

# 中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券 投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金的基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和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 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>49</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
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.....	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
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.....	67
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.....	67
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.....	67
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.....	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	68
7.12 投资组合报告附注.....	68
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>69</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
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的情况.....	69
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>70</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>71</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	73
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>74</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	74

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>75</b>
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金	
基金简称	中航量化阿尔法六个月持有	
基金主代码	011934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 25 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	323,069,968.46 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
下属分级基金的交易代码:	011934	011935
报告期末下属分级基金的份额总额	83,387,354.48 份	239,682,613.98 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	<ul style="list-style-type: none"> <li>(一) 资产配置策略</li> <li>(二) 股票投资策略：(1) 多因子模型 (2) 事件驱动模型</li> <li>(三) 债券投资策略</li> <li>(四) 股指期货投资策略</li> <li>(五) 国债期货投资策略</li> <li>(六) 资产支持证券投资策略</li> <li>(七) 存托凭证投资策略</li> <li>(八) 可转换债券及可交换债券投资策略</li> </ul>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

### 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	中航基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	武国强
	联系电话	010-56716188
	电子邮箱	wuguoqiang@avicfund.cn
客户服务电话	400-666-2186	95555
传真	010-56716198	0755-83195201

注册地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院 1 号楼 1 层 101 内 10 层 B1001 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号北京亚洲金融大厦 B 座 1001、1007、1008 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	杨彦伟	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中航基金管理有限公司	北京市朝阳区天辰东路 1 号北京亚洲金融大厦 B 座 1001、1007、1008 单元

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)	报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日)
本期已实现收益	-7,089,338.07	-20,649,094.58
本期利润	-3,663,310.10	-10,381,786.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0420	-0.0420
本期加权平均净值利润率	-4.67%	-4.69%
本期基金份额净值增长率	-3.46%	-3.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末可供分配利润	-8,358,894.00	-25,095,889.64
期末可供分配基金份额利润	-0.1002	-0.1047
期末基金资产净值	79,692,200.11	227,900,144.70
期末基金份额净值	0.9557	0.9508
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-4.43%	-4.92%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中航量化阿尔法六个月持有 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	9.17%	1.12%	6.02%	0.94%	3.15%	0.18%
过去三个月	7.19%	1.63%	2.01%	1.48%	5.18%	0.15%
过去六个月	-3.46%	1.49%	-10.13%	1.38%	6.67%	0.11%
自基金合同生效起至今	-4.43%	1.27%	-7.01%	1.17%	2.58%	0.10%

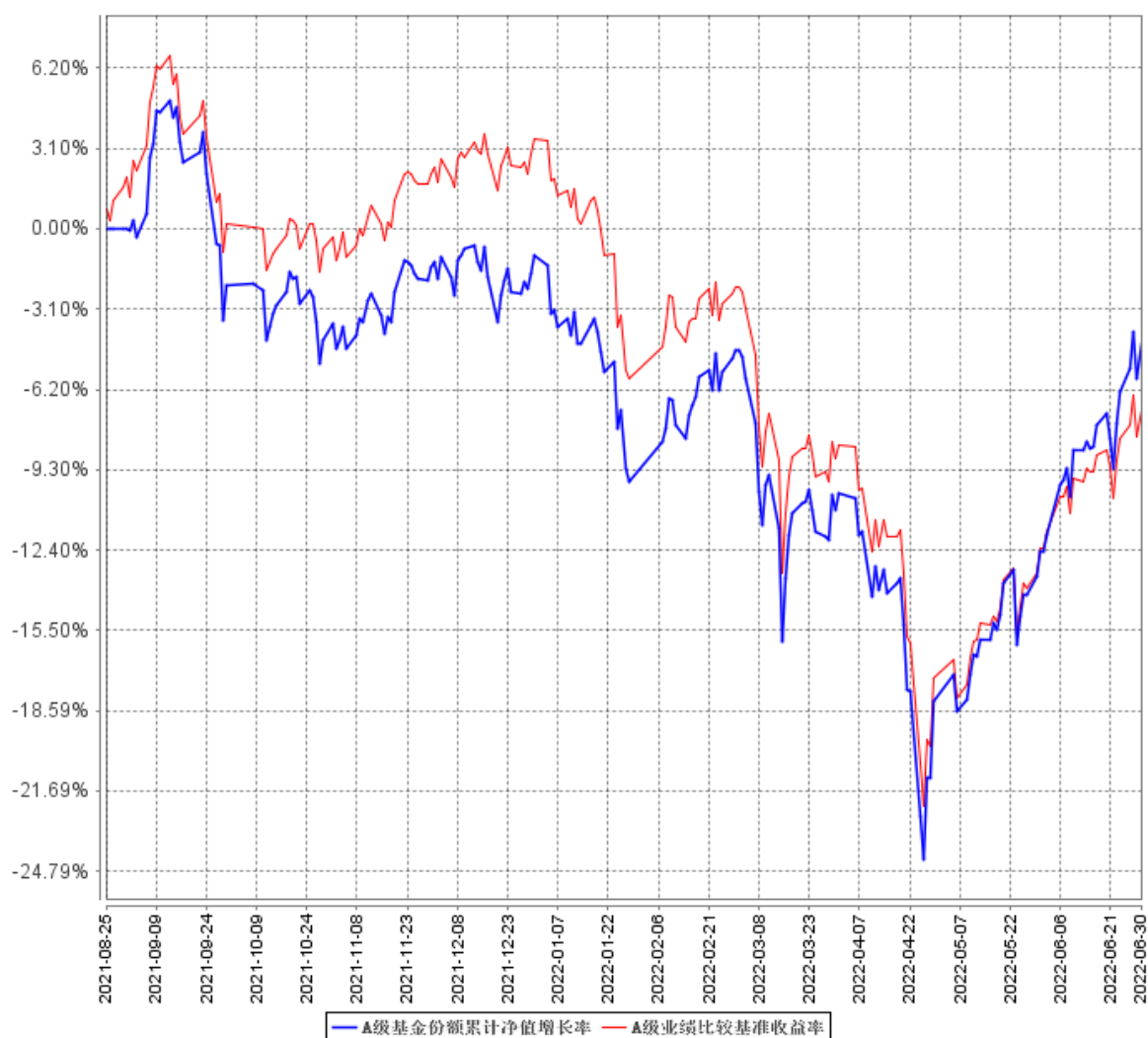


中航量化阿尔法六个月持有 C

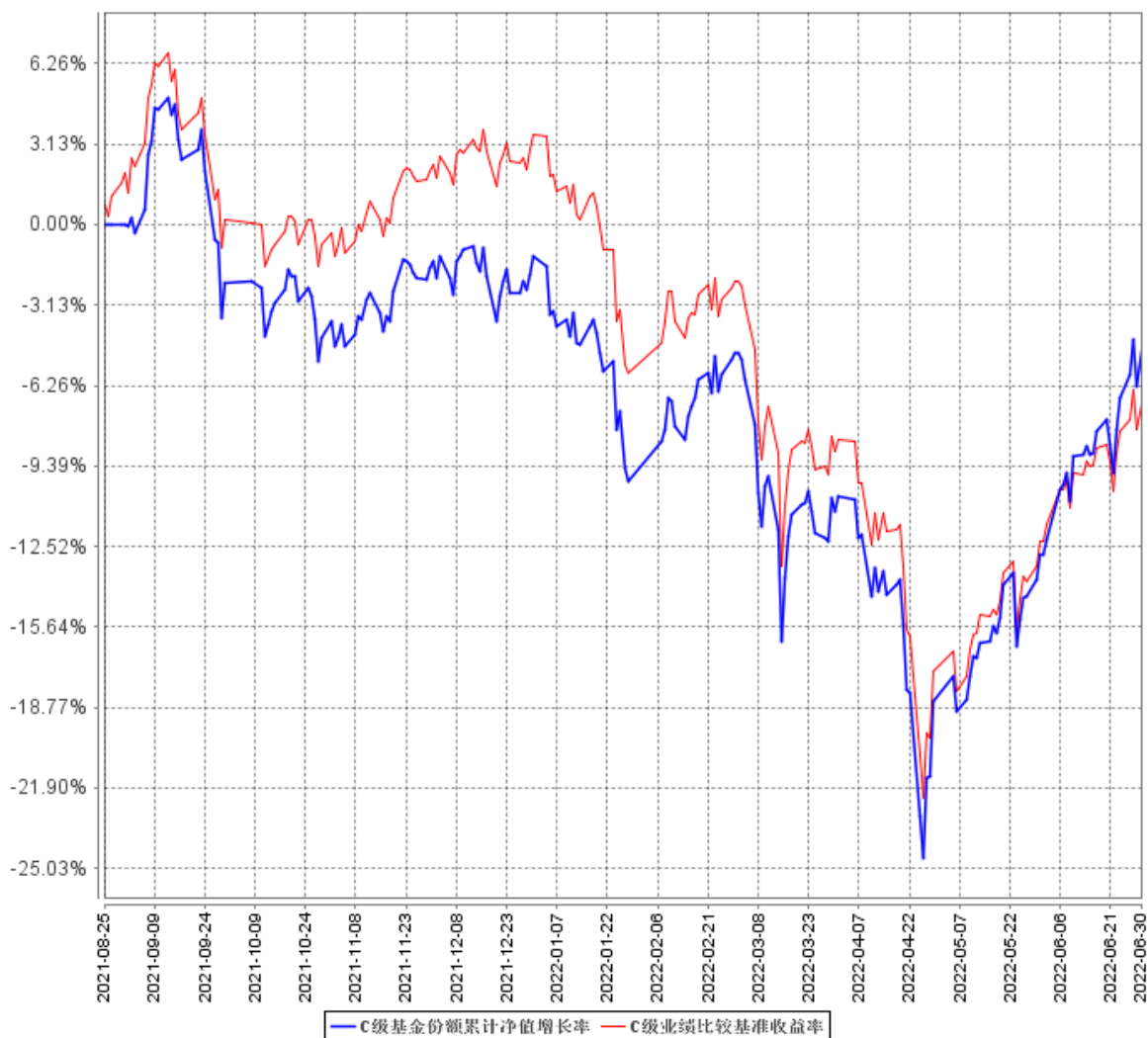
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	9.11%	1.12%	6.02%	0.94%	3.09%	0.18%
过去三个月	7.02%	1.62%	2.01%	1.48%	5.01%	0.14%
过去六个月	-3.76%	1.49%	-10.13%	1.38%	6.37%	0.11%
自基金合同生效起至今	-4.92%	1.27%	-7.01%	1.17%	2.09%	0.10%

### 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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同于 2021 年 8 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。  
 2. 按基金合同和招募说明书的约定，本基金的建仓期为六个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同的有关规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中航基金管理有限公司成立于 2016 年 6 月 16 日，是经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1249 号文许可批准设立、为客户提供专业基金管理服务的全国性基金管理公司。公司总部设在北京，注册资本为 30,000 万元人民币，经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	基金经理	2021 年 8 月 25 日	-	11	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部负责人，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。
杨扬	基金经理	2021 年 9 月 16 日	-	11	硕士研究生，具有 10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于上海东方证券资产管理有限公司担任研究员、投资助理、安信基金管理有限责任公司先后担任投资经理助理、投资经理、基金经理助理、基金经理。2020

					年 2 月加入中航基金管理有限公司，现担任量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，宏观环境复杂多变，海外地缘政治冲突升级、流动性加速紧缩，国内则受到疫情蔓延超预期等因素影响，市场经历大幅震荡，以 4 月底为一个显著的分水岭：1-4 月，市场连

续下跌，稳增长、低估值板块相对占优；5-6 月，随着疫情改善、经济基本面企稳，市场大幅反弹，风格亦随之发生显著反转，高景气成长板块反弹幅度领先。整个上半年，沪深主要宽基指数中，沪深 300 下跌-9.22%，中证 500 下跌-12.30%，创业板指下跌-15.41%。

本报告期内，本基金在严格遵守基金合同约定的前提下，通过量化阿尔法模型进行选股，自下而上挖掘个股阿尔法，获得较为稳健的超额收益，基金净值跑赢业绩基准。另一方面，本基金通过风险模型对风险暴露进行了较为谨慎的约束，因此上半年受市场风格切换的影响较小。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值为 0.9557 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.46%；截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值为 0.9508 元，本报告期基金份额净值增长率为-3.76%；同期业绩比较基准收益率为-10.13%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场或从 4 月底以来的单边修复期进入震荡期，但我们认为对 A 股市场不宜悲观。一方面，下半年国内经济驱动力有望边际回升，企业盈利环比有望明显改善；另一方面，A 股当前整体估值仍处于较为合理的区间，尤其是以中证 500 为代表的中盘股，目前相对估值仍处于历史偏低水平，仍具有较好的性价比。投资策略上，我们将综合考虑行业的景气度、公司业绩的确定性及估值的合理性，自下而上精选个股，同时对投资组合整体风险暴露进行密切监控，力争为投资者创造长期稳健的超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

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

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

无

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	30,407,343.35	34,347,072.29
结算备付金		1,262,003.11	2,033,382.80
存出保证金		59,048.44	93,769.31
交易性金融资产	6.4.7.2	277,958,725.94	309,585,208.97
其中：股票投资		277,958,725.94	309,585,208.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		234,632.39	975,340.87
应收股利		-	-
应收申购款		10.00	22,709.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	4,540.20
资产总计		309,921,763.23	347,062,024.37
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		748,030.18	1,734,838.38



应付赎回款		126,249.53	-
应付管理人报酬		363,553.78	433,734.70
应付托管费		60,592.30	72,289.14
应付销售服务费		107,761.42	127,610.27
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	923,231.21	1,802,228.41
负债合计		2,329,418.42	4,170,700.90
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	323,069,968.46	346,894,590.56
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-15,477,623.65	-4,003,267.09
净资产合计		307,592,344.81	342,891,323.47
负债和净资产总计		309,921,763.23	347,062,024.37

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值 0.9557 元，基金份额总额 83,387,354.48 份；中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值 0.9508 元，基金份额总额 239,682,613.98 份。中航量化阿尔法六个月持有份额总额合计为 323,069,968.46 份。

②本基金基金合同于 2021 年 8 月 25 日生效，无可比期间数据，下同。

③以上比较财务信息已根据最新的《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-10,703,430.33
1.利息收入		63,353.43
其中：存款利息收入	6.4.7.13	63,353.43
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-24,460,119.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-27,561,499.42
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	3,101,379.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	13,693,335.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,341,666.35</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,232,519.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	372,086.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	659,341.68
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	77,718.21
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-14,045,096.68</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-14,045,096.68</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-14,045,096.68</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-14,045,096.68</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产 (基金净值)	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-23,824,622.10	-	-11,474,356.56	-35,298,978.66
(一)、综合收益总额	-	-	-14,045,096.68	-14,045,096.68
(二)、本期基金份额 交易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-23,824,622.10	-	2,570,740.12	-21,253,881.98
其中: 1.基金申购款	634,365.14	-	-71,918.00	562,447.14
2.基金赎回款	-24,458,987.24	-	2,642,658.12	-21,816,329.12
(三)、本期向基金份 额持有人分配利润产 生的基金净值变动(净 值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	323,069,968.46	-	-15,477,623.65	307,592,344.81

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:

_____ 刘建 _____	_____ 裴荣荣 _____	_____ 韩丹 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2021]857号文《关于准予中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金注册的批复》,由中航基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)等规定公开募集。经向中国证监会备案,于2021年8月25日募集成立。本基金的基金管理人为中航基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。基金合同生效日总计认购户数 2,779 户，确认的有效认购金额为 329,106,493.46 元，实收基金份额为 329,173,593.39 份（含利息转份额 67,099.93 份）。其中：A 类份额认购户数 985 户，确认的有效认购金额为 74,890,736.46 元，实收基金份额为 74,904,100.76 份（含利息转份额 13,364.30 份）；C 类份额认购户数 1,794 户，确认的有效认购金额为 254,215,757.00 元，实收基金份额为 254,269,492.63 份（含利息转份额 53,735.63 份）；本基金募集资金经天职会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、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、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、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的相关规定。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号—半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度和中期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本报告期本基金所采用的会计政策与最近一期年度报告不一致，会计估计与最近一期年度报

告相一致。

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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。

基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单、资产支持证券和衍生工具等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

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。

#### 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和金融负债，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。

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。

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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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；(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、资产支持证券和衍生工具(主要为权证投资)等按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1)对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种,在估值日有报价的,除会计准则规定的例外情况外,应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)对不存在活跃市场的投资品种,应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。采用估值技术确定公允价值时,应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证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的,基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定,按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的,按其规定进行估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 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、资产支持证券、同业存单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按直线法近似计算。

#### 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按直线法近似计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配，每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的持有期，按原份额的持有期计算；



3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.12 分部报告

无。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

### 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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产科目及账面价值：银行存款金额 34,347,072.29 元、结算备付金金额 2,033,382.80 元、存出保证金金额 93,769.31 元、应收利息金额 4,540.20 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产科目及账面价值调整为：银行存款金额 34,350,559.57 元、结算备付金金额 2,034,389.30 元、存出保证金金额 93,815.73 元、应收利息金额 0.00 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债科目及账面价值：应付交易费用金额

1,665,228.41 元、其他负债金额 137,000.00 元。新金融工具准则下金融负债科目及账面价值调整为：应付交易费用金额 0.00 元、其他负债金额 1,802,228.41 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无需要说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 04 月 23 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；

2. 基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；

3. 对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税；

4. 存款利息收入不征收增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；

5. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

6. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

7. 对基金取得的企业债券利息收入，由各兑付机构在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；

8. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	30,407,343.35
等于：本金	30,404,492.50
加：应计利息	2,850.85
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：	30,407,343.35

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	260,851,034.03	-	277,958,725.94	17,107,691.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	260,851,034.03	-	277,958,725.94	17,107,691.91

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末本基金未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

本报告期本基金未计提减值准备。

**6.4.7.5 债权投资****6.4.7.5.1 债权投资情况**

本报告期末本基金未持有债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

**6.4.7.6 其他债权投资****6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本报告期末本基金未持有其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

**6.4.7.7 其他权益工具投资****6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

本报告期末本基金未持有其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	850,335.27
其中：交易所市场	850,335.27
银行间市场	-
-	-

应付利息	-
预提费用	72,895.94
合计	923,231.21

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费。

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	91,643,376.51	91,643,376.51
本期申购	335,029.14	335,029.14
本期赎回(以“-”号填列)	-8,591,051.17	-8,591,051.17
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	83,387,354.48	83,387,354.48

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	255,251,214.05	255,251,214.05
本期申购	299,336.00	299,336.00
本期赎回(以“-”号填列)	-15,867,936.07	-15,867,936.07
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	239,682,613.98	239,682,613.98

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-1,756,059.79	838,880.95	-917,178.84
本期利润	-7,089,338.07	3,426,027.97	-3,663,310.10
本期基金份额交易产生的变动数	486,503.86	398,830.71	885,334.57
其中：基金申购款	-14,577.86	-22,400.89	-36,978.75
基金赎回款	501,081.72	421,231.60	922,313.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,358,894.00	4,663,739.63	-3,695,154.37

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-5,415,572.35	2,329,484.10	-3,086,088.25
本期利润	-20,649,094.58	10,267,308.00	-10,381,786.58
本期基金份额交易产生的变动数	968,777.29	716,628.26	1,685,405.55
其中：基金申购款	-23,974.42	-10,964.83	-34,939.25
基金赎回款	992,751.71	727,593.09	1,720,344.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,095,889.64	13,313,420.36	-11,782,469.28

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,419.17
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	14,049.52
其他	884.74
合计	63,353.43

注：其他包括结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,167,794,958.51
减：卖出股票成本总额	1,192,278,439.56
减：交易费用	3,078,018.37
买卖股票差价收入	-27,561,499.42

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期本基金无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

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

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期本基金无贵金属投资收益。



**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本报告期本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本报告期本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本报告期本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

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

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本报告期本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,101,379.69
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	3,101,379.69

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	13,693,335.97
——股票投资	13,693,335.97
——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	13,693,335.97

#### 6.4.7.21 其他收入

本报告期本基金无其他收入。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本报告期本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	13,388.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行划款费	4,822.27
合计	77,718.21

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中航基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金代销机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中航证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中航证券有限公司	745,665,068.94	32.42%

**6.4.10.1.2 债券交易**

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
中航证券有限公司	545,302.92	32.42%	-	-

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

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
----	----------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	2,232,519.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,092,218.29

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计算。

管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50 \div \text{当年天数}$$

H 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	372,086.63

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。

托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	合计
招商银行股份有限公司	-	640,960.93	640,960.93
中航基金管理有限公司	-	26.78	26.78
中航证券有限公司	-	16,484.39	16,484.39

合计	-	657,472.10	657,472.10
----	---	------------	------------

注：①计提标准：本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60% 年费率计提。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：C 类基金份额销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同约定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期本基金无转融通证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期本基金无转融通证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	31,728,394.90	63,353.43

注：包括活期存款，存在托管银行的定期存款，基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司的证券交易结算资金，即结算备付金、交易保证金。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

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

#### 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
688322	奥比中光	2022年6月30日	5个交易日	新股流通受限	30.99	30.99	5,511	170,785.89	170,785.89	-
301139	元道通信	2022年6月30日	6个交易日	新股流通受限	38.46	38.46	3,843	147,801.78	147,801.78	-
301175	中科环保	2022年6月30日	6个交易日	新股流通受限	3.82	3.82	34,341	131,182.62	131,182.62	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	9个交易日	新股流通受限	33.65	33.65	3,640	122,486.00	122,486.00	-
688400	凌云光	2022年6月27日	7个交易日	新股流通受限	21.93	21.93	5,470	119,957.10	119,957.10	-
301233	盛帮股份	2022年6月24日	8个交易日	新股流通受限	41.52	41.52	1,576	65,435.52	65,435.52	-
600938	中国海油	2022年4月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	10.80	16.16	84,004	907,243.20	1,357,504.64	-
688150	莱特光电	2022年3月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	22.05	19.58	5,466	120,525.30	107,024.28	-
688225	亚信安全	2022年1月26日	1-6个月(含)	网下配售锁定	30.51	20.95	4,028	122,894.28	84,386.60	-
301238	瑞泰新材	2022年6月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	19.18	35.45	834	15,996.12	29,565.30	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	1-6个月(含)	网下配售锁定	26.86	50.36	517	13,886.62	26,036.12	-
301215	中汽	2022年2月	1-6个月(含)	网下配售	3.80	6.39	3,926	14,918.80	25,087.14	-

	股份	月 28 日	月(含)	售锁定							
301112	信邦智能	2022 年 6 月 20 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	27.53	51.79	399	10,984.47	20,664.21	-	
301263	泰恩康	2022 年 3 月 22 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	19.93	31.38	581	11,579.33	18,231.78	-	
301153	中科江南	2022 年 5 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	33.68	46.70	368	12,394.24	17,185.60	-	
301286	侨源股份	2022 年 6 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	16.91	21.57	784	13,257.44	16,910.88	-	
301120	新特电气	2022 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	13.73	16.01	1,032	14,169.36	16,522.32	-	
301187	欧圣电气	2022 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	21.33	22.90	713	15,208.29	16,327.70	-	
301201	诚达药业	2022 年 1 月 12 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	72.69	71.48	227	16,500.63	16,225.96	-	
301160	翔楼新材	2022 年 5 月 25 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	31.56	40.52	392	12,371.52	15,883.84	-	
301235	华康医疗	2022 年 1 月 21 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	39.30	37.90	418	16,427.40	15,842.20	-	
301217	铜冠铜箔	2022 年 1 月 20 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	17.27	14.82	1,063	18,358.01	15,753.66	-	
301302	华如科技	2022 年 6 月 16 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	52.03	58.00	270	14,048.10	15,660.00	-	
301298	东利机械	2022 年 5 月 27 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	12.68	23.59	634	8,039.12	14,956.06	-	
301256	华融化学	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	8.05	10.08	1,469	11,825.45	14,807.52	-	
301117	佳缘科技	2022 年 1 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	46.80	54.38	262	12,261.60	14,247.56	-	
301212	联盛化学	2022 年 4 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	29.67	33.88	416	12,342.72	14,094.08	-	
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	28.50	34.91	389	11,086.50	13,579.99	-	
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	48.59	31.38	426	20,697.92	13,367.88	-	锁定期送股
301259	艾布鲁	2022 年 4 月 18 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	18.39	25.84	483	8,882.37	12,480.72	-	
301248	杰创智能	2022 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	39.07	29.97	413	16,135.91	12,377.61	-	
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	23.22	16.22	763	17,718.29	12,375.86	-	锁定期送股
301103	何氏眼科	2022 年 3 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	32.69	32.03	377	12,325.00	12,075.31	-	锁定期送股

301116	益客食品	2022年1月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	11.40	20.44	577	6,577.80	11,793.88	-
301220	亚香股份	2022年6月15日	1-6个月(含)	网下配售锁定	35.98	40.71	285	10,254.30	11,602.35	-
301200	大族数控	2022年2月18日	1-6个月(含)	网下配售锁定	76.56	51.87	223	17,072.88	11,567.01	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	56.88	56.40	201	11,432.88	11,336.40	-
301206	三元生物	2022年1月26日	1-6个月(含)	网下配售锁定	73.02	45.67	244	17,815.90	11,143.48	锁定期送股
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	1-6个月(含)	网下配售锁定	39.88	31.09	358	14,277.04	11,130.22	-
301150	中一科技	2022年4月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	109.04	84.91	129	14,066.16	10,953.39	锁定期送股
301216	万凯新材	2022年3月21日	1-6个月(含)	网下配售锁定	35.68	29.84	360	12,844.80	10,742.40	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	38.39	23.97	438	16,814.82	10,498.86	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301288	清研环境	2022年4月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	19.09	21.88	452	8,628.68	9,889.76	-
301125	腾亚精工	2022年5月27日	1-6个月(含)	网下配售锁定	22.49	29.48	327	7,354.23	9,639.96	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	1-6个月(含)	网下配售锁定	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	1-6个月(含)	网下配售锁定	56.69	41.87	222	12,585.18	9,295.14	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	1-6个月(含)	网下配售锁定	26.27	32.71	277	7,276.79	9,060.67	-
301130	西点药业	2022年2月16日	1-6个月(含)	网下配售锁定	22.55	37.67	237	5,344.35	8,927.79	-
301258	富士莱	2022年3月21日	1-6个月(含)	网下配售锁定	48.30	41.69	214	10,336.20	8,921.66	-
301135	瑞德智能	2022年4月1日	1-6个月(含)	网下配售锁定	31.98	26.29	338	10,809.24	8,886.02	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	96.46	87.86	101	9,742.88	8,873.86	锁定期送股
301151	冠龙节能	2022年3月30日	1-6个月(含)	网下配售锁定	30.82	21.50	384	11,834.88	8,256.00	-
301123	奕东电子	2022年1月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	37.23	25.37	324	12,062.52	8,219.88	-
301181	标榜	2022年2月	1-6个月	网下配	40.25	30.58	257	10,344.25	7,859.06	-



	股份	月 11 日	月(含)	售锁定						
301158	德石股份	2022 年 1 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	15.64	20.36	379	5,927.56	7,716.44	-
301110	青木股份	2022 年 3 月 4 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	63.10	39.85	176	11,105.60	7,013.60	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	31.20	23.04	296	9,235.20	6,819.84	-
300834	星辉环材	2022 年 1 月 6 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	55.57	30.01	221	12,280.97	6,632.21	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	64.08	37.50	128	8,202.24	4,800.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002411	*ST 必康	2022 年 5 月 5 日	临时停牌	6.55	2022 年 7 月 1 日	6.22	26,100	203,426.49	170,955.00	-
002670	国盛金控	2022 年 6 月 1 日	临时停牌	9.60	2022 年 7 月 14 日	9.99	13,200	115,200.30	126,720.00	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目的是在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增长的投资目标。

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

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

基金的银行存款存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险事件发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对

交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本报告期末，本基金未持有债券、资产支持证券及同业存单。

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

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

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

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

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放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约定了巨额赎回条款，明确了在特殊情况下赎回申请的处理方式，控制因发生巨额赎回等带来的流动性风险，维护基金运作稳健，有效保障基金份额持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，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(所有者权益)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。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持证券均在证券交易所或银行间市场上市，部分股票资产流通暂时受限无法自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过债券回购业务借入短期资金应对流动性需求，债券正回购资金余额不超过基金持有债券资产的公允价值，且不超过基金资产净值的 40%。基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度，根据质押品的资质确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额，并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	30,407,343.35	-	-	-	-	-	30,407,343.35
结算备付金	1,262,003.11	-	-	-	-	-	1,262,003.11
存出保证金	59,048.44	-	-	-	-	0.00	59,048.44
交易性金融资产	-	-	-	-	-	277,958,725.94	277,958,725.94
应收证券清算款	-	-	-	-	-	234,632.39	234,632.39
应收申购款	-	-	-	-	-	10.00	10.00
资产总计	31,728,394.90	-	-	-	-	278,193,368.33	309,921,763.23
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	748,030.18	748,030.18
应付赎回款	-	-	-	-	-	126,249.53	126,249.53
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	363,553.78	363,553.78
应付托管费	-	-	-	-	-	60,592.30	60,592.30

应付销售服务费						107,761.42	107,761.42
其他负债						923,231.21	923,231.21
负债总计						2,329,418.42	2,329,418.42
利率敏感度缺口	31,728,394.90					-275,863,949.91	307,592,344.81
上年度末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	34,347,072.29						34,347,072.29
结算备付金	2,033,382.80						2,033,382.80
存出保证金	93,769.31						93,769.31
交易性金融资产						-309,585,208.97	309,585,208.97
应收证券清算款						975,340.87	975,340.87
其他资产						4,540.20	4,540.20
应收申购款						22,709.93	22,709.93
资产总计	36,474,224.40					-310,587,799.97	347,062,024.37
负债							
应付证券清算款						1,734,838.38	1,734,838.38
应付管理人报酬						433,734.70	433,734.70
应付托管费						72,289.14	72,289.14
应付销售服务费						127,610.27	127,610.27
其他负债						1,802,228.41	1,802,228.41
负债总计						4,170,700.90	4,170,700.90
利率敏感度缺口	36,474,224.40					-306,417,099.07	342,891,323.47

注：以上比较信息已根据最新的《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〉》中的格式要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，若市场利率上升或者下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	277,958,725.94	90.37	309,585,208.97	90.29
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	277,958,725.94	90.37	309,585,208.97	90.29

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	16,404,785.65	18,286,523.43
业绩比较基准下降5%	-16,404,785.65	-18,286,523.43	

#### 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	275,000,410.05	308,384,198.00
第二层次	2,958,315.89	1,201,010.97
第三层次	-	-
合计	277,958,725.94	309,585,208.97

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	277,958,725.94	89.69
	其中：股票	277,958,725.94	89.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	31,669,346.46	10.22
8	其他各项资产	293,690.83	0.09
9	合计	309,921,763.23	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	2,543,561.00	0.83
B	采矿业	12,372,816.64	4.02
C	制造业	187,161,169.20	60.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,293,452.00	1.72
E	建筑业	3,293,905.00	1.07
F	批发和零售业	7,564,166.93	2.46
G	交通运输、仓储和邮政业	6,577,354.74	2.14
H	住宿和餐饮业	310,000.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,033,851.98	4.89
J	金融业	18,585,373.67	6.04
K	房地产业	5,618,249.00	1.83
L	租赁和商务服务业	2,816,697.22	0.92
M	科学研究和技术服务业	40,929.34	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	2,268,005.91	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	235,960.00	0.08

Q	卫生和社会工作	3,869,479.31	1.26
R	文化、体育和娱乐业	3,452,616.00	1.12
S	综合	921,138.00	0.30
	合计	277,958,725.94	90.37

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	600392	盛和资源	152,500	3,446,500.00	1.12
2	600256	广汇能源	312,200	3,290,588.00	1.07
3	600111	北方稀土	92,900	3,266,364.00	1.06
4	600486	扬农化工	19,400	2,585,632.00	0.84
5	300244	迪安诊断	81,400	2,531,540.00	0.82
6	000960	锡业股份	150,600	2,525,562.00	0.82
7	300390	天华超净	28,400	2,482,160.00	0.81
8	300750	宁德时代	4,600	2,456,400.00	0.80
9	002497	雅化集团	74,300	2,425,895.00	0.79
10	688122	西部超导	25,919	2,389,731.80	0.78
11	300482	万孚生物	58,400	2,377,464.00	0.77
12	002756	永兴材料	15,600	2,374,476.00	0.77
13	601615	明阳智能	69,700	2,355,860.00	0.77
14	688099	晶晨股份	22,602	2,282,802.00	0.74
15	300769	德方纳米	5,500	2,247,740.00	0.73
16	600079	人福医药	139,500	2,232,000.00	0.73
17	603198	迎驾贡酒	33,300	2,169,162.00	0.71
18	002508	老板电器	59,400	2,140,182.00	0.70
19	600141	兴发集团	45,100	1,983,949.00	0.64
20	002240	盛新锂能	32,200	1,943,592.00	0.63
21	603486	科沃斯	15,700	1,913,673.00	0.62
22	601012	隆基绿能	28,660	1,909,615.80	0.62
23	002271	东方雨虹	36,800	1,894,096.00	0.62
24	300037	新宙邦	34,780	1,828,036.80	0.59
25	000937	冀中能源	245,000	1,827,700.00	0.59
26	000519	中兵红箭	61,600	1,795,640.00	0.58

27	000970	中科三环	94,600	1,776,588.00	0.58
28	603077	和邦生物	406,600	1,732,116.00	0.56
29	600867	通化东宝	166,500	1,721,610.00	0.56
30	600648	外高桥	123,700	1,682,320.00	0.55
31	000629	攀钢钒钛	439,700	1,670,860.00	0.54
32	002407	多氟多	33,600	1,643,376.00	0.53
33	002396	星网锐捷	72,060	1,631,438.40	0.53
34	002985	北摩高科	27,758	1,626,063.64	0.53
35	002056	横店东磁	60,400	1,607,848.00	0.52
36	600704	物产中大	310,400	1,592,352.00	0.52
37	688005	容百科技	12,191	1,578,003.04	0.51
38	000402	金融街	264,700	1,574,965.00	0.51
39	000983	山西焦煤	117,100	1,567,969.00	0.51
40	603456	九洲药业	28,600	1,478,620.00	0.48
41	600096	云天化	46,900	1,476,412.00	0.48
42	000733	振华科技	10,800	1,468,476.00	0.48
43	002738	中矿资源	15,620	1,446,568.20	0.47
44	002326	永太科技	43,800	1,442,334.00	0.47
45	600233	圆通速递	69,592	1,418,980.88	0.46
46	600901	江苏租赁	275,500	1,413,315.00	0.46
47	603613	国联股份	15,925	1,410,955.00	0.46
48	300777	中简科技	28,600	1,378,520.00	0.45
49	000999	华润三九	30,600	1,377,000.00	0.45
50	002850	科达利	8,600	1,367,400.00	0.44
51	002797	第一创业	213,200	1,366,612.00	0.44
52	000831	五矿稀土	43,700	1,365,625.00	0.44
53	600566	济川药业	50,000	1,358,000.00	0.44
54	600938	中国海油	84,004	1,357,504.64	0.44
55	300363	博腾股份	17,300	1,349,227.00	0.44
56	600415	小商品城	242,100	1,348,497.00	0.44
57	601456	国联证券	109,900	1,348,473.00	0.44
58	600499	科达制造	64,600	1,333,344.00	0.43
59	600325	华发股份	176,100	1,333,077.00	0.43
60	600177	雅戈尔	201,000	1,332,630.00	0.43
61	601696	中银证券	99,600	1,324,680.00	0.43
62	300182	捷成股份	239,800	1,318,900.00	0.43
63	603267	鸿远电子	9,600	1,289,568.00	0.42
64	300059	东方财富	49,000	1,244,600.00	0.40
65	600030	中信证券	56,900	1,232,454.00	0.40

66	600787	中储股份	212,300	1,207,987.00	0.39
67	000878	云南铜业	105,200	1,198,228.00	0.39
68	000987	越秀金控	169,989	1,195,022.67	0.39
69	600456	宝钛股份	20,100	1,193,940.00	0.39
70	002268	卫士通	27,400	1,175,734.00	0.38
71	002191	劲嘉股份	106,700	1,143,824.00	0.37
72	600782	新钢股份	225,300	1,135,512.00	0.37
73	000559	万向钱潮	190,000	1,128,600.00	0.37
74	300775	三角防务	23,400	1,126,710.00	0.37
75	000988	华工科技	47,900	1,109,843.00	0.36
76	000563	陕国投 A	349,300	1,089,816.00	0.35
77	300034	钢研高纳	25,700	1,084,026.00	0.35
78	600598	北大荒	73,300	1,081,908.00	0.35
79	600236	桂冠电力	177,600	1,081,584.00	0.35
80	002867	周大生	67,400	1,046,722.00	0.34
81	002030	达安基因	60,700	1,043,433.00	0.34
82	600438	通威股份	17,400	1,041,564.00	0.34
83	600348	华阳股份	65,500	1,012,630.00	0.33
84	300696	爱乐达	22,940	1,008,213.00	0.33
85	600885	宏发股份	23,804	996,197.40	0.32
86	300073	当升科技	10,900	984,706.00	0.32
87	600875	东方电气	58,700	965,615.00	0.31
88	603589	口子窖	15,900	931,899.00	0.30
89	603678	火炬电子	19,900	931,519.00	0.30
90	000738	航发控制	32,900	924,490.00	0.30
91	688239	航宇科技	17,308	922,516.40	0.30
92	000778	新兴铸管	187,600	904,232.00	0.29
93	605123	派克新材	6,400	900,608.00	0.29
94	688006	杭可科技	12,849	900,200.94	0.29
95	002468	申通快递	72,500	864,200.00	0.28
96	002624	完美世界	60,000	862,200.00	0.28
97	300726	宏达电子	14,000	856,380.00	0.28
98	600522	中天科技	36,600	845,460.00	0.27
99	601128	常熟银行	109,700	838,108.00	0.27
100	300832	新产业	18,000	811,980.00	0.26
101	000893	亚钾国际	23,400	805,194.00	0.26
102	000792	盐湖股份	26,600	796,936.00	0.26
103	000807	云铝股份	80,400	794,352.00	0.26
104	002129	TCL 中环	13,300	783,237.00	0.25

105	600737	中粮糖业	103,800	780,576.00	0.25
106	600801	华新水泥	40,000	780,400.00	0.25
107	002831	裕同科技	26,000	768,300.00	0.25
108	600104	上汽集团	42,800	762,268.00	0.25
109	600380	健康元	61,300	757,055.00	0.25
110	002466	天齐锂业	6,000	748,800.00	0.24
111	600863	内蒙华电	204,300	745,695.00	0.24
112	600893	航发动力	16,300	741,813.00	0.24
113	002152	广电运通	79,100	733,257.00	0.24
114	300593	新雷能	17,600	730,576.00	0.24
115	002812	恩捷股份	2,900	726,305.00	0.24
116	300253	卫宁健康	82,200	721,716.00	0.23
117	600837	海通证券	72,600	712,206.00	0.23
118	002460	赣锋锂业	4,700	698,890.00	0.23
119	601211	国泰君安	44,700	679,440.00	0.22
120	002444	巨星科技	36,000	678,240.00	0.22
121	000598	兴蓉环境	132,600	677,586.00	0.22
122	300308	中际旭创	21,800	676,890.00	0.22
123	002128	电投能源	47,200	675,904.00	0.22
124	300014	亿纬锂能	6,900	672,750.00	0.22
125	002759	天际股份	24,700	671,346.00	0.22
126	600582	天地科技	140,100	669,678.00	0.22
127	002895	川恒股份	19,700	666,057.00	0.22
128	600546	山煤国际	34,100	663,586.00	0.22
129	002081	金螳螂	130,400	662,432.00	0.22
130	603799	华友钴业	6,830	653,084.60	0.21
131	600606	绿地控股	162,800	644,688.00	0.21
132	600507	方大特钢	91,000	636,090.00	0.21
133	002815	崇达技术	49,577	635,081.37	0.21
134	300218	安利股份	44,200	630,734.00	0.21
135	603868	飞科电器	8,300	628,725.00	0.20
136	300724	捷佳伟创	7,000	625,450.00	0.20
137	300196	长海股份	33,100	625,259.00	0.20
138	300170	汉得信息	69,200	623,492.00	0.20
139	603444	吉比特	1,600	620,800.00	0.20
140	002932	明德生物	8,991	616,422.96	0.20
141	603387	基蛋生物	43,180	615,746.80	0.20
142	603607	京华激光	46,600	614,188.00	0.20
143	688399	硕世生物	5,378	613,199.56	0.20

144	300639	凯普生物	28,600	611,468.00	0.20
145	605368	蓝天燃气	48,400	609,840.00	0.20
146	300160	秀强股份	74,900	608,937.00	0.20
147	688606	奥泰生物	5,000	608,100.00	0.20
148	000932	华菱钢铁	119,400	607,746.00	0.20
149	601888	中国中免	2,500	582,325.00	0.19
150	300015	爱尔眼科	13,000	582,010.00	0.19
151	600563	法拉电子	2,800	574,448.00	0.19
152	600732	爱旭股份	17,300	571,246.00	0.19
153	601156	东航物流	28,700	568,260.00	0.18
154	601688	华泰证券	40,000	568,000.00	0.18
155	000002	万科 A	27,600	565,800.00	0.18
156	600580	卧龙电驱	39,000	562,380.00	0.18
157	600690	海尔智家	20,200	554,692.00	0.18
158	000776	广发证券	29,600	553,520.00	0.18
159	600809	山西汾酒	1,700	552,160.00	0.18
160	600009	上海机场	9,700	549,990.00	0.18
161	000333	美的集团	9,100	549,549.00	0.18
162	002304	洋河股份	3,000	549,450.00	0.18
163	601016	节能风电	114,100	547,680.00	0.18
164	600048	保利发展	31,300	546,498.00	0.18
165	601699	潞安环能	36,900	539,478.00	0.18
166	600153	建发股份	41,200	538,484.00	0.18
167	600039	四川路桥	50,900	535,977.00	0.17
168	002594	比亚迪	1,600	533,584.00	0.17
169	603658	安图生物	10,900	532,901.00	0.17
170	300760	迈瑞医疗	1,700	532,440.00	0.17
171	300699	光威复材	9,000	529,830.00	0.17
172	601717	郑煤机	36,600	527,406.00	0.17
173	601989	中国重工	140,300	520,513.00	0.17
174	600064	南京高科	47,300	520,300.00	0.17
175	002176	江特电机	20,400	510,816.00	0.17
176	002180	纳思达	10,000	506,200.00	0.16
177	600389	江山股份	8,300	504,059.00	0.16
178	603568	伟明环保	15,100	503,887.00	0.16
179	600649	城投控股	115,700	495,196.00	0.16
180	002658	雪迪龙	70,300	494,209.00	0.16
181	002690	美亚光电	22,620	490,401.60	0.16
182	000998	隆平高科	28,400	473,144.00	0.15

183	600373	中文传媒	45,800	457,542.00	0.15
184	002557	洽洽食品	8,000	455,440.00	0.15
185	600597	光明乳业	35,900	453,417.00	0.15
186	002212	天融信	44,400	450,660.00	0.15
187	300418	昆仑万维	28,000	448,000.00	0.15
188	000581	威孚高科	22,500	433,125.00	0.14
189	002709	天赐材料	6,900	428,214.00	0.14
190	601577	长沙银行	52,500	416,325.00	0.14
191	688521	芯原股份	8,400	414,960.00	0.13
192	002459	晶澳科技	5,160	407,124.00	0.13
193	600673	东阳光	45,200	406,348.00	0.13
194	603605	珀莱雅	2,460	406,342.80	0.13
195	600985	淮北矿业	27,800	404,768.00	0.13
196	300630	普利制药	11,400	400,710.00	0.13
197	600435	北方导航	46,100	397,382.00	0.13
198	000848	承德露露	41,000	396,880.00	0.13
199	000680	山推股份	76,000	395,200.00	0.13
200	301061	匠心家居	11,600	393,240.00	0.13
201	600650	锦江在线	29,700	392,634.00	0.13
202	002500	山西证券	68,200	391,468.00	0.13
203	603706	东方环宇	25,000	391,000.00	0.13
204	600150	中国船舶	20,500	389,090.00	0.13
205	002344	海宁皮城	83,300	389,011.00	0.13
206	688188	柏楚电子	1,760	387,270.40	0.13
207	603365	水星家纺	25,800	386,484.00	0.13
208	600259	广晟有色	7,600	384,940.00	0.13
209	300494	盛天网络	26,500	382,925.00	0.12
210	300770	新媒股份	10,100	382,083.00	0.12
211	002441	众业达	40,500	381,510.00	0.12
212	601038	一拖股份	33,800	380,588.00	0.12
213	603797	联泰环保	65,000	380,250.00	0.12
214	603882	金域医学	4,600	379,730.00	0.12
215	601857	中国石油	71,400	378,420.00	0.12
216	000565	渝三峡 A	58,500	377,910.00	0.12
217	600475	华光环能	46,820	377,837.40	0.12
218	600028	中国石化	92,500	377,400.00	0.12
219	600251	冠农股份	35,300	376,298.00	0.12
220	600399	抚顺特钢	21,000	375,900.00	0.12
221	601512	中新集团	41,900	375,843.00	0.12

222	300504	天邑股份	21,100	374,736.00	0.12
223	300818	耐普矿机	9,200	373,152.00	0.12
224	300450	先导智能	5,800	366,444.00	0.12
225	600728	佳都科技	56,400	364,344.00	0.12
226	002065	东华软件	57,400	362,768.00	0.12
227	000166	申万宏源	83,400	357,786.00	0.12
228	688599	天合光能	5,326	347,521.50	0.11
229	600780	通宝能源	64,800	340,848.00	0.11
230	601877	正泰电器	9,400	336,332.00	0.11
231	300009	安科生物	33,000	333,630.00	0.11
232	002625	光启技术	19,000	328,130.00	0.11
233	600905	三峡能源	51,900	326,451.00	0.11
234	600297	广汇汽车	124,000	323,640.00	0.11
235	600258	首旅酒店	12,500	310,000.00	0.10
236	603659	璞泰来	3,600	303,840.00	0.10
237	000066	中国长城	27,600	298,632.00	0.10
238	300395	菲利华	6,450	290,250.00	0.09
239	601901	方正证券	42,900	287,859.00	0.09
240	002025	航天电器	4,100	286,262.00	0.09
241	601066	中信建投	9,900	286,209.00	0.09
242	300357	我武生物	5,500	286,165.00	0.09
243	000729	燕京啤酒	29,300	283,038.00	0.09
244	605117	德业股份	1,000	279,890.00	0.09
245	002966	苏州银行	45,840	279,624.00	0.09
246	601077	渝农商行	75,300	278,610.00	0.09
247	002399	海普瑞	15,800	277,764.00	0.09
248	601990	南京证券	33,300	277,722.00	0.09
249	600022	山东钢铁	158,900	276,486.00	0.09
250	603379	三美股份	12,415	276,233.75	0.09
251	002945	华林证券	18,100	276,025.00	0.09
252	600126	杭钢股份	53,500	273,920.00	0.09
253	600346	恒力石化	12,300	273,552.00	0.09
254	601233	桐昆股份	17,100	271,548.00	0.09
255	000830	鲁西化工	15,700	271,453.00	0.09
256	002493	荣盛石化	17,600	270,864.00	0.09
257	000703	恒逸石化	25,600	269,056.00	0.09
258	002372	伟星新材	11,100	266,844.00	0.09
259	601985	中国核电	38,400	263,424.00	0.09
260	002389	航天彩虹	14,300	262,548.00	0.09



261	002384	东山精密	11,300	259,109.00	0.08
262	002286	保龄宝	21,700	248,465.00	0.08
263	002878	元隆雅图	12,800	247,040.00	0.08
264	002465	海格通信	27,000	245,430.00	0.08
265	002343	慈文传媒	43,100	244,377.00	0.08
266	603003	龙宇燃油	32,700	243,288.00	0.08
267	688330	宏力达	2,816	242,147.84	0.08
268	301060	兰卫医学	6,900	241,638.00	0.08
269	601677	明泰铝业	10,100	240,380.00	0.08
270	002432	九安医疗	4,000	240,240.00	0.08
271	002098	浔兴股份	40,600	239,946.00	0.08
272	601788	光大证券	15,200	239,552.00	0.08
273	600757	长江传媒	42,000	239,400.00	0.08
274	300533	冰川网络	9,100	239,330.00	0.08
275	603579	荣泰健康	9,700	239,105.00	0.08
276	600097	开创国际	24,300	238,869.00	0.08
277	300662	科锐国际	4,600	238,694.00	0.08
278	300592	华凯易佰	16,000	238,560.00	0.08
279	002696	百洋股份	40,600	238,322.00	0.08
280	002584	西陇科学	29,900	238,303.00	0.08
281	301012	扬电科技	5,800	237,858.00	0.08
282	002545	东方铁塔	20,900	237,842.00	0.08
283	605060	联德股份	13,100	237,765.00	0.08
284	688679	通源环境	21,888	237,703.68	0.08
285	603889	新澳股份	37,600	237,632.00	0.08
286	605122	四方新材	13,200	237,600.00	0.08
287	300864	南大环境	11,300	237,300.00	0.08
288	601801	皖新传媒	49,100	237,153.00	0.08
289	603360	百傲化学	16,900	237,107.00	0.08
290	000666	经纬纺机	26,400	237,072.00	0.08
291	603722	阿科力	4,700	237,021.00	0.08
292	605287	德才股份	9,400	236,974.00	0.08
293	300625	三雄极光	19,700	236,794.00	0.08
294	600229	城市传媒	36,200	236,748.00	0.08
295	300654	世纪天鸿	28,900	236,691.00	0.08
296	603333	尚纬股份	38,600	236,618.00	0.08
297	688081	兴图新科	11,403	236,612.25	0.08
298	300695	兆丰股份	4,500	236,520.00	0.08
299	002404	嘉欣丝绸	41,100	236,325.00	0.08

300	600269	赣粤高速	68,100	236,307.00	0.08
301	002225	濮耐股份	58,900	236,189.00	0.08
302	300897	山科智能	8,100	236,115.00	0.08
303	600449	宁夏建材	19,400	236,098.00	0.08
304	300214	日科化学	30,500	236,070.00	0.08
305	605098	行动教育	8,500	235,960.00	0.08
306	688669	聚石化学	9,203	235,872.89	0.08
307	300389	艾比森	22,700	235,853.00	0.08
308	605158	华达新材	36,500	235,790.00	0.08
309	601921	浙版传媒	30,300	235,734.00	0.08
310	300302	同有科技	29,100	235,710.00	0.08
311	000731	四川美丰	25,900	235,690.00	0.08
311	300234	开尔新材	37,000	235,690.00	0.08
312	600273	嘉化能源	21,700	235,662.00	0.08
313	300838	浙江力诺	15,400	235,466.00	0.08
314	002394	联发股份	32,200	235,382.00	0.08
315	603929	亚翔集成	22,100	235,365.00	0.08
316	002414	高德红外	18,280	235,263.60	0.08
317	300559	佳发教育	23,900	235,176.00	0.08
318	002543	万和电气	33,500	235,170.00	0.08
319	300138	晨光生物	15,100	235,107.00	0.08
320	603585	苏利股份	12,100	235,103.00	0.08
321	688090	瑞松科技	7,600	235,068.00	0.08
322	300583	赛托生物	10,400	235,040.00	0.08
323	301006	迈拓股份	12,500	235,000.00	0.08
324	300634	彩讯股份	18,500	234,950.00	0.08
325	603565	中谷物流	14,800	234,876.00	0.08
326	002267	陕天然气	33,600	234,864.00	0.08
327	600262	北方股份	12,000	234,840.00	0.08
328	603177	德创环保	15,500	234,825.00	0.08
329	300970	华绿生物	12,400	234,608.00	0.08
330	688569	铁科轨道	12,768	234,292.80	0.08
331	000547	航天发展	19,600	234,024.00	0.08
332	600639	浦东金桥	17,200	233,748.00	0.08
333	301082	久盛电气	12,600	233,730.00	0.08
334	300399	天利科技	21,700	233,709.00	0.08
335	002091	江苏国泰	21,737	233,672.75	0.08
336	603496	恒为科技	19,600	233,632.00	0.08
337	603813	原尚股份	15,400	233,618.00	0.08

338	300211	亿通科技	27,100	233,331.00	0.08
339	601956	东贝集团	36,500	233,235.00	0.08
340	003033	征和工业	8,700	233,160.00	0.08
341	688098	申联生物	29,732	233,098.88	0.08
342	603392	万泰生物	1,500	232,950.00	0.08
343	603031	安孚科技	5,600	232,848.00	0.08
344	300514	友讯达	22,300	232,589.00	0.08
345	603013	亚普股份	16,600	231,902.00	0.08
346	605088	冠盛股份	17,200	231,856.00	0.08
347	688228	开普云	7,430	231,593.10	0.08
348	688500	慧辰股份	10,401	231,422.25	0.08
349	603766	隆鑫通用	50,200	231,422.00	0.08
350	300615	欣天科技	21,000	231,420.00	0.08
351	003036	泰坦股份	21,600	231,336.00	0.08
352	603586	金麒麟	17,900	231,268.00	0.08
353	600179	安通控股	60,473	231,006.86	0.08
354	002133	广宇集团	63,500	230,505.00	0.07
355	300316	晶盛机电	3,400	229,806.00	0.07
356	688191	智洋创新	13,499	229,483.00	0.07
357	600714	金瑞矿业	18,200	228,410.00	0.07
358	601618	中国中冶	65,100	227,850.00	0.07
359	300661	圣邦股份	1,250	227,525.00	0.07
360	601390	中国中铁	36,900	226,566.00	0.07
361	603355	莱克电气	8,900	224,547.00	0.07
362	300763	锦浪科技	1,050	223,650.00	0.07
363	002242	九阳股份	12,000	220,320.00	0.07
364	000887	中鼎股份	12,000	218,880.00	0.07
365	601668	中国建筑	40,800	217,056.00	0.07
366	688200	华峰测控	600	213,840.00	0.07
367	600482	中国动力	13,500	212,085.00	0.07
368	601099	太平洋	68,500	204,815.00	0.07
369	603806	福斯特	3,100	203,112.00	0.07
370	603883	老百姓	5,980	202,602.40	0.07
371	000930	中粮科技	22,400	202,496.00	0.07
372	600879	航天电子	31,200	202,488.00	0.07
373	603233	大参林	6,460	202,198.00	0.07
374	002422	科伦药业	10,700	200,090.00	0.07
375	600118	中国卫星	9,400	188,752.00	0.06
376	600536	中国软件	4,600	186,714.00	0.06

377	002192	融捷股份	1,200	184,440.00	0.06
378	000997	新大陆	13,800	182,298.00	0.06
379	002202	金风科技	12,200	180,560.00	0.06
380	300257	开山股份	11,900	178,024.00	0.06
381	601995	中金公司	4,000	177,960.00	0.06
382	601878	浙商证券	15,600	177,528.00	0.06
383	600271	航天信息	15,800	172,852.00	0.06
384	002411	*ST 必康	26,100	170,955.00	0.06
385	688322	奥比中光	5,511	170,785.89	0.06
386	600884	杉杉股份	5,665	168,363.80	0.05
387	603712	七一二	5,200	163,800.00	0.05
388	688002	睿创微纳	4,050	160,866.00	0.05
389	600120	浙江东方	38,900	155,989.00	0.05
390	603185	上机数控	980	152,870.20	0.05
391	600556	天下秀	18,200	149,786.00	0.05
392	600037	歌华有线	15,900	149,301.00	0.05
393	301139	元道通信	3,843	147,801.78	0.05
394	002563	森马服饰	24,600	145,632.00	0.05
395	601718	际华集团	46,900	145,390.00	0.05
396	601298	青岛港	25,800	141,126.00	0.05
397	601000	唐山港	54,600	140,868.00	0.05
398	601228	广州港	38,300	140,561.00	0.05
399	601118	海南橡胶	29,400	140,532.00	0.05
400	002294	信立泰	5,000	140,500.00	0.05
401	300251	光线传媒	14,800	140,156.00	0.05
402	601665	齐鲁银行	28,500	139,080.00	0.05
403	000009	中国宝安	10,300	138,947.00	0.05
404	600160	巨化股份	10,500	138,075.00	0.04
405	300474	景嘉微	2,000	136,780.00	0.04
406	300285	国瓷材料	3,800	136,496.00	0.04
407	300919	中伟股份	1,100	136,290.00	0.04
408	002299	圣农发展	7,100	136,178.00	0.04
409	601958	金钼股份	15,400	136,136.00	0.04
410	600516	方大炭素	17,900	136,040.00	0.04
411	300017	网宿科技	25,300	135,608.00	0.04
412	688321	微芯生物	5,361	135,043.59	0.04
413	002505	鹏都农牧	39,700	134,583.00	0.04
414	002532	天山铝业	20,600	134,518.00	0.04
415	601865	福莱特	3,500	133,350.00	0.04

416	002153	石基信息	8,320	132,038.40	0.04
417	301035	润丰股份	1,600	131,920.00	0.04
418	301175	中科环保	34,341	131,182.62	0.04
419	688777	中控技术	1,800	130,968.00	0.04
420	002670	国盛金控	13,200	126,720.00	0.04
421	688058	宝兰德	2,285	124,121.20	0.04
422	688589	力合微	2,760	123,703.20	0.04
423	601881	中国银河	12,700	122,809.00	0.04
424	301239	普瑞眼科	3,640	122,486.00	0.04
425	300833	浩洋股份	1,400	122,024.00	0.04
426	000408	藏格矿业	3,700	121,878.00	0.04
427	600596	新安股份	5,600	121,240.00	0.04
428	688008	澜起科技	2,000	121,160.00	0.04
429	002841	视源股份	1,600	120,512.00	0.04
430	688600	皖仪科技	9,315	120,442.95	0.04
431	688400	凌云光	5,470	119,957.10	0.04
432	002574	明牌珠宝	24,600	119,802.00	0.04
433	300327	中颖电子	2,400	119,544.00	0.04
434	601899	紫金矿业	12,800	119,424.00	0.04
435	688298	东方生物	1,046	119,400.90	0.04
436	002648	卫星化学	4,600	118,910.00	0.04
437	300839	博汇股份	8,800	118,712.00	0.04
438	002763	汇洁股份	15,800	118,658.00	0.04
439	600545	卓郎智能	30,300	118,170.00	0.04
440	600638	新黄浦	21,100	118,160.00	0.04
441	002258	利尔化学	5,000	118,100.00	0.04
442	688598	金博股份	400	117,880.00	0.04
443	300689	澄天伟业	6,800	117,708.00	0.04
444	300923	研奥股份	5,100	117,555.00	0.04
445	003018	金富科技	12,700	117,475.00	0.04
446	300906	日月明	4,700	117,265.00	0.04
447	603787	新日股份	7,900	117,236.00	0.04
448	300555	路通视信	15,200	117,040.00	0.04
449	300789	唐源电气	5,800	116,986.00	0.04
450	300540	蜀道装备	5,300	116,971.00	0.04
451	301042	安联锐视	3,500	116,970.00	0.04
452	688360	德马科技	4,391	116,888.42	0.04
453	603933	睿能科技	10,700	116,844.00	0.04
454	600520	文一科技	13,300	116,774.00	0.04

455	002555	三七互娱	5,500	116,765.00	0.04
456	603725	天安新材	16,500	116,655.00	0.04
457	301030	仕净科技	5,000	116,600.00	0.04
458	600287	江苏舜天	23,400	116,532.00	0.04
459	300862	蓝盾光电	4,300	116,444.00	0.04
460	688466	金科环境	7,416	116,431.20	0.04
461	000933	神火股份	8,900	116,412.00	0.04
462	605155	西大门	7,900	116,367.00	0.04
463	688335	复洁环保	4,052	116,332.92	0.04
464	688004	博汇科技	4,680	115,876.80	0.04
465	002821	凯莱英	400	115,600.00	0.04
466	601666	平煤股份	8,500	115,515.00	0.04
467	603926	铁流股份	11,210	115,126.70	0.04
468	002544	普天科技	5,000	113,750.00	0.04
469	000417	合肥百货	24,100	110,619.00	0.04
470	603368	柳药集团	6,400	110,208.00	0.04
471	002080	中材科技	4,000	110,000.00	0.04
472	600694	大商股份	6,100	109,190.00	0.04
473	600057	厦门象屿	12,400	108,996.00	0.04
474	601319	中国人保	21,500	108,790.00	0.04
475	600362	江西铜业	6,100	108,763.00	0.04
476	601005	重庆钢铁	56,900	108,679.00	0.04
477	000825	太钢不锈	19,900	108,455.00	0.04
478	000761	本钢板材	30,100	108,360.00	0.04
479	600050	中国联通	31,300	108,298.00	0.04
480	600016	民生银行	29,100	108,252.00	0.04
481	601186	中国铁建	13,700	108,230.00	0.04
482	000898	鞍钢股份	33,600	108,192.00	0.04
483	600282	南钢股份	34,300	108,045.00	0.04
484	600755	厦门国贸	14,400	108,000.00	0.04
485	000900	现代投资	26,200	107,944.00	0.04
486	600623	华谊集团	13,000	107,900.00	0.04
487	600528	中铁工业	13,400	107,870.00	0.04
488	002092	中泰化学	13,900	107,864.00	0.04
489	601998	中信银行	22,700	107,825.00	0.04
490	002110	三钢闽光	17,700	107,793.00	0.04
491	601818	光大银行	35,800	107,758.00	0.04
492	000059	华锦股份	18,200	107,744.00	0.04
493	600997	开滦股份	14,100	107,442.00	0.03

494	600180	瑞茂通	13,900	107,308.00	0.03
495	600808	马钢股份	28,300	107,257.00	0.03
496	000028	国药一致	3,600	107,244.00	0.03
497	600998	九州通	9,000	107,190.00	0.03
498	688150	莱特光电	5,466	107,024.28	0.03
499	600967	内蒙一机	11,700	106,704.00	0.03
500	300144	宋城演艺	6,900	105,915.00	0.03
501	600248	陕西建工	19,300	104,799.00	0.03
502	600308	华泰股份	18,300	104,493.00	0.03
503	600019	宝钢股份	17,300	104,146.00	0.03
504	603026	石大胜华	700	101,745.00	0.03
505	600378	昊华科技	2,600	100,152.00	0.03
506	600549	厦门钨业	4,443	96,057.66	0.03
507	601611	中国核建	11,200	93,968.00	0.03
508	600562	国睿科技	6,300	93,555.00	0.03
509	600909	华安证券	20,300	92,365.00	0.03
510	300850	新强联	1,020	90,810.60	0.03
511	600685	中船防务	5,500	90,695.00	0.03
512	688388	嘉元科技	1,000	84,870.00	0.03
513	688225	亚信安全	4,028	84,386.60	0.03
514	002487	大金重工	1,800	75,114.00	0.02
515	003816	中国广核	26,600	74,480.00	0.02
516	601698	中国卫通	6,500	73,515.00	0.02
517	300618	寒锐钴业	1,200	69,504.00	0.02
518	300123	亚光科技	11,100	68,820.00	0.02
519	600764	中国海防	2,700	68,148.00	0.02
520	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.02
521	300762	上海瀚讯	5,500	61,215.00	0.02
522	600621	华鑫股份	4,200	60,984.00	0.02
523	300409	道氏技术	2,300	59,754.00	0.02
524	600990	四创电子	1,400	57,890.00	0.02
525	601606	长城军工	4,700	54,567.00	0.02
526	002935	天奥电子	2,370	54,059.70	0.02
527	688516	奥特维	200	53,390.00	0.02
528	300900	广联航空	1,900	50,730.00	0.02
529	300581	晨曦航空	2,100	50,715.00	0.02
530	600184	光电股份	3,500	48,440.00	0.02
531	300772	运达股份	1,860	47,318.40	0.02
532	300527	中船应急	6,100	46,116.00	0.01

533	300629	新劲刚	1,880	40,213.20	0.01
534	000561	烽火电子	4,600	37,398.00	0.01
535	002338	奥普光电	2,100	37,275.00	0.01
536	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
537	301155	海力风电	400	36,400.00	0.01
538	003009	中天火箭	700	32,753.00	0.01
539	300424	航新科技	2,900	32,712.00	0.01
540	002933	新兴装备	1,000	30,280.00	0.01
541	301238	瑞泰新材	834	29,565.30	0.01
542	300875	捷强装备	800	29,448.00	0.01
543	300722	新余国科	910	28,382.90	0.01
544	301266	宇邦新材	517	26,036.12	0.01
545	301215	中汽股份	3,926	25,087.14	0.01
546	300922	天秦装备	1,280	22,988.80	0.01
547	301112	信邦智能	399	20,664.21	0.01
548	301263	泰恩康	581	18,231.78	0.01
549	301153	中科江南	368	17,185.60	0.01
550	301286	侨源股份	784	16,910.88	0.01
551	301120	新特电气	1,032	16,522.32	0.01
552	301187	欧圣电气	713	16,327.70	0.01
553	301201	诚达药业	227	16,225.96	0.01
554	301160	翔楼新材	392	15,883.84	0.01
555	301235	华康医疗	418	15,842.20	0.01
556	301217	铜冠铜箔	1,063	15,753.66	0.01
557	301302	华如科技	270	15,660.00	0.01
558	301298	东利机械	634	14,956.06	0.00
559	301256	华融化学	1,469	14,807.52	0.00
560	301117	佳缘科技	262	14,247.56	0.00
561	301212	联盛化学	416	14,094.08	0.00
562	301268	铭利达	389	13,579.99	0.00
563	301236	软通动力	426	13,367.88	0.00
564	301127	天源环保	1,189	13,233.57	0.00
565	301259	艾布鲁	483	12,480.72	0.00
566	301248	杰创智能	413	12,377.61	0.00
567	301109	军信股份	763	12,375.86	0.00
568	301103	何氏眼科	377	12,075.31	0.00
569	301116	益客食品	577	11,793.88	0.00
570	301220	亚香股份	285	11,602.35	0.00
571	301200	大族数控	223	11,567.01	0.00



572	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
573	301207	华兰疫苗	201	11,336.40	0.00
574	301206	三元生物	244	11,143.48	0.00
575	301102	兆讯传媒	358	11,130.22	0.00
576	301150	中一科技	129	10,953.39	0.00
577	301216	万凯新材	360	10,742.40	0.00
578	301148	嘉戎技术	438	10,498.86	0.00
579	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
580	301288	清研环境	452	9,889.76	0.00
581	301125	腾亚精工	327	9,639.96	0.00
582	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
583	301237	和顺科技	222	9,295.14	0.00
584	301163	宏德股份	277	9,060.67	0.00
585	301130	西点药业	237	8,927.79	0.00
586	301258	富士莱	214	8,921.66	0.00
587	301135	瑞德智能	338	8,886.02	0.00
588	301219	腾远钴业	101	8,873.86	0.00
589	301151	冠龙节能	384	8,256.00	0.00
590	301123	奕东电子	324	8,219.88	0.00
591	301181	标榜股份	257	7,859.06	0.00
592	301158	德石股份	379	7,716.44	0.00
593	301110	青木股份	176	7,013.60	0.00
594	301279	金道科技	296	6,819.84	0.00
595	300834	星辉环材	221	6,632.21	0.00
596	301196	唯科科技	128	4,800.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000877	天山股份	10,933,962.00	3.19
2	300418	昆仑万维	10,717,421.79	3.13
3	600111	北方稀土	7,019,889.98	2.05
4	603486	科沃斯	6,690,892.00	1.95
5	600256	广汇能源	6,521,506.00	1.90
6	002271	东方雨虹	6,348,720.00	1.85

7	688005	容百科技	6,165,682.71	1.80
8	000937	冀中能源	5,316,336.00	1.55
9	002508	老板电器	5,073,071.98	1.48
10	600392	盛和资源	4,924,450.00	1.44
11	600030	中信证券	4,584,958.75	1.34
12	600673	东阳光	4,548,710.00	1.33
13	300037	新宙邦	4,523,613.20	1.32
14	000983	山西焦煤	4,512,512.00	1.32
15	002738	中矿资源	4,319,629.00	1.26
16	000970	中科三环	4,156,768.96	1.21
17	002180	纳思达	3,997,588.00	1.17
18	600563	法拉电子	3,995,325.00	1.17
19	600787	中储股份	3,949,768.00	1.15
20	000629	攀钢钒钛	3,933,349.00	1.15

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

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超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	300418	昆仑万维	11,442,360.00	3.34
2	000877	天山股份	11,036,227.96	3.22
3	600256	广汇能源	6,956,490.50	2.03
4	600884	杉杉股份	6,524,835.42	1.90
5	000733	振华科技	6,166,011.00	1.80
6	000937	冀中能源	6,015,569.00	1.75
7	688005	容百科技	5,903,017.34	1.72
8	300037	新宙邦	5,612,349.24	1.64
9	300750	宁德时代	5,520,462.00	1.61
10	000988	华工科技	5,504,617.00	1.61
11	000630	铜陵有色	5,479,289.00	1.60
12	601012	隆基绿能	5,109,529.40	1.49
13	600787	中储股份	4,852,504.00	1.42
14	601699	潞安环能	4,773,328.61	1.39
15	600141	兴发集团	4,758,103.00	1.39
16	002815	崇达技术	4,720,819.00	1.38

17	000983	山西焦煤	4,661,262.00	1.36
18	000830	鲁西化工	4,640,166.98	1.35
19	300751	迈为股份	4,627,513.40	1.35
20	601615	明阳智能	4,570,797.00	1.33

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

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,146,958,620.56
卖出股票收入（成交）总额	1,167,794,958.51

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

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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

本报告期末本基金未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。

本报告期内，本基金未投资于股指期货。

## 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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

本报告期内，本基金未投资于国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

无。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定股票库之内的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	59,048.44
2	应收清算款	234,632.39
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293,690.83

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中航量化阿尔法六个月持有 A	905	92,140.72	9,699.99	0.01%	83,377,654.49	99.99%
中航量化阿尔法六个月持有 C	1,688	141,992.07	1,500,250.00	0.63%	238,182,363.98	99.37%
合计	2,593	124,593.12	1,509,949.99	0.47%	321,560,018.47	99.53%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	563,440.61	0.68%
	中航量化阿尔法六个月持有 C	2,000,020.00	0.83%
	合计	2,563,460.61	0.79%

### 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	10~50
	中航量化阿尔法六个月持有 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	-
	中航量化阿尔法六个月持有 C	>100
	合计	>100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航量化阿尔法 六个月持有 A	中航量化阿尔法 六个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 25 日）基金份额总额	74,904,100.76	254,269,492.63
本报告期期初基金份额总额	91,643,376.51	255,251,214.05
本报告期基金总申购份额	335,029.14	299,336.00
减：本报告期基金总赎回份额	8,591,051.17	15,867,936.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	83,387,354.48	239,682,613.98

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

无。

### 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

本报告期内，本基金管理人、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

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

无。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未出现管理人、托管人及其高级管理人员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	
中航证券有限公司	2	745,665,068.94	32.42%	545,302.92	32.42%	-
东方财富证券股份有限公司	1	688,013,209.16	29.91%	503,156.38	29.91%	新增
东吴证券股份有限公司	2	651,401,632.19	28.32%	476,360.32	28.32%	-
国盛证券有限责任公司	2	215,160,822.28	9.35%	157,349.04	9.35%	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	新增
------------	---	---	---	---	---	----

注：1 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

## 2：交易单元的选择标准和程序

(1) 实力雄厚，信誉良好；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；

(3) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

(4) 经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3：本报告期内本基金新增租用 3 个交易单元。

## 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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-



广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 14 日
2	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 21 日
3	中航基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司同业易管家平台为销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 28 日
4	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 1 月 28 日
5	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 16 日
6	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 18 日
7	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2021 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 3 月 30 日
8	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 4 月 21 日
9	中航基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 11 日
10	关于中航基金管理有限公司旗下部分基金增加销售机构的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2022 年 6 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金募集的文件
2. 《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》
3. 《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

### 12.2 存放地点

中航基金管理有限公司,地址:北京市朝阳区天辰东路 1 号北京亚洲金融大厦 B 座 1001、1007、1008 单元

### 12.3 查阅方式

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

中航基金管理有限公司

2022 年 8 月 30 日