183	生益科技	17,100	360,126.00	0.22
56	300498	温氏股份	17,600	348,832.00	0.21
57	600837	海通证券	40,100	343,256.00	0.21
58	002001	新和成	17,800	341,760.00	0.21
59	600566	济川药业	10,700	339,297.00	0.21

60	688728	格科微	27,000	326,970.00	0.20
61	600968	海油发展	77,800	320,536.00	0.20
62	600048	保利发展	36,200	317,112.00	0.19
63	000596	古井贡酒	1,500	316,605.00	0.19
64	600276	恒瑞医药	8,200	315,372.00	0.19
65	600309	万华化学	3,700	299,182.00	0.18
66	002938	鹏鼎控股	7,400	294,224.00	0.18
67	601808	中海油服	16,800	288,960.00	0.18
68	000975	银泰黄金	17,700	288,333.00	0.18
69	600660	福耀玻璃	6,000	287,400.00	0.18
70	600926	杭州银行	22,000	287,100.00	0.17
71	000532	华金资本	23,700	285,822.00	0.17
72	600938	中国海油	8,500	280,500.00	0.17
73	000921	海信家电	8,700	280,488.00	0.17
74	605499	东鹏饮料	1,300	280,475.00	0.17
75	601939	建设银行	37,500	277,500.00	0.17
76	002984	森麒麟	11,500	277,035.00	0.17
77	600707	彩虹股份	40,400	275,124.00	0.17
78	300122	智飞生物	9,800	274,694.00	0.17
79	600967	内蒙一机	38,100	274,320.00	0.17
80	603228	景旺电子	8,600	273,480.00	0.17
81	002636	金安国纪	42,900	272,415.00	0.17
82	600219	南山铝业	71,200	271,272.00	0.17
83	600436	片仔癀	1,300	269,321.00	0.16
84	000166	申万宏源	61,900	266,789.00	0.16
85	600066	宇通客车	10,300	265,740.00	0.16
86	300737	科顺股份	60,900	261,870.00	0.16
87	002237	恒邦股份	22,700	261,277.00	0.16
88	601668	中国建筑	48,900	259,659.00	0.16
89	002252	上海莱士	33,100	258,842.00	0.16
90	603676	卫信康	32,300	258,723.00	0.16

91	601865	福莱特	12,600	253,260.00	0.15
92	002106	莱宝高科	23,100	251,790.00	0.15
93	002322	理工能科	15,700	251,514.00	0.15
94	300080	易成新能	86,500	249,120.00	0.15
95	603176	汇通集团	66,500	248,045.00	0.15
96	600489	中金黄金	16,700	247,160.00	0.15
97	601989	中国重工	49,900	246,007.00	0.15
98	600517	国网英大	55,700	241,181.00	0.15
99	000877	天山股份	44,500	240,300.00	0.15
100	600018	上港集团	41,300	238,714.00	0.15
101	002128	电投能源	11,000	232,100.00	0.14
102	000786	北新建材	7,600	225,416.00	0.14
103	002371	北方华创	700	223,923.00	0.14
104	002463	沪电股份	6,100	222,650.00	0.14
105	600803	新奥股份	10,700	222,560.00	0.14
106	600262	北方股份	13,500	221,805.00	0.14
107	300451	创业慧康	63,800	220,748.00	0.13
108	002724	海洋王	49,200	218,940.00	0.13
109	003816	中国广核	47,000	217,610.00	0.13
110	688008	澜起科技	3,800	217,208.00	0.13
111	300677	英科医疗	8,100	217,161.00	0.13
112	001286	陕西能源	18,800	216,764.00	0.13
113	000568	泸州老窖	1,500	215,235.00	0.13
114	002064	华峰化学	30,000	215,100.00	0.13
115	601998	中信银行	32,100	215,070.00	0.13
116	300628	亿联网络	5,800	213,266.00	0.13
117	601607	上海医药	11,100	212,121.00	0.13
118	688036	传音控股	2,760	211,250.40	0.13
119	601128	常熟银行	27,590	208,856.30	0.13
120	002142	宁波银行	9,400	207,364.00	0.13
121	600988	赤峰黄金	12,600	205,884.00	0.13

122	688509	正元地信	70,000	202,300.00	0.12
123	601126	四方股份	10,500	201,810.00	0.12
124	301207	华兰疫苗	11,400	201,438.00	0.12
125	002241	歌尔股份	10,300	200,953.00	0.12
126	300440	运达科技	38,100	200,025.00	0.12
127	000785	居然之家	81,600	198,288.00	0.12
128	603681	永冠新材	15,500	197,625.00	0.12
129	002282	博深股份	30,700	196,173.00	0.12
130	001207	联科科技	13,500	196,020.00	0.12
131	601006	大秦铁路	27,300	195,468.00	0.12
132	300708	聚灿光电	21,700	195,300.00	0.12
133	600551	时代出版	27,580	195,266.40	0.12
134	000999	华润三九	4,580	195,016.40	0.12
135	600028	中国石化	30,800	194,656.00	0.12
136	300059	东方财富	18,400	194,304.00	0.12
137	600096	云天化	10,000	194,200.00	0.12
138	002852	道道全	26,900	193,680.00	0.12
139	600845	宝信软件	6,060	193,495.80	0.12
140	601066	中信建投	10,000	192,400.00	0.12
141	002340	格林美	30,200	192,374.00	0.12
142	688678	福立旺	17,640	191,041.20	0.12
143	688132	邦彦技术	11,000	190,850.00	0.12
144	688767	博拓生物	7,600	190,532.00	0.12
145	000830	鲁西化工	16,400	190,076.00	0.12
146	002736	国信证券	21,800	189,442.00	0.12
147	002557	洽洽食品	6,700	188,873.00	0.12
148	603737	三棵树	5,200	188,604.00	0.11
149	300308	中际旭创	1,360	187,516.80	0.11
150	002835	同为股份	11,100	187,479.00	0.11
151	601888	中国中免	3,000	187,470.00	0.11
152	002120	韵达股份	24,000	185,760.00	0.11

153	601988	中国银行	39,700	183,414.00	0.11
154	600588	用友网络	18,200	182,000.00	0.11
155	600600	青岛啤酒	2,500	181,925.00	0.11
156	600739	辽宁成大	21,700	181,629.00	0.11
157	002265	建设工业	20,800	179,504.00	0.11
158	600642	申能股份	20,300	179,249.00	0.11
159	601319	中国人保	34,700	178,705.00	0.11
160	300428	立中集团	9,600	178,464.00	0.11
161	002035	华帝股份	28,000	174,440.00	0.11
162	601512	中新集团	22,700	172,974.00	0.11
163	002215	诺普信	23,200	172,840.00	0.11
164	603025	大豪科技	12,400	171,368.00	0.10
165	300140	节能环保	28,700	171,339.00	0.10
166	601500	通用股份	31,800	169,812.00	0.10
167	300999	金龙鱼	6,200	169,570.00	0.10
168	688223	晶科能源	23,800	168,980.00	0.10
169	601816	京沪高铁	31,400	168,618.00	0.10
170	601298	青岛港	17,600	168,256.00	0.10
171	000923	河钢资源	9,700	167,034.00	0.10
172	600511	国药股份	5,400	166,266.00	0.10
173	300783	三只松鼠	7,600	166,212.00	0.10
174	600598	北大荒	13,200	164,868.00	0.10
175	300320	海达股份	20,100	164,016.00	0.10
176	002364	中恒电气	29,800	163,900.00	0.10
177	002946	新乳业	18,700	163,812.00	0.10
178	300323	华灿光电	37,300	162,255.00	0.10
179	001331	胜通能源	11,700	162,045.00	0.10
180	601077	渝农商行	32,200	161,644.00	0.10
181	600000	浦发银行	19,500	160,485.00	0.10
182	603267	鸿远电子	4,700	160,270.00	0.10
183	300439	美康生物	17,400	159,384.00	0.10

184	002678	珠江钢琴	43,900	158,918.00	0.10
185	300502	新易盛	1,500	158,325.00	0.10
186	601985	中国核电	14,700	156,702.00	0.10
187	300389	艾比森	12,700	155,956.00	0.10
188	600011	华能国际	16,100	154,882.00	0.09
189	301206	三元生物	6,300	154,854.00	0.09
190	000529	广弘控股	26,300	154,644.00	0.09
191	002493	荣盛石化	16,000	154,560.00	0.09
192	600115	中国东航	38,500	154,385.00	0.09
193	300259	新天科技	61,000	154,330.00	0.09
194	603298	杭叉集团	7,840	153,977.60	0.09
195	000157	中联重科	20,000	153,600.00	0.09
196	600188	兖矿能源	6,700	152,291.00	0.09
197	600161	天坛生物	6,220	151,768.00	0.09
198	600132	重庆啤酒	2,500	151,750.00	0.09
199	300639	凯普生物	32,900	151,340.00	0.09
200	002969	嘉美包装	53,100	151,335.00	0.09
201	002082	万邦德	35,700	150,297.00	0.09
202	600525	长园集团	35,200	149,952.00	0.09
203	600718	东软集团	18,100	149,687.00	0.09
204	603385	惠达卫浴	27,200	149,328.00	0.09
205	300154	瑞凌股份	28,000	149,240.00	0.09
206	601898	中煤能源	11,900	148,512.00	0.09
207	002192	融捷股份	4,900	147,098.00	0.09
208	000758	中色股份	28,900	146,812.00	0.09
209	300774	倍杰特	22,300	145,619.00	0.09
210	600694	大商股份	8,560	143,893.60	0.09
211	002714	牧原股份	3,300	143,880.00	0.09
212	600029	南方航空	24,400	143,716.00	0.09
213	301187	欧圣电气	5,900	143,075.00	0.09
214	603806	福斯特	9,720	142,884.00	0.09

215	002244	滨江集团	19,500	141,570.00	0.09
216	002255	海陆重工	28,900	141,321.00	0.09
217	688079	美迪凯	19,000	140,980.00	0.09
218	300181	佐力药业	9,200	139,104.00	0.08
219	600025	华能水电	12,900	139,062.00	0.08
220	301219	腾远钴业	3,600	137,736.00	0.08
221	002213	大为股份	14,100	137,475.00	0.08
222	003019	宸展光电	5,420	137,288.60	0.08
223	600031	三一重工	8,300	136,950.00	0.08
223	002873	新天药业	16,500	136,950.00	0.08
225	001313	粤海饲料	18,200	136,864.00	0.08
226	002996	顺博合金	23,280	136,188.00	0.08
227	002415	海康威视	4,400	136,004.00	0.08
228	300432	富临精工	21,100	135,884.00	0.08
229	002422	科伦药业	4,400	133,452.00	0.08
230	600956	新天绿能	16,300	133,171.00	0.08
231	601168	西部矿业	7,400	132,830.00	0.08
232	002491	通鼎互联	39,200	132,496.00	0.08
233	605060	联德股份	9,200	132,204.00	0.08
234	002434	万里扬	26,900	131,810.00	0.08
235	000630	铜陵有色	36,500	131,765.00	0.08
236	002286	保龄宝	23,900	131,689.00	0.08
237	600919	江苏银行	17,700	131,511.00	0.08
238	002917	金奥博	14,700	130,536.00	0.08
239	603056	德邦股份	9,900	129,690.00	0.08
240	600741	华域汽车	7,900	129,402.00	0.08
241	002203	海亮股份	16,200	129,276.00	0.08
242	600062	华润双鹤	6,600	129,228.00	0.08
243	300679	电连技术	3,200	128,736.00	0.08
244	300115	长盈精密	10,700	128,293.00	0.08
245	600959	江苏有线	48,200	127,248.00	0.08

246	603096	新经典	7,500	126,750.00	0.08
247	600285	羚锐制药	5,200	125,892.00	0.08
248	002043	兔宝宝	12,100	125,477.00	0.08
249	600114	东睦股份	8,700	125,193.00	0.08
250	600089	特变电工	8,900	123,443.00	0.08
251	603766	隆鑫通用	18,200	123,396.00	0.08
252	002532	天山铝业	15,100	122,461.00	0.07
253	688772	珠海冠宇	8,200	122,180.00	0.07
254	000301	东方盛虹	15,300	121,941.00	0.07
255	301127	天源环保	10,300	121,746.00	0.07
256	688510	航亚科技	6,600	121,506.00	0.07
257	000933	神火股份	6,000	121,380.00	0.07
258	300881	盛德鑫泰	4,700	120,743.00	0.07
259	002550	千红制药	22,400	120,736.00	0.07
260	600610	中毅达	30,300	120,594.00	0.07
261	000951	中国重汽	8,400	120,288.00	0.07
262	600487	亨通光电	7,600	119,852.00	0.07
263	600985	淮北矿业	7,100	118,854.00	0.07
263	002266	浙富控股	42,600	118,854.00	0.07
265	300348	长亮科技	17,400	118,668.00	0.07
266	002997	瑞鹄模具	3,700	118,289.00	0.07
267	300227	光韵达	21,600	118,152.00	0.07
268	300341	麦克奥迪	13,700	117,546.00	0.07
269	300289	利德曼	30,400	117,040.00	0.07
270	603219	富佳股份	7,900	116,604.00	0.07
271	002517	恺英网络	12,200	116,510.00	0.07
272	600032	浙江新能	16,000	116,480.00	0.07
273	002212	天融信	23,900	116,393.00	0.07
274	600760	中航沈飞	2,900	116,290.00	0.07
275	600649	城投控股	34,900	115,868.00	0.07
276	000042	中洲控股	29,300	115,735.00	0.07

277	601628	中国人寿	3,700	114,885.00	0.07
278	600888	新疆众和	16,200	114,534.00	0.07
279	301090	华润材料	17,400	114,492.00	0.07
280	002948	青岛银行	33,900	114,243.00	0.07
281	000959	首钢股份	41,600	113,152.00	0.07
282	300492	华图山鼎	1,200	113,040.00	0.07
283	000039	中集集团	12,200	112,972.00	0.07
284	601187	厦门银行	21,000	111,930.00	0.07
285	603339	四方科技	12,300	111,561.00	0.07
286	300605	恒锋信息	12,300	111,438.00	0.07
287	300841	康华生物	2,200	111,408.00	0.07
288	601012	隆基绿能	7,900	110,758.00	0.07
289	301387	光大同创	3,300	110,550.00	0.07
290	000002	万科A	15,900	110,187.00	0.07
291	002443	金洲管道	20,600	110,004.00	0.07
292	600390	五矿资本	27,100	109,755.00	0.07
293	002531	天顺风能	12,200	109,068.00	0.07
294	300100	双林股份	10,100	108,777.00	0.07
295	000576	甘化科工	18,100	108,600.00	0.07
296	603920	世运电路	5,500	108,570.00	0.07
297	600348	华阳股份	10,900	108,564.00	0.07
298	300390	天华新能	6,300	108,234.00	0.07
299	601825	沪农商行	16,100	108,192.00	0.07
300	688016	心脉医疗	1,094	107,266.70	0.07
301	688306	均普智能	26,400	107,184.00	0.07
302	301301	川宁生物	8,300	106,074.00	0.06
303	002519	银河电子	21,500	105,565.00	0.06
304	002739	万达电影	8,700	105,183.00	0.06
305	601009	南京银行	10,100	104,939.00	0.06
306	002567	唐人神	19,500	104,520.00	0.06
307	002267	陕天然气	13,800	104,328.00	0.06

308	601598	中国外运	18,500	104,155.00	0.06
309	600989	宝丰能源	6,000	103,980.00	0.06
310	001338	永顺泰	10,600	103,880.00	0.06
311	688188	柏楚电子	560	103,348.00	0.06
312	600150	中国船舶	2,500	101,775.00	0.06
312	000708	中信特钢	7,500	101,775.00	0.06
314	601616	广电电气	34,900	101,559.00	0.06
315	688077	大地熊	6,400	101,312.00	0.06
316	603366	日出东方	28,200	100,674.00	0.06
317	002379	宏创控股	17,100	100,206.00	0.06
318	002273	水晶光电	5,900	100,182.00	0.06
319	601218	吉鑫科技	35,900	100,161.00	0.06
320	002296	辉煌科技	9,700	100,007.00	0.06
321	600406	国电南瑞	4,000	99,840.00	0.06
322	300837	浙矿股份	4,800	99,648.00	0.06
323	002788	鹭燕医药	12,600	99,288.00	0.06
324	300638	广和通	5,800	99,180.00	0.06
325	600483	福能股份	8,500	99,110.00	0.06
326	002245	蔚蓝锂芯	12,700	98,425.00	0.06
327	001289	龙源电力	5,700	98,325.00	0.06
328	600662	外服控股	24,500	98,245.00	0.06
329	603909	建发合诚	11,800	98,176.00	0.06
330	603861	白云电器	11,700	97,929.00	0.06
331	002008	大族激光	4,700	97,760.00	0.06
332	002412	汉森制药	18,900	97,713.00	0.06
333	002054	德美化工	19,900	97,709.00	0.06
334	002139	拓邦股份	9,200	97,704.00	0.06
335	300124	汇川技术	1,900	97,470.00	0.06
336	300394	天孚通信	1,100	97,262.00	0.06
337	603997	继峰股份	9,500	97,185.00	0.06
338	002026	山东威达	11,700	97,110.00	0.06

339	300857	协创数据	1,700	96,900.00	0.06
340	002304	洋河股份	1,200	96,888.00	0.06
341	688355	明志科技	7,200	96,624.00	0.06
342	603819	神力股份	9,200	96,600.00	0.06
343	688208	道通科技	4,000	96,560.00	0.06
344	002913	奥士康	3,600	96,516.00	0.06
345	603190	亚通精工	4,200	96,432.00	0.06
346	000738	航发控制	4,800	96,336.00	0.06
347	601231	环旭电子	6,000	96,300.00	0.06
348	002558	巨人网络	10,200	96,288.00	0.06
349	000517	荣安地产	35,900	96,212.00	0.06
350	002056	横店东磁	7,700	96,019.00	0.06
351	300307	慈星股份	16,100	95,795.00	0.06
352	300705	九典制药	3,580	95,729.20	0.06
353	600351	亚宝药业	17,000	95,370.00	0.06
353	300194	福安药业	25,500	95,370.00	0.06
355	002140	东华科技	12,300	95,325.00	0.06
356	002020	京新药业	9,100	95,277.00	0.06
357	300529	健帆生物	3,500	95,235.00	0.06
358	000990	诚志股份	12,800	95,232.00	0.06
359	605018	长华集团	10,500	95,130.00	0.06
360	000797	中国武夷	40,800	95,064.00	0.06
361	002947	恒铭达	2,700	95,040.00	0.06
362	300409	道氏技术	11,100	95,016.00	0.06
363	300002	神州泰岳	11,700	95,004.00	0.06
364	603408	建霖家居	7,200	94,968.00	0.06
365	600475	华光环能	10,900	94,939.00	0.06
366	000553	安道麦A	20,900	94,886.00	0.06
367	300531	优博讯	9,100	94,822.00	0.06
368	002472	双环传动	4,300	94,686.00	0.06
369	601101	昊华能源	10,300	94,657.00	0.06

370	600727	鲁北化工	15,000	94,500.00	0.06
371	301151	冠龙节能	6,400	94,208.00	0.06
372	600875	东方电气	5,100	94,095.00	0.06
373	600866	星湖科技	17,000	93,840.00	0.06
374	002487	大金重工	4,100	93,808.00	0.06
375	002332	仙琚制药	8,200	93,562.00	0.06
376	301277	新天地	7,200	93,456.00	0.06
377	600480	凌云股份	9,500	93,385.00	0.06
378	688155	先惠技术	2,360	93,314.40	0.06
379	600916	中国黄金	9,700	93,314.00	0.06
380	000589	贵州轮胎	18,400	93,288.00	0.06
381	603929	亚翔集成	3,900	93,210.00	0.06
382	300170	汉得信息	15,100	92,714.00	0.06
383	603337	杰克股份	3,500	92,120.00	0.06
384	301060	兰卫医学	11,300	91,756.00	0.06
385	688253	英诺特	2,400	91,464.00	0.06
386	301066	万事利	11,200	90,720.00	0.06
387	688138	清溢光电	4,200	90,300.00	0.06
388	300772	运达股份	9,400	90,240.00	0.05
389	000823	超声电子	10,600	90,206.00	0.05
390	002970	锐明技术	2,500	90,075.00	0.05
391	002648	卫星化学	5,000	89,900.00	0.05
392	603132	金徽股份	6,500	89,440.00	0.05
393	600851	海欣股份	19,500	89,115.00	0.05
394	002274	华昌化工	12,000	89,040.00	0.05
395	603217	元利科技	6,300	88,830.00	0.05
396	688175	高凌信息	6,000	88,680.00	0.05
397	600391	航发科技	5,800	88,450.00	0.05
398	003006	百亚股份	3,700	87,690.00	0.05
399	600095	湘财股份	14,700	87,612.00	0.05
400	300433	蓝思科技	4,800	87,600.00	0.05

401	301319	唯特偶	2,900	87,087.00	0.05
402	300957	贝泰妮	1,800	86,976.00	0.05
403	002908	德生科技	11,300	86,671.00	0.05
404	601636	旗滨集团	13,400	86,430.00	0.05
405	300724	捷佳伟创	1,600	86,416.00	0.05
406	600556	天下秀	23,700	86,268.00	0.05
407	300884	狄耐克	10,000	86,200.00	0.05
408	601311	骆驼股份	10,700	85,814.00	0.05
409	300369	绿盟科技	16,600	84,826.00	0.05
410	688012	中微公司	600	84,756.00	0.05
411	000031	大悦城	36,100	84,474.00	0.05
412	300460	惠伦晶体	9,900	84,447.00	0.05
413	002773	康弘药业	3,900	84,435.00	0.05
414	603103	横店影视	6,100	84,424.00	0.05
415	600809	山西汾酒	400	84,352.00	0.05
416	603668	天马科技	7,400	83,990.00	0.05
417	002036	联创电子	12,300	83,025.00	0.05
418	688578	艾力斯	1,289	82,160.86	0.05
419	600886	国投电力	4,500	82,080.00	0.05
420	000423	东阿阿胶	1,300	81,380.00	0.05
421	600987	航民股份	11,500	81,190.00	0.05
422	601916	浙商银行	29,200	80,592.00	0.05
423	601568	北元集团	21,700	80,507.00	0.05
423	300182	捷成股份	21,700	80,507.00	0.05
425	603299	苏盐井神	8,400	79,800.00	0.05
426	002840	华统股份	4,800	79,632.00	0.05
427	002292	奥飞娱乐	13,200	78,936.00	0.05
428	601139	深圳燃气	11,800	78,824.00	0.05
429	000915	华特达因	2,600	78,416.00	0.05
430	603259	药明康德	2,000	78,380.00	0.05
431	002867	周大生	6,000	78,360.00	0.05

432	002905	金逸影视	12,600	78,120.00	0.05
433	002791	坚朗五金	3,000	77,610.00	0.05
434	000050	深天马 A	10,600	77,168.00	0.05
435	601678	滨化股份	22,100	76,908.00	0.05
436	002225	濮耐股份	18,700	76,483.00	0.05
437	603098	森特股份	9,700	76,242.00	0.05
438	002677	浙江美大	9,400	76,234.00	0.05
439	601000	唐山港	16,200	76,140.00	0.05
440	600584	长电科技	2,400	76,104.00	0.05
441	002206	海利得	19,900	76,018.00	0.05
442	600403	大有能源	29,400	75,852.00	0.05
443	603601	再升科技	27,400	75,624.00	0.05
444	001318	阳光乳业	7,300	75,117.00	0.05
445	002662	京威股份	24,700	75,088.00	0.05
446	688234	天岳先进	1,600	75,072.00	0.05
447	000429	粤高速 A	7,200	74,952.00	0.05
448	002752	昇兴股份	14,800	74,888.00	0.05
449	601061	中信金属	10,900	74,883.00	0.05
450	600315	上海家化	4,200	74,676.00	0.05
450	002346	柘中股份	9,800	74,676.00	0.05
452	000739	普洛药业	5,500	74,635.00	0.05
453	603967	中创物流	8,000	74,400.00	0.05
454	603032	德新科技	6,500	74,295.00	0.05
455	600163	中闽能源	15,400	74,228.00	0.05
456	600873	梅花生物	7,400	74,148.00	0.05
457	002549	凯美特气	14,500	74,095.00	0.05
458	300212	易华录	4,400	74,052.00	0.05
459	601198	东兴证券	9,300	74,028.00	0.05
460	605198	安德利	2,800	73,920.00	0.05
461	688408	中信博	800	73,664.00	0.04
462	300267	尔康制药	35,400	73,632.00	0.04

463	603185	弘元绿能	4,300	73,487.00	0.04
464	600104	上汽集团	5,300	73,458.00	0.04
465	601928	凤凰传媒	6,700	73,432.00	0.04
466	601908	京运通	29,000	73,370.00	0.04
467	300769	德方纳米	2,600	73,320.00	0.04
468	600893	航发动力	2,000	73,100.00	0.04
469	000703	恒逸石化	10,300	73,027.00	0.04
470	688123	聚辰股份	1,200	72,996.00	0.04
471	000035	中国天楹	16,100	72,933.00	0.04
472	002302	西部建设	14,000	72,800.00	0.04
473	002298	中电兴发	16,400	72,488.00	0.04
474	002950	奥美医疗	10,900	71,940.00	0.04
475	000600	建投能源	11,400	71,820.00	0.04
476	601238	广汽集团	9,200	71,208.00	0.04
477	300226	上海钢联	4,200	71,148.00	0.04
478	002745	木林森	8,800	70,928.00	0.04
479	002137	实益达	14,900	70,924.00	0.04
480	603070	万控智造	6,300	70,497.00	0.04
481	301267	华夏眼科	3,400	70,448.00	0.04
482	001979	招商蛇口	8,000	70,320.00	0.04
483	002353	杰瑞股份	2,000	70,160.00	0.04
484	002068	黑猫股份	9,800	69,580.00	0.04
485	000963	华东医药	2,500	69,525.00	0.04
486	600426	华鲁恒升	2,600	69,264.00	0.04
487	002250	联化科技	14,200	68,160.00	0.04
488	002314	南山控股	32,900	68,103.00	0.04
489	601162	天风证券	30,900	67,362.00	0.04
490	600233	圆通速递	4,300	67,295.00	0.04
491	688055	龙腾光电	21,200	67,204.00	0.04
492	688153	唯捷创芯	1,800	66,600.00	0.04
493	603629	利通电子	3,600	66,456.00	0.04

494	301123	奕东电子	3,700	66,415.00	0.04
495	002311	海大集团	1,400	65,870.00	0.04
496	301165	锐捷网络	2,200	65,648.00	0.04
497	600295	鄂尔多斯	6,600	65,472.00	0.04
498	300379	东方通	8,100	65,448.00	0.04
499	301262	海看股份	2,900	65,395.00	0.04
500	603707	健友股份	5,500	65,340.00	0.04
501	600699	均胜电子	4,400	65,208.00	0.04
502	603688	石英股份	2,200	65,142.00	0.04
503	002050	三花智控	3,400	64,872.00	0.04
504	000895	双汇发展	2,700	64,179.00	0.04
505	600993	马应龙	2,400	64,008.00	0.04
506	600595	中孚实业	25,700	63,993.00	0.04
507	002585	双星新材	12,900	63,984.00	0.04
508	300871	回盛生物	6,700	63,918.00	0.04
509	600996	贵广网络	8,300	63,744.00	0.04
510	002916	深南电路	600	63,462.00	0.04
511	002399	海普瑞	7,300	63,291.00	0.04
512	002214	大立科技	5,600	63,168.00	0.04
513	600998	九州通	12,905	62,976.40	0.04
514	688247	宣泰医药	7,600	62,472.00	0.04
515	600312	平高电气	3,200	62,240.00	0.04
516	002048	宁波华翔	4,800	62,112.00	0.04
517	002534	西子洁能	6,200	62,062.00	0.04
518	000958	电投产融	16,900	61,854.00	0.04
519	002635	安洁科技	4,000	61,760.00	0.04
520	300986	志特新材	9,100	61,607.00	0.04
521	600872	中炬高新	2,700	61,263.00	0.04
522	300244	迪安诊断	5,100	61,200.00	0.04
523	300512	中亚股份	10,300	60,976.00	0.04
524	600663	陆家嘴	6,900	60,858.00	0.04

525	000021	深科技	4,000	60,480.00	0.04
526	600415	小商品城	8,100	60,102.00	0.04
527	300497	富祥药业	6,700	59,831.00	0.04
528	000034	神州数码	2,600	59,514.00	0.04
529	600459	贵研铂业	4,400	59,444.00	0.04
530	002601	龙佰集团	3,200	59,424.00	0.04
531	601611	中国核建	7,300	59,057.00	0.04
532	603233	大参林	4,100	58,630.00	0.04
533	300042	朗科科技	2,900	58,551.00	0.04
534	600761	安徽合力	2,700	58,428.00	0.04
535	300559	佳发教育	6,100	58,377.00	0.04
536	300176	派生科技	13,200	58,212.00	0.04
537	300219	鸿利智汇	10,400	58,136.00	0.04
538	600790	轻纺城	17,900	57,638.00	0.04
539	002687	乔治白	13,645	57,309.00	0.03
540	603458	勘设股份	10,100	57,065.00	0.03
541	688388	嘉元科技	5,800	56,550.00	0.03
542	605268	王力安防	7,900	56,327.00	0.03
543	300211	亿通科技	10,600	56,074.00	0.03
544	002318	久立特材	2,400	55,992.00	0.03
545	002522	浙江众成	17,600	55,616.00	0.03
546	300976	达瑞电子	1,200	55,020.00	0.03
547	002730	电光科技	7,800	54,912.00	0.03
548	688093	世华科技	3,000	54,510.00	0.03
549	600429	三元股份	14,600	54,458.00	0.03
550	688109	品茗科技	1,990	54,426.50	0.03
551	000069	华侨城 A	26,600	54,264.00	0.03
552	000029	深深房 A	5,100	54,213.00	0.03
553	002170	芭田股份	9,000	54,090.00	0.03
554	002474	榕基软件	12,400	54,064.00	0.03
555	300832	新产业	800	53,952.00	0.03

556	002315	焦点科技	2,000	53,920.00	0.03
557	603065	宿迁联盛	7,200	53,784.00	0.03
558	600758	辽宁能源	18,800	53,768.00	0.03
559	601117	中国化学	6,500	53,560.00	0.03
560	002404	嘉欣丝绸	10,100	53,429.00	0.03
561	000761	本钢板材	21,200	53,212.00	0.03
562	002283	天润工业	12,400	53,196.00	0.03
563	600350	山东高速	6,000	53,100.00	0.03
564	688660	电气风电	18,400	52,992.00	0.03
565	603906	龙蟠科技	6,800	52,972.00	0.03
566	002897	意华股份	1,400	52,724.00	0.03
567	603016	新宏泰	3,400	52,564.00	0.03
568	603995	甬金股份	3,000	52,560.00	0.03
569	601567	三星医疗	1,500	52,500.00	0.03
570	002429	兆驰股份	10,900	52,429.00	0.03
571	600537	亿晶光电	20,800	52,416.00	0.03
572	600612	老凤祥	900	52,371.00	0.03
573	002240	盛新锂能	3,900	52,338.00	0.03
574	600420	国药现代	4,900	52,332.00	0.03
575	300055	万邦达	12,900	52,245.00	0.03
576	301370	国科恒泰	4,800	52,176.00	0.03
577	002360	同德化工	10,300	52,118.00	0.03
578	603195	公牛集团	675	52,056.00	0.03
579	301222	浙江恒威	2,100	51,996.00	0.03
580	001872	招商港口	2,700	51,975.00	0.03
581	600057	厦门象屿	7,600	51,680.00	0.03
582	002083	孚日股份	12,200	51,606.00	0.03
583	688273	麦澜德	2,600	51,480.00	0.03
584	600282	南钢股份	10,300	51,294.00	0.03
585	000538	云南白药	1,000	51,150.00	0.03
586	000897	津滨发展	24,900	51,045.00	0.03

587	688392	骄成超声	1,200	50,928.00	0.03
588	605599	菜百股份	4,000	50,920.00	0.03
589	603659	璞泰来	3,600	50,868.00	0.03
590	002497	雅化集团	5,700	50,844.00	0.03
591	301227	森鹰窗业	2,700	50,787.00	0.03
592	002546	新联电子	15,600	50,700.00	0.03
593	600063	皖维高新	14,400	50,688.00	0.03
594	601015	陕西黑猫	18,000	50,400.00	0.03
595	603815	交建股份	8,800	50,336.00	0.03
596	000555	神州信息	5,400	50,328.00	0.03
597	002990	盛视科技	2,500	50,325.00	0.03
597	002683	广东宏大	2,500	50,325.00	0.03
599	300752	隆利科技	3,700	50,246.00	0.03
600	600997	开滦股份	7,300	50,078.00	0.03
601	002483	润邦股份	11,100	50,061.00	0.03
602	603899	晨光股份	1,600	50,048.00	0.03
603	002884	凌霄泵业	2,600	49,920.00	0.03
604	688616	西力科技	4,400	49,896.00	0.03
605	600882	妙可蓝多	4,000	49,880.00	0.03
606	600507	方大特钢	13,300	49,742.00	0.03
607	600409	三友化工	9,900	49,698.00	0.03
608	603355	莱克电气	2,300	49,680.00	0.03
609	002053	云南能投	4,100	49,569.00	0.03
610	600698	湖南天雁	14,600	49,494.00	0.03
611	301015	百洋医药	2,100	49,413.00	0.03
612	002645	华宏科技	7,700	48,972.00	0.03
613	600693	东百集团	17,400	48,894.00	0.03
614	600963	岳阳林纸	13,200	48,444.00	0.03
615	300849	锦盛新材	3,800	48,374.00	0.03
616	301199	迈赫股份	2,000	48,360.00	0.03
617	601686	友发集团	9,600	48,288.00	0.03

618	600478	科力远	12,800	48,256.00	0.03
619	002755	奥赛康	5,000	48,250.00	0.03
620	600609	金杯汽车	13,900	48,233.00	0.03
621	600316	洪都航空	2,900	48,227.00	0.03
622	300388	节能国祯	8,700	48,198.00	0.03
623	601001	晋控煤业	2,900	47,908.00	0.03
624	603060	国检集团	8,200	47,888.00	0.03
625	603110	东方材料	4,300	47,859.00	0.03
626	688225	亚信安全	4,200	47,586.00	0.03
627	301377	鼎泰高科	2,700	47,385.00	0.03
628	605333	沪光股份	1,700	47,345.00	0.03
629	600935	华塑股份	20,500	46,945.00	0.03
630	605339	南侨食品	3,300	46,926.00	0.03
631	300018	中元股份	10,200	46,920.00	0.03
632	603556	海兴电力	1,000	46,830.00	0.03
633	002688	金河生物	12,900	46,827.00	0.03
634	600546	山煤国际	3,200	46,784.00	0.03
635	002697	红旗连锁	10,100	46,763.00	0.03
636	601068	中铝国际	11,100	46,731.00	0.03
637	300767	震安科技	5,500	46,640.00	0.03
638	300005	探路者	9,300	46,593.00	0.03
639	603291	联合水务	3,800	46,588.00	0.03
640	605016	百龙创园	2,280	46,443.60	0.03
641	600198	大唐电信	9,000	46,350.00	0.03
642	002661	克明食品	6,200	46,314.00	0.03
643	600794	保税科技	14,600	46,282.00	0.03
644	600802	福建水泥	16,600	46,148.00	0.03
645	688092	爱科科技	2,160	46,116.00	0.03
646	688090	瑞松科技	1,680	45,864.00	0.03
647	000408	藏格矿业	1,900	45,733.00	0.03
648	605188	国光连锁	5,900	45,725.00	0.03

649	688579	山大地纬	5,800	45,530.00	0.03
650	688276	百克生物	1,600	45,392.00	0.03
651	300916	朗特智能	1,800	45,324.00	0.03
652	688798	艾为电子	800	45,296.00	0.03
653	688018	乐鑫科技	458	45,195.44	0.03
654	300880	迦南智能	2,300	45,149.00	0.03
655	000543	皖能电力	5,100	45,135.00	0.03
656	603999	读者传媒	9,500	44,935.00	0.03
657	301062	上海艾录	4,400	44,924.00	0.03
658	002161	远望谷	9,700	44,814.00	0.03
659	688472	阿特斯	4,400	44,792.00	0.03
660	300321	同大股份	2,400	44,712.00	0.03
661	003012	东鹏控股	7,300	44,603.00	0.03
662	603256	宏和科技	6,300	44,478.00	0.03
663	603605	珀莱雅	400	44,396.00	0.03
664	003025	思进智能	3,600	44,316.00	0.03
665	002841	视源股份	1,500	44,295.00	0.03
666	600817	宇通重工	5,400	44,280.00	0.03
667	603516	淳中科技	1,400	44,198.00	0.03
668	601975	招商南油	12,300	44,157.00	0.03
669	300424	航新科技	3,600	44,028.00	0.03
670	603496	恒为科技	1,800	44,010.00	0.03
671	300047	天源迪科	6,700	43,818.00	0.03
672	300634	彩讯股份	2,600	43,758.00	0.03
673	600562	国睿科技	3,200	43,712.00	0.03
674	600858	银座股份	11,100	43,623.00	0.03
675	300381	溢多利	7,100	43,594.00	0.03
676	603568	伟明环保	2,100	43,218.00	0.03
677	000526	学大教育	700	43,120.00	0.03
678	002378	章源钨业	7,500	43,050.00	0.03
679	600731	湖南海利	9,300	42,966.00	0.03

680	300206	理邦仪器	5,000	42,950.00	0.03
681	605007	五洲特纸	3,400	42,942.00	0.03
682	300446	航天智造	3,600	42,840.00	0.03
683	002500	山西证券	9,100	42,770.00	0.03
684	688296	和达科技	4,400	42,768.00	0.03
685	600521	华海药业	2,500	42,625.00	0.03
686	600386	北巴传媒	15,200	42,408.00	0.03
687	300403	汉字集团	6,200	42,346.00	0.03
688	603809	豪能股份	5,240	42,339.20	0.03
689	688505	复旦张江	6,600	42,240.00	0.03
690	301299	卓创资讯	1,000	42,000.00	0.03
691	002641	公元股份	10,600	41,658.00	0.03
692	000762	西藏矿业	2,300	41,584.00	0.03
693	605300	佳禾食品	3,800	41,572.00	0.03
694	601019	山东出版	3,500	41,370.00	0.03
695	600879	航天电子	5,300	41,181.00	0.03
696	603915	国茂股份	4,000	41,160.00	0.03
697	002100	天康生物	5,900	40,887.00	0.02
698	002019	亿帆医药	3,300	40,788.00	0.02
699	601330	绿色动力	7,000	40,740.00	0.02
700	600037	歌华有线	6,800	40,664.00	0.02
701	300410	正业科技	7,900	40,448.00	0.02
702	300919	中伟股份	1,300	40,287.00	0.02
703	603086	先达股份	10,600	40,280.00	0.02
704	002109	兴化股份	12,500	40,250.00	0.02
705	600585	海螺水泥	1,700	40,103.00	0.02
706	002488	金固股份	9,100	39,949.00	0.02
707	600983	惠而浦	5,300	39,485.00	0.02
708	603229	奥翔药业	3,900	39,195.00	0.02
709	002666	德联集团	10,700	38,734.00	0.02
710	600667	太极实业	6,700	38,257.00	0.02

711	603283	赛腾股份	500	38,200.00	0.02
712	000066	中国长城	4,300	37,625.00	0.02
713	000997	新大陆	2,700	37,557.00	0.02
714	600674	川投能源	2,000	37,500.00	0.02
715	300412	迦南科技	13,000	37,440.00	0.02
716	300192	科德教育	3,800	37,316.00	0.02
717	300065	海兰信	5,600	37,016.00	0.02
718	600828	茂业商业	15,600	36,972.00	0.02
719	301256	华融化学	6,000	36,840.00	0.02
720	002099	海翔药业	7,100	36,281.00	0.02
721	001330	博纳影业	6,700	36,247.00	0.02
722	002301	齐心集团	7,500	36,225.00	0.02
723	002722	物产金轮	3,200	36,160.00	0.02
724	001322	箭牌家居	4,900	35,819.00	0.02
725	600362	江西铜业	1,500	35,520.00	0.02
726	600939	重庆建工	15,300	35,496.00	0.02
727	002264	新华都	6,900	35,259.00	0.02
728	601838	成都银行	2,300	34,937.00	0.02
729	603227	雪峰科技	5,600	34,720.00	0.02
730	000020	深华发A	3,500	34,650.00	0.02
731	000607	华媒控股	11,100	34,299.00	0.02
732	002223	鱼跃医疗	900	33,840.00	0.02
733	688516	奥特维	800	33,448.00	0.02
734	600990	四创电子	1,900	33,345.00	0.02
735	601886	江河集团	6,800	33,184.00	0.02
736	688127	蓝特光学	1,800	33,102.00	0.02
737	002081	金螳螂	10,900	33,027.00	0.02
738	002466	天齐锂业	1,100	32,901.00	0.02
739	000776	广发证券	2,700	32,859.00	0.02
740	002737	葵花药业	1,400	32,732.00	0.02
741	300642	透景生命	2,800	32,592.00	0.02

742	603987	康德莱	5,300	32,383.00	0.02
743	600605	汇通能源	1,300	32,344.00	0.02
744	600332	白云山	1,100	32,263.00	0.02
745	688352	颀中科技	2,800	31,948.00	0.02
746	300113	顺网科技	3,100	31,744.00	0.02
747	601186	中国铁建	3,700	31,709.00	0.02
748	000768	中航西飞	1,300	31,239.00	0.02
749	600877	电科芯片	2,900	31,088.00	0.02
750	600819	耀皮玻璃	7,300	30,806.00	0.02
751	600308	华泰股份	9,800	30,772.00	0.02
752	002233	塔牌集团	4,200	30,702.00	0.02
753	603189	网达软件	2,800	30,632.00	0.02
754	600085	同仁堂	800	30,568.00	0.02
755	300651	金陵体育	2,500	30,300.00	0.02
756	300627	华测导航	1,000	29,850.00	0.02
757	000917	电广传媒	5,900	29,795.00	0.02
758	002993	奥海科技	800	29,760.00	0.02
759	000690	宝新能源	5,800	29,580.00	0.02
760	603918	金桥信息	2,800	29,260.00	0.02
761	000876	新希望	3,200	29,248.00	0.02
762	002845	同兴达	2,200	29,084.00	0.02
763	601669	中国电建	5,200	29,068.00	0.02
764	600650	锦江在线	4,100	29,028.00	0.02
765	300418	昆仑万维	900	29,016.00	0.02
766	300011	鼎汉技术	5,800	28,942.00	0.02
767	603198	迎驾贡酒	500	28,750.00	0.02
768	300251	光线传媒	3,400	28,594.00	0.02
769	688598	金博股份	1,000	28,300.00	0.02
770	600500	中化国际	8,100	28,269.00	0.02
771	301153	中科江南	1,000	28,260.00	0.02
772	600395	盘江股份	4,700	28,247.00	0.02

773	300068	南都电源	3,400	28,152.00	0.02
774	688106	金宏气体	1,600	28,032.00	0.02
775	002030	达安基因	5,600	28,000.00	0.02
776	601100	恒立液压	600	27,948.00	0.02
777	300014	亿纬锂能	700	27,944.00	0.02
778	603181	皇马科技	3,100	27,869.00	0.02
779	688148	芳源股份	6,600	27,786.00	0.02
780	603128	华贸物流	4,800	27,696.00	0.02
781	688033	天宜上佳	4,600	27,600.00	0.02
782	002603	以岭药业	1,800	27,594.00	0.02
783	688556	高测股份	2,320	27,584.80	0.02
784	002138	顺络电子	1,000	27,460.00	0.02
785	300031	宝通科技	1,900	27,303.00	0.02
786	001965	招商公路	2,300	27,278.00	0.02
787	000509	华塑控股	10,600	27,242.00	0.02
788	688766	普冉股份	280	27,207.60	0.02
789	301028	东亚机械	3,100	27,187.00	0.02
790	600323	瀚蓝环境	1,300	27,170.00	0.02
791	002428	云南锗业	2,500	27,150.00	0.02
792	002749	国光股份	1,800	27,072.00	0.02
793	600577	精达股份	6,800	26,996.00	0.02
794	605186	健麾信息	1,200	26,952.00	0.02
795	688733	壹石通	1,800	26,910.00	0.02
796	603666	亿嘉和	1,700	26,826.00	0.02
797	600438	通威股份	1,400	26,754.00	0.02
798	601877	正泰电器	1,400	26,684.00	0.02
799	002912	中新赛克	1,500	26,580.00	0.02
800	002935	天奥电子	2,200	26,576.00	0.02
801	300624	万兴科技	500	26,535.00	0.02
802	603206	嘉环科技	2,100	26,523.00	0.02
803	301268	铭利达	1,700	26,435.00	0.02

804	300448	浩云科技	6,300	26,397.00	0.02
805	300400	劲拓股份	2,300	26,312.00	0.02
806	000421	南京公用	5,900	26,196.00	0.02
807	603985	恒润股份	2,200	26,180.00	0.02
808	601390	中国中铁	4,000	26,080.00	0.02
809	600651	飞乐音响	9,400	25,944.00	0.02
810	600055	万东医疗	2,100	25,935.00	0.02
811	301121	紫建电子	700	25,851.00	0.02
812	688585	上纬新材	5,000	25,850.00	0.02
813	603816	顾家家居	800	25,832.00	0.02
814	301139	元道通信	1,200	25,812.00	0.02
815	000955	欣龙控股	8,800	25,784.00	0.02
816	002062	宏润建设	7,400	25,752.00	0.02
817	603786	科博达	400	25,660.00	0.02
818	000598	兴蓉环境	3,400	25,568.00	0.02
819	600256	广汇能源	3,800	25,460.00	0.02
820	603155	新亚强	2,320	25,427.20	0.02
821	600320	振华重工	7,400	25,308.00	0.02
822	300474	景嘉微	400	25,292.00	0.02
823	603615	茶花股份	2,400	25,272.00	0.02
824	300049	福瑞股份	500	25,170.00	0.02
825	688019	安集科技	200	25,160.00	0.02
826	603328	依顿电子	3,200	25,152.00	0.02
827	603823	百合花	2,600	25,142.00	0.02
828	601528	瑞丰银行	5,300	25,016.00	0.02
829	601228	广州港	8,200	25,010.00	0.02
830	003005	竞业达	1,200	25,008.00	0.02
831	301258	富士莱	1,000	24,860.00	0.02
832	300661	圣邦股份	300	24,834.00	0.02
833	002182	宝武镁业	2,200	24,816.00	0.02
834	002222	福晶科技	1,100	24,783.00	0.02

835	600780	通宝能源	4,200	24,780.00	0.02
836	688366	昊海生科	400	24,672.00	0.02
837	603529	爱玛科技	900	24,597.00	0.01
838	600201	生物股份	3,400	24,514.00	0.01
839	603368	柳药集团	1,400	24,500.00	0.01
840	603882	金域医学	900	24,471.00	0.01
841	000426	兴业银锡	1,800	24,444.00	0.01
842	601216	君正集团	6,600	24,354.00	0.01
843	600228	返利科技	5,000	24,300.00	0.01
844	002441	众业达	3,200	24,256.00	0.01
845	605196	华通线缆	2,300	24,196.00	0.01
846	000683	远兴能源	3,500	24,185.00	0.01
847	600746	江苏索普	4,100	24,149.00	0.01
848	002727	一心堂	1,600	24,144.00	0.01
849	600829	人民同泰	4,300	24,123.00	0.01
850	603618	杭电股份	5,500	24,090.00	0.01
851	001266	宏英智能	1,100	23,892.00	0.01
852	600523	贵航股份	2,400	23,760.00	0.01
853	600735	新华锦	6,200	23,746.00	0.01
854	688599	天合光能	1,400	23,688.00	0.01
855	002830	名雕股份	2,400	23,616.00	0.01
856	603801	志邦家居	1,800	23,544.00	0.01
857	688677	海泰新光	600	23,538.00	0.01
858	301316	慧博云通	1,600	23,488.00	0.01
859	603122	合富中国	4,600	23,414.00	0.01
860	600757	长江传媒	2,900	23,374.00	0.01
861	603236	移远通信	500	23,365.00	0.01
862	603966	法兰泰克	3,400	23,358.00	0.01
863	603213	镇洋发展	3,100	23,188.00	0.01
864	002866	传艺科技	1,800	23,166.00	0.01
865	300315	掌趣科技	5,500	22,935.00	0.01

866	002850	科达利	300	22,914.00	0.01
867	002595	豪迈科技	600	22,902.00	0.01
868	603718	海利生物	3,700	22,829.00	0.01
869	300077	国民技术	2,600	22,698.00	0.01
870	600971	恒源煤电	1,900	22,686.00	0.01
871	300158	振东制药	5,900	22,538.00	0.01
872	605123	派克新材	400	22,472.00	0.01
873	688776	国光电气	400	22,160.00	0.01
874	603348	文灿股份	800	22,152.00	0.01
875	601018	宁波港	6,500	22,100.00	0.01
876	688369	致远互联	1,400	22,022.00	0.01
877	688167	炬光科技	400	22,000.00	0.01
878	300527	中船应急	3,400	21,998.00	0.01
879	601339	百隆东方	4,200	21,882.00	0.01
880	300803	指南针	600	21,846.00	0.01
881	600559	老白干酒	1,200	21,816.00	0.01
882	002832	比音勒芬	900	21,753.00	0.01
883	000530	冰山冷热	6,000	21,720.00	0.01
884	000550	江铃汽车	1,000	21,710.00	0.01
885	001270	铖昌科技	590	21,664.80	0.01
886	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
887	601969	海南矿业	3,400	21,556.00	0.01
888	603013	亚普股份	1,600	21,552.00	0.01
889	002674	兴业科技	2,100	21,462.00	0.01
890	002973	侨银股份	2,400	21,456.00	0.01
891	000970	中科三环	2,800	21,420.00	0.01
892	300248	新开普	3,300	21,417.00	0.01
893	300269	联建光电	8,500	21,335.00	0.01
894	600266	城建发展	5,700	21,318.00	0.01
895	688182	灿勤科技	1,600	21,184.00	0.01
896	301236	软通动力	600	21,126.00	0.01

897	688177	百奥泰	1,000	21,120.00	0.01
898	603938	三孚股份	1,796	21,103.00	0.01
899	300736	百邦科技	1,500	21,060.00	0.01
900	603277	银都股份	700	21,028.00	0.01
901	300426	唐德影视	3,100	21,018.00	0.01
902	000751	锌业股份	8,000	20,960.00	0.01
903	300571	平治信息	1,000	20,940.00	0.01
904	600782	新钢股份	6,300	20,916.00	0.01
905	000011	深物业A	2,700	20,898.00	0.01
906	603866	桃李面包	4,100	20,787.00	0.01
907	300314	戴维医疗	2,000	20,680.00	0.01
908	688268	华特气体	400	20,644.00	0.01
909	000546	金圆股份	5,100	20,451.00	0.01
910	603566	普莱柯	1,500	20,370.00	0.01
911	601156	东航物流	1,000	20,350.00	0.01
912	601965	中国汽研	1,200	20,268.00	0.01
913	600548	深高速	1,900	20,197.00	0.01
914	300393	中来股份	3,500	20,195.00	0.01
915	002430	杭氧股份	900	20,025.00	0.01
916	300926	博俊科技	1,000	20,020.00	0.01
917	605166	聚合顺	1,900	19,931.00	0.01
918	301419	阿莱德	800	19,864.00	0.01
919	002985	北摩高科	900	19,827.00	0.01
920	600576	祥源文旅	4,500	19,755.00	0.01
921	002351	漫步者	1,500	19,725.00	0.01
922	688028	沃尔德	1,200	19,716.00	0.01
923	603028	赛福天	3,500	19,705.00	0.01
924	603989	艾华集团	1,400	19,684.00	0.01
925	301111	粤万年青	1,400	19,530.00	0.01
926	300797	钢研纳克	2,100	19,446.00	0.01
927	603353	和顺石油	1,500	19,440.00	0.01

928	000655	金岭矿业	3,500	19,355.00	0.01
929	301338	凯格精机	600	19,278.00	0.01
930	603360	百傲化学	1,640	19,270.00	0.01
931	002644	佛慈制药	3,000	19,260.00	0.01
932	600098	广州发展	3,000	19,200.00	0.01
933	300082	奥克股份	4,500	19,170.00	0.01
934	300940	南极光	1,500	19,110.00	0.01
935	688110	东芯股份	1,000	19,070.00	0.01
936	688076	诺泰生物	242	18,943.76	0.01
937	600557	康缘药业	1,200	18,840.00	0.01
938	002891	中宠股份	900	18,783.00	0.01
939	300649	杭州园林	1,800	18,774.00	0.01
940	301296	新巨丰	2,600	18,746.00	0.01
941	603533	掌阅科技	1,000	18,670.00	0.01
942	301218	华是科技	900	18,639.00	0.01
943	300102	乾照光电	2,900	18,618.00	0.01
944	601069	西部黄金	1,600	18,608.00	0.01
945	301177	迪阿股份	1,000	18,600.00	0.01
946	000425	徐工机械	2,600	18,590.00	0.01
947	300872	天阳科技	1,400	18,550.00	0.01
948	605199	葫芦娃	1,900	18,525.00	0.01
949	301011	华立科技	1,200	18,492.00	0.01
950	301069	凯盛新材	1,400	18,354.00	0.01
951	603106	恒银科技	4,300	18,318.00	0.01
952	000928	中钢国际	3,300	18,315.00	0.01
953	002895	川恒股份	1,000	18,310.00	0.01
954	000657	中钨高新	2,000	18,280.00	0.01
955	605179	一鸣食品	2,000	18,260.00	0.01
956	601158	重庆水务	3,800	18,240.00	0.01
957	600016	民生银行	4,800	18,192.00	0.01
958	603108	润达医疗	1,200	18,168.00	0.01

959	002777	久远银海	1,200	17,988.00	0.01
960	300453	三鑫医疗	2,800	17,892.00	0.01
961	600373	中文传媒	1,200	17,808.00	0.01
962	600177	雅戈尔	2,500	17,800.00	0.01
963	003029	吉大正元	1,000	17,790.00	0.01
964	000967	盈峰环境	4,200	17,766.00	0.01
965	002465	海格通信	1,700	17,612.00	0.01
966	600841	动力新科	5,300	17,384.00	0.01
967	300274	阳光电源	280	17,368.40	0.01
968	603279	景津装备	800	17,352.00	0.01
969	002334	英威腾	2,900	17,342.00	0.01
970	002839	张家港行	4,300	17,286.00	0.01
971	300896	爱美客	100	17,210.00	0.01
972	301003	江苏博云	800	17,208.00	0.01
973	301009	可靠股份	2,300	17,181.00	0.01
974	603225	新凤鸣	1,100	17,149.00	0.01
975	603699	纽威股份	1,000	17,120.00	0.01
976	603285	键邦股份	912	17,008.80	0.01
977	603878	武进不锈	2,600	17,004.00	0.01
978	300058	蓝色光标	3,100	16,864.00	0.01
979	600084	中信尼雅	3,600	16,740.00	0.01
980	601958	金钼股份	1,600	16,656.00	0.01
981	603309	维力医疗	1,500	16,515.00	0.01
982	300190	维尔利	6,000	16,500.00	0.01
983	002521	齐峰新材	1,400	16,450.00	0.01
984	688017	绿的谐波	200	16,420.00	0.01
985	601279	英利汽车	4,400	16,412.00	0.01
986	300573	兴齐眼药	100	16,400.00	0.01
987	601699	潞安环能	900	16,317.00	0.01
988	300604	长川科技	600	16,302.00	0.01
989	002375	亚厦股份	4,900	15,925.00	0.01

990	603305	旭升集团	1,500	15,840.00	0.01
991	300795	米奥会展	900	15,777.00	0.01
992	688372	伟测科技	400	15,732.00	0.01
993	301358	湖南裕能	500	15,730.00	0.01
994	600917	重庆燃气	2,900	15,718.00	0.01
995	600796	钱江生化	3,600	15,696.00	0.01
996	688432	有研硅	1,600	15,504.00	0.01
997	603466	风语筑	1,800	15,372.00	0.01
998	603818	曲美家居	5,500	15,345.00	0.01
999	300682	朗新集团	1,800	15,318.00	0.01
100 0	002541	鸿路钢构	900	15,273.00	0.01
100 1	601801	皖新传媒	2,200	15,246.00	0.01
100 2	002907	华森制药	1,200	15,144.00	0.01
100 3	000541	佛山照明	3,100	15,097.00	0.01
100 4	600410	华胜天成	3,900	15,093.00	0.01
100 5	603697	有友食品	2,600	15,080.00	0.01
100 6	002003	伟星股份	1,200	15,060.00	0.01
100 7	601677	明泰铝业	1,300	15,028.00	0.01
100 8	688147	微导纳米	600	14,940.00	0.01
100 9	688050	爱博医疗	200	14,664.00	0.01
101 0	600237	铜峰电子	2,800	14,616.00	0.01
101 1	600787	中储股份	3,000	14,430.00	0.01

101 2	300681	英搏尔	1,100	14,344.00	0.01
101 3	600522	中天科技	900	14,265.00	0.01
101 4	600745	闻泰科技	500	14,125.00	0.01
101 5	688378	奥来德	600	14,076.00	0.01
101 6	603369	今世缘	300	13,860.00	0.01
101 7	600885	宏发股份	500	13,840.00	0.01
101 8	003039	顺控发展	1,100	13,783.00	0.01
101 9	000932	华菱钢铁	3,100	13,733.00	0.01
102 0	600860	京城股份	1,700	13,719.00	0.01
102 1	300579	数字认证	700	13,650.00	0.01
102 2	002982	湘佳股份	900	13,572.00	0.01
102 3	002195	岩山科技	5,400	13,554.00	0.01
102 4	002028	思源电气	200	13,380.00	0.01
102 5	688297	中无人机	400	13,212.00	0.01
102 6	002707	众信旅游	2,300	13,202.00	0.01
102 7	300727	润禾材料	600	13,176.00	0.01
102 8	301188	力诺特玻	900	13,113.00	0.01
102 9	600676	交运股份	4,700	13,019.00	0.01

1030	002575	群兴玩具	2,900	12,760.00	0.01
1031	300614	百川畅银	1,400	12,726.00	0.01
1032	603680	今创集团	1,900	12,540.00	0.01
1033	605208	永茂泰	2,000	12,460.00	0.01
1034	603429	集友股份	2,900	12,035.00	0.01
1035	300434	金石亚药	1,600	12,000.00	0.01
1036	000713	丰乐种业	2,200	11,946.00	0.01
1037	600604	市北高新	3,400	11,764.00	0.01
1038	300136	信维通信	600	11,748.00	0.01
1039	301018	申菱环境	600	11,664.00	0.01
1040	002111	威海广泰	1,100	11,462.00	0.01
1041	600333	长春燃气	3,100	11,346.00	0.01
1042	688329	艾隆科技	762	11,323.32	0.01
1043	300087	荃银高科	1,800	11,124.00	0.01
1044	301345	涛涛车业	200	11,020.00	0.01
1045	688278	特宝生物	200	10,710.00	0.01
1046	301239	普瑞眼科	300	10,599.00	0.01
1047	688193	仁度生物	400	10,516.00	0.01

1048	000032	深桑达 A	700	10,486.00	0.01
1049	688700	东威科技	400	10,484.00	0.01
1050	600800	渤海化学	5,200	10,348.00	0.01
1051	002060	广东建工	3,000	10,260.00	0.01
1052	603883	老百姓	550	10,098.00	0.01
1053	002275	桂林三金	800	9,928.00	0.01
1054	601003	柳钢股份	3,900	9,867.00	0.01
1055	600491	龙元建设	3,600	9,864.00	0.01
1056	603158	腾龙股份	1,400	9,856.00	0.01
1057	301116	益客食品	1,100	9,823.00	0.01
1058	600820	隧道股份	1,500	9,795.00	0.01
1059	301157	华塑科技	300	9,780.00	0.01
1060	688213	思特威	200	9,700.00	0.01
1061	002469	三维化学	1,700	9,690.00	0.01
1062	301050	雷电微力	200	9,632.00	0.01
1063	688568	中科星图	200	9,540.00	0.01
1064	603197	保隆科技	300	9,450.00	0.01
1065	601615	明阳智能	1,000	9,440.00	0.01

106 6	000890	法尔胜	3,800	9,424.00	0.01
106 7	300048	合康新能	2,000	9,260.00	0.01
106 8	000661	长春高新	100	9,177.00	0.01
106 9	002058	威尔泰	1,200	9,120.00	0.01
107 0	603949	雪龙集团	800	9,008.00	0.01
107 1	600206	有研新材	1,000	8,900.00	0.01
107 2	000998	隆平高科	900	8,847.00	0.01
107 3	301171	易点天下	600	8,820.00	0.01
107 4	603565	中谷物流	1,000	8,740.00	0.01
107 5	300329	海伦钢琴	2,300	8,671.00	0.01
107 6	603008	喜临门	500	8,665.00	0.01
107 7	000735	罗牛山	2,000	8,660.00	0.01
107 8	300587	天铁股份	2,100	8,484.00	0.01
107 9	601872	招商轮船	1,000	8,450.00	0.01
108 0	603936	博敏电子	1,000	8,400.00	0.01
108 1	300687	赛意信息	600	8,352.00	0.01
108 2	603583	捷昌驱动	400	8,152.00	0.00
108 3	002859	洁美科技	400	8,032.00	0.00

108 4	000403	派林生物	300	7,998.00	0.00
108 5	002983	芯瑞达	480	7,992.00	0.00
108 6	300463	迈克生物	700	7,966.00	0.00
108 7	688189	南新制药	1,400	7,882.00	0.00
108 8	300869	康泰医学	600	7,842.00	0.00
108 9	300241	瑞丰光电	1,900	7,790.00	0.00
109 0	002782	可立克	700	7,756.00	0.00
109 1	600673	东阳光	1,100	7,744.00	0.00
109 2	688590	新致软件	600	7,740.00	0.00
109 3	002824	和胜股份	600	7,656.00	0.00
109 4	300377	赢时胜	1,500	7,620.00	0.00
109 5	002179	中航光电	200	7,610.00	0.00
109 6	300298	三诺生物	300	7,602.00	0.00
109 7	300709	精研科技	300	7,584.00	0.00
109 8	605006	山东玻纤	1,700	7,497.00	0.00
109 9	688139	海尔生物	200	7,440.00	0.00
110 0	000723	美锦能源	1,500	7,140.00	0.00
110 1	603186	华正新材	300	7,134.00	0.00

110 2	300257	开山股份	700	7,070.00	0.00
110 3	002158	汉钟精机	400	6,688.00	0.00
110 4	600602	云赛智联	600	6,624.00	0.00
110 5	300550	和仁科技	700	6,615.00	0.00
110 6	301149	隆华新材	700	6,468.00	0.00
110 7	601136	首创证券	300	6,138.00	0.00
110 8	688171	纬德信息	400	6,032.00	0.00
110 9	301248	杰创智能	400	6,028.00	0.00
111 0	002329	皇氏集团	2,200	5,962.00	0.00
111 1	600641	万业企业	500	5,875.00	0.00
111 2	603033	三维股份	500	5,850.00	0.00
111 3	688088	虹软科技	200	5,772.00	0.00
111 4	600486	扬农化工	100	5,645.00	0.00
111 5	001311	多利科技	230	5,561.40	0.00
111 6	601089	福元医药	400	5,540.00	0.00
111 7	002455	百川股份	600	5,508.00	0.00
111 8	688588	凌志软件	800	5,480.00	0.00
111 9	603612	索通发展	400	5,104.00	0.00

1120	600976	健民集团	100	5,050.00	0.00
1121	688116	天奈科技	200	4,616.00	0.00
1122	003021	兆威机电	100	4,615.00	0.00
1123	300663	科蓝软件	400	3,948.00	0.00
1124	688232	新点软件	200	3,944.00	0.00
1125	603381	永臻股份	93	2,337.09	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	3,687,085.00	2.25
2	300750	宁德时代	1,838,271.00	1.12
3	601318	中国平安	1,729,386.00	1.05
4	600900	长江电力	1,417,484.00	0.86
5	000651	格力电器	1,261,740.00	0.77
6	600036	招商银行	1,191,234.00	0.73
7	000333	美的集团	1,155,850.00	0.70
8	000725	京东方A	1,144,462.00	0.70
9	600887	伊利股份	1,049,095.00	0.64
10	300760	迈瑞医疗	972,736.00	0.59
11	601398	工商银行	965,695.00	0.59
12	601328	交通银行	952,214.00	0.58
13	000338	潍柴动力	951,833.00	0.58
14	000858	五粮液	890,255.00	0.54

15	601919	中远海控	882,533.00	0.54
16	601211	国泰君安	860,982.00	0.52
17	603501	韦尔股份	855,036.00	0.52
18	601138	工业富联	852,996.00	0.52
19	601899	紫金矿业	839,698.00	0.51
20	601166	兴业银行	830,156.00	0.51

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	552,862.00	0.34
2	600900	长江电力	547,891.00	0.33
3	600519	贵州茅台	512,753.00	0.31
4	600919	江苏银行	512,383.00	0.31
5	601939	建设银行	505,980.00	0.31
6	002371	北方华创	497,861.00	0.30
7	000651	格力电器	492,503.00	0.30
8	601186	中国铁建	488,605.00	0.30
9	603501	韦尔股份	474,413.00	0.29
10	600183	生益科技	445,467.00	0.27
11	001979	招商蛇口	445,090.00	0.27
12	601628	中国人寿	443,430.00	0.27
13	002938	鹏鼎控股	425,384.00	0.26
14	603256	宏和科技	417,441.00	0.25
15	601800	中国交建	407,532.00	0.25
16	601398	工商银行	405,495.00	0.25
17	002773	康弘药业	403,590.00	0.25
18	601857	中国石油	403,317.00	0.25
19	601225	陕西煤业	403,170.00	0.25

20	601766	中国中车	402,006.00	0.24
----	--------	------	------------	------

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	256,686,937.62
卖出股票收入（成交）总额	138,286,962.77

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	4,000.30	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,000.30	0.00

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	113685	升24转债	40	4,000.30	0.00

注：本基金本报告期末仅持有一只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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招商银行（证券代码：600036）、交通银行（证券代码：601328）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06月24日，招商银行（证券代码：600036）发行人招商银行股份有限公司因未能有效穿透识别底层资产、信息披露不规范被国家金融监督管理总局罚款350万元。

2023年12月13日，招商银行（证券代码：600036）发行人招商银行股份有限公司因未按规定承担小微企业押品评估费、未按规定承担房屋抵押登记费、未落实价格目录、向小微企业收取委托贷款手续费、小微企业规模划型依据不足被国家金融监督管理总局深圳监管局罚款160万元。

2024年06月03日，交通银行（证券代码：601328）发行人交通银行股份有限公司因安全测试存在薄弱环节、运行管理存在漏洞、数据安全不足、灾备管理不足被国家金融监督管理总局罚款160万元。

2023年08月08日，交通银行（证券代码：601328）发行人交通银行股份有限公司因贷后管理不到位严重违反审慎经营规则被国家金融监督管理总局商丘监管分局罚款25万元。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	84,578.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,578.06

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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。

58 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
泓德智选启航混合A	2,503	41,154.73	10,003,941.11	9.71%	93,006,342.79	90.29%
泓德智选启航混合C	1,688	38,416.98	632,077.37	0.97%	64,215,782.03	99.03%
合计	4,156	40,389.35	10,636,018.48	6.34%	157,222,124.82	93.66%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	泓德智选启航混合A	197.65	0.00%
	泓德智选启航混合C	281,000.28	0.43%
	合计	281,197.93	0.17%

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区
----	------	--------------

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	泓德智选启航混合 A	0
	泓德智选启航混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	泓德智选启航混合 A	0
	泓德智选启航混合 C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	泓德智选启航混合A	泓德智选启航混合C
基金合同生效日(2024年03月19 日)基金份额总额	128,991,605.26	91,469,558.47
基金合同生效日起至报告期期末 基金总申购份额	147,732.90	206,368.52
减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	26,129,054.26	26,828,067.59
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	103,010,283.90	64,847,859.40

§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，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中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	
恒泰证券	2	305,529,046.92	77.37%	217,010.67	77.10%	-

东莞证券	2	89,384,707.41	22.63%	64,470.58	22.90%	-
长江证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金采用券商结算模式，本报告期内管理人选择长江证券、恒泰证券、东莞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。

5、交易佣金包含已由证券经纪商扣收的相关交易费用。本基金本报告期内未租用其他证券公司交易单元进行证券投资。

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
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	泓德智选启航混合型证券投资基金基金份额发售公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-31

2	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启航混合型证券投资基金增加中信建投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	2024-03-01
3	泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同生效公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-03-20
4	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
5	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启航混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-17
6	泓德基金管理有限公司关于泓德智选启航混合型证券投资基金增加申万宏源证券有限公司等机构为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

§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

本基金本报告期间无单一投资者持有基金份额比例达到或者超过20%的情况。

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智选启航混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《泓德智选启航混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《泓德智选启航混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德智选启航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