

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券
投资基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 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 2023 年 8 月 25 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 2023 年 1 月 1 日起至 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	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	11
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
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
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.....	21
§7 投资组合报告.....	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
7.12 投资组合报告附注.....	71
§8 基金份额持有人信息.....	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	73
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.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	74
§10 重大事件揭示.....	75
10.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4 基金投资策略的改变.....	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
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.....	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
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.....	79

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§12 备查文件目录.....	80
12.1 备查文件目录.....	80
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	80

§ 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	268,222,788.80 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	71,615,638.17 份	196,607,150.63 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	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>(二) 股票投资策略：(1) 多因子模型 (2) 事件驱动模型</p> <p>(三) 债券投资策略</p> <p>(四) 股指期货投资策略</p> <p>(五) 国债期货投资策略</p> <p>(六) 资产支持证券投资策略</p> <p>(七) 存托凭证投资策略</p> <p>(八) 可转换债券及可交换债券投资策略</p>
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 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 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 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 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(2023年1月1日 - 2023年6月30日)	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-1,072,972.38	-3,491,615.19
本期利润	752,184.24	1,670,180.40
加权平均基金份额本期利润	0.0101	0.0081
本期加权平均净值利润率	1.16%	0.93%
本期基金份额净值增长率	0.93%	0.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)	
期末可供分配利润	-10,199,893.56	-29,861,566.97
期末可供分配基金份额利润	-0.1424	-0.1519
期末基金资产净值	61,415,744.61	166,745,583.66
期末基金份额净值	0.8576	0.8481
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-14.24%	-15.19%

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	1.66%	0.78%	-0.61%	0.79%	2.27%	-0.01%
过去三个月	-2.06%	0.75%	-4.31%	0.70%	2.25%	0.05%
过去六个月	0.93%	0.72%	2.40%	0.67%	-1.47%	0.05%
过去一年	-10.26%	0.88%	-5.30%	0.82%	-4.96%	0.06%

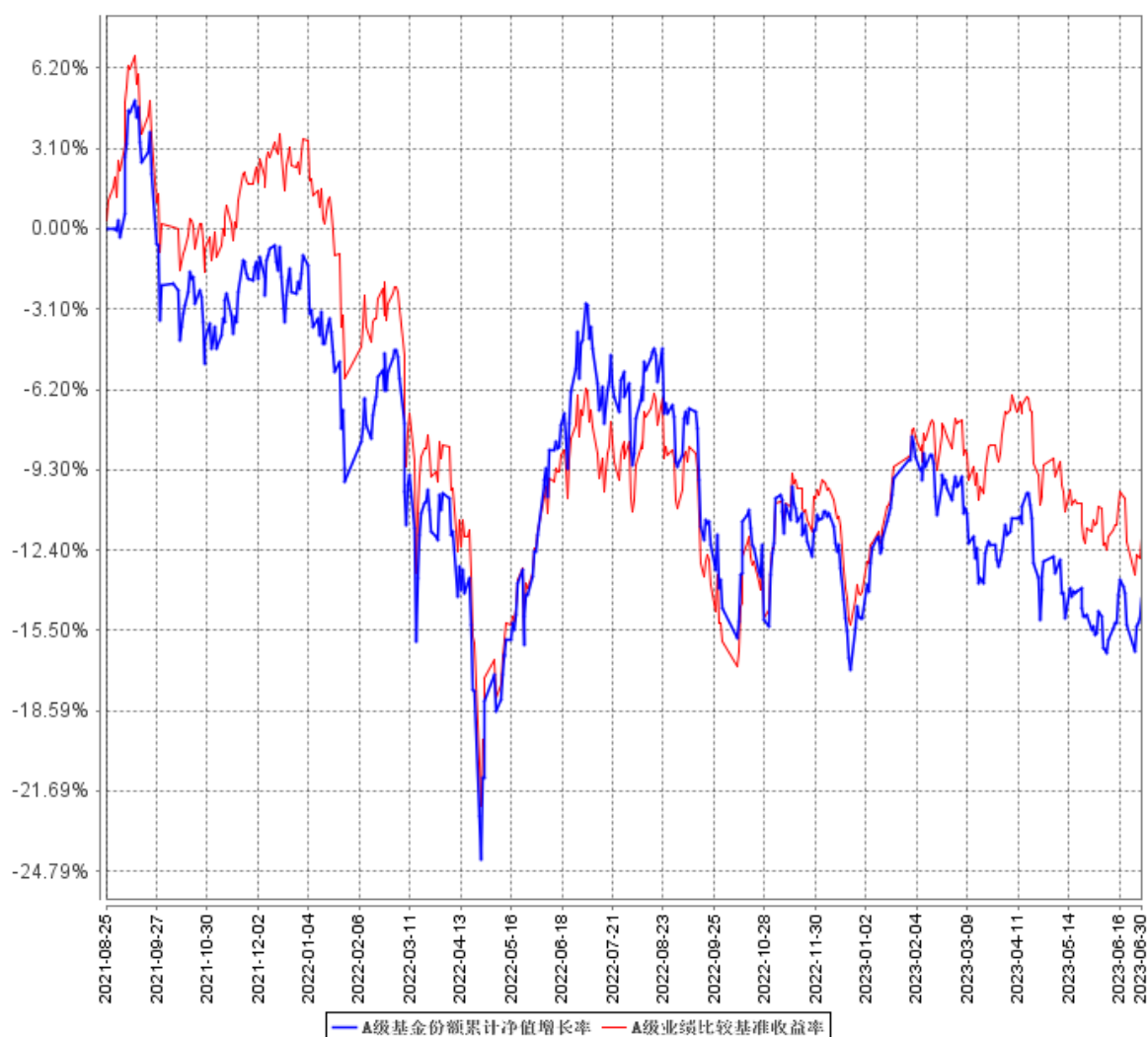
自基金合同生效起至今	-14.24%	1.07%	-11.94%	0.99%	-2.30%	0.08%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	-------

中航量化阿尔法六个月持有 C

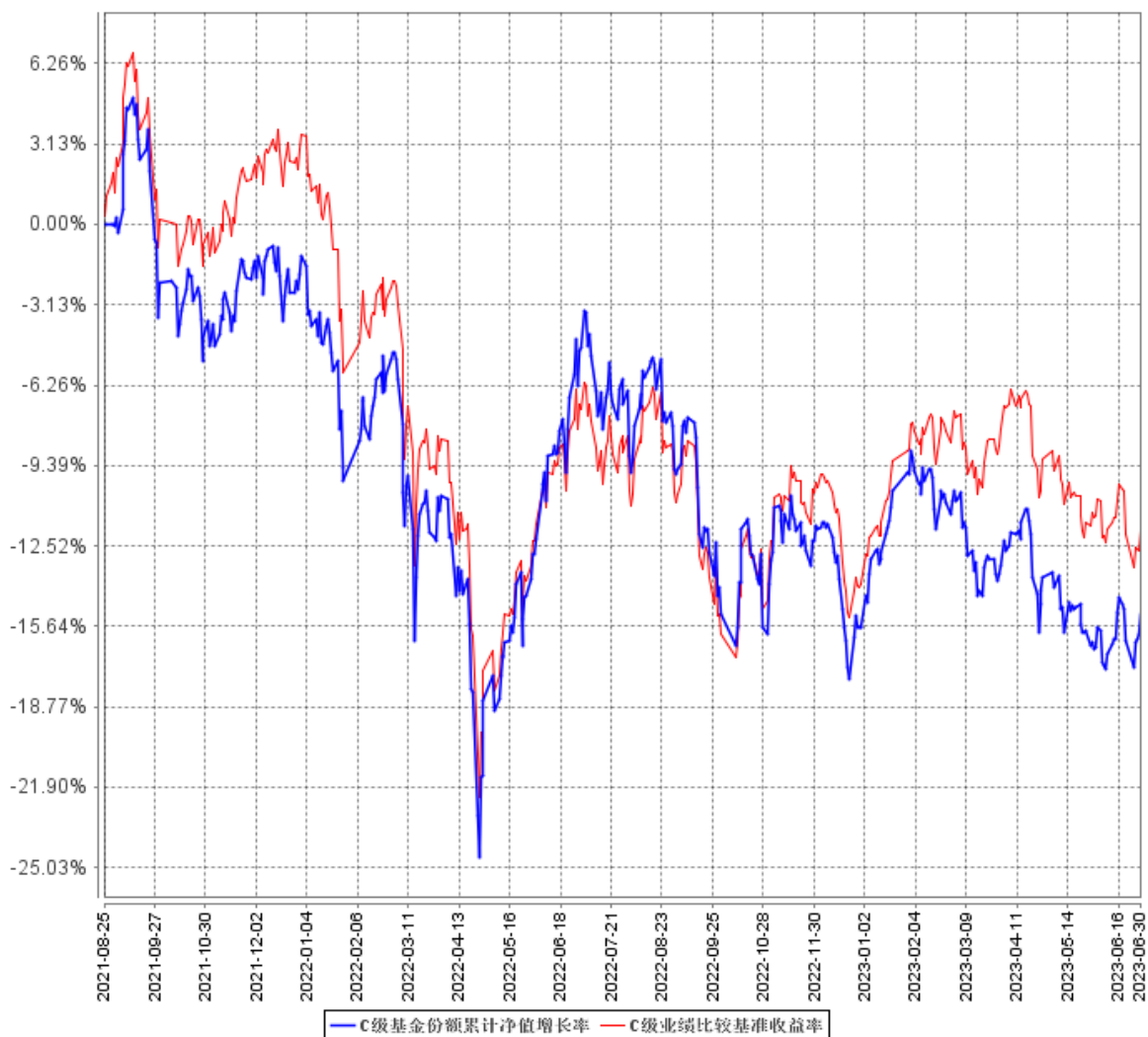
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.61%	0.78%	-0.61%	0.79%	2.22%	-0.01%
过去三个月	-2.20%	0.75%	-4.31%	0.70%	2.11%	0.05%
过去六个月	0.62%	0.72%	2.40%	0.67%	-1.78%	0.05%
过去一年	-10.80%	0.88%	-5.30%	0.82%	-5.50%	0.06%
自基金合同生效起至今	-15.19%	1.07%	-11.94%	0.99%	-3.25%	0.08%

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：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	-	13	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	-	13	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。
--	--	--	--	--	---------------------------------

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，市场呈现显著的存量博弈格局：一方面，以人工智能为代表的部分板块受到资金追捧；另一方面，经济复苏弱于预期，金融、地产、消费等行业表现不佳，新能源等前期热门赛道也出现了较为明显的资金流出。风格上，小盘显著强于大盘，尤其超小盘股表现突出；而质

量、成长等基本面因子则遭遇冷落，基金重仓股的整体表现也落后于市场。

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。由于我们选股的底层逻辑偏向于绩优股，因此不可避免会在质量、成长等因子上有所暴露，受累于上半年的市场风格，基金整体的超额收益表现不及预期。

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 0.8576 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.93%；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 0.8481 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.62%；同期业绩比较基准收益率为 2.40%。

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，我们认为当前“弱预期+弱现实”的情况有望得到改观：一方面，国内政策端有望逐步发力，市场预期和信心将逐渐得到修复；另一方面，国内经济韧性仍在，三四季度企业盈利有望企稳回升。海外方面，虽然美联储加息因素对市场的扰动可能仍然存在，但从方向上看，本轮加息周期已接近尾声。未来如果人民币汇率止跌企稳，也将带动外资回流中国资产。目前 A 股整体估值不高，相当多的优质公司已经处于历史上较低的估值分位，我们对下半年 A 股市场整体持相对乐观的态度。

行业层面，综合考虑当前的政策环境、机构持仓、交易拥挤度等因素，我们更看好与经济复苏相关的顺周期板块，尤其关注低估值优质行业和个股的反转机会。风格上，我们仍将延续成长、价值均衡的配置。

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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,855,082.61	25,035,276.81
结算备付金		1,383,158.56	839,918.61
存出保证金		303,036.83	37,070.38
交易性金融资产	6.4.7.2	204,952,441.38	223,129,751.45
其中：股票投资		204,952,441.38	223,129,751.45
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		663,197.79	1,420,480.87
应收股利		-	-
应收申购款		49,925.11	2.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		230,206,842.28	250,462,500.12
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		839,143.67	586,337.60

应付赎回款		-	1,114.22
应付管理人报酬		279,347.80	329,359.18
应付托管费		46,557.98	54,893.20
应付销售服务费		81,749.22	97,159.98
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	798,715.34	725,472.44
负债合计		2,045,514.01	1,794,336.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	268,222,788.80	294,396,802.17
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-40,061,460.53	-45,728,638.67
净资产合计		228,161,328.27	248,668,163.50
负债和净资产总计		230,206,842.28	250,462,500.12

报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 268,222,788.80 份，其中中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值 0.8576 元，份额总额 71,615,638.17 份；中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值 0.8481 元，份额总额 196,607,150.63 份。

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		5,156,460.28	-10,703,430.33
1.利息收入		52,024.66	63,353.43
其中：存款利息收入	6.4.7.13	52,024.66	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）		-1,882,516.59	-24,460,119.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,934,479.43	-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	2,051,962.84	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	6,986,952.21	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	-	-
减：二、营业总支出		2,734,095.64	3,341,666.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,819,466.65	2,232,519.83
2. 托管费	6.4.10.2.2	303,244.41	372,086.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	533,921.05	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	77,463.53	77,718.21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,422,364.64	-14,045,096.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,422,364.64	-14,045,096.68
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,422,364.64	-14,045,096.68

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50

净值)				
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）	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,174,013.37	-	5,667,178.14	-20,506,835.23
（一）、综合收益总额	-	-	2,422,364.64	2,422,364.64
（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）	-26,174,013.37	-	3,244,813.50	-22,929,199.87
其中：1.基金申购款	620,193.48	-	-83,612.03	536,581.45
2.基金赎回款	-26,794,206.85	-	3,328,425.53	-23,465,781.32
（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）	268,222,788.80	-	-40,061,460.53	228,161,328.27
项目	上年度可比期间 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	346,894,590.56	-	-4,003,267.09	342,891,323.47

净资产（基金净值）				
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

基金管理人负责人

裴荣荣

主管会计工作负责人

韩丹

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国际会计师事务所（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 号一年度和中期报告》、《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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本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【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》、财税明电【2008】2 号《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》、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 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款	22,855,082.61
等于：本金	22,852,920.61	
加：应计利息	2,162.00	
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：	22,855,082.61	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		212,128,112.33	-	204,952,441.38	-7,175,670.95
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		212,128,112.33	-	204,952,441.38	-7,175,670.95

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 2023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	698,819.40
其中：交易所市场	698,819.40
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	99,895.94
合计	798,715.34

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 2023年1月1日至2023年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,208,340.07	77,208,340.07
本期申购	326,124.06	326,124.06
本期赎回(以“-”号填列)	-5,918,825.96	-5,918,825.96
- 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	71,615,638.17	71,615,638.17

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	217,188,462.10	217,188,462.10
本期申购	294,069.42	294,069.42
本期赎回(以“-”号填列)	-20,875,380.89	-20,875,380.89
- 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	196,607,150.63	196,607,150.63

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	-8,219,324.81	-3,382,305.96	-11,601,630.77
本期利润	-1,072,972.38	1,825,156.62	752,184.24
本期基金份额交易产生的变动数	576,484.21	73,068.76	649,552.97
其中：基金申购款	-38,251.52	-7,856.09	-46,107.61
基金赎回款	614,735.73	80,924.85	695,660.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,715,812.98	-1,484,080.58	-10,199,893.56

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	-24,657,478.28	-9,469,529.62	-34,127,007.90
本期利润	-3,491,615.19	5,161,795.59	1,670,180.40
本期基金份额交易产生的变动数	2,354,801.16	240,459.37	2,595,260.53
其中：基金申购款	-33,596.31	-3,908.11	-37,504.42
基金赎回款	2,388,397.47	244,367.48	2,632,764.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,794,292.31	-4,067,274.66	-29,861,566.97

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	41,945.66
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	9,126.30
其他	952.70
合计	52,024.66

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	874,423,760.57
减：卖出股票成本总额	876,089,673.73
减：交易费用	2,268,566.27
买卖股票差价收入	-3,934,479.43

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,051,962.84
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	2,051,962.84

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,986,952.21
——股票投资	6,986,952.21
——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	6,986,952.21

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	4,567.59
合计	77,463.53

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、基金销售机构
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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
中航证券有限公司	345,372,830.58	20.11%	745,665,068.94	32.42%

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，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 2023年1月1日至2023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	252,563.18	20.11%	70,623.79	10.11%
关联方名称	上年度可比期间 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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
	当期发生的基金应支付	1,819,466.65

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	893,275.02	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	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	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	303,244.41	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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	522,703.45	522,703.45
中航基金管理有限公司	-	25.97	25.97
中航证券有限公司	-	9,706.65	9,706.65
合计	-	532,436.07	532,436.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，本基金均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

本报告期及上年度可比期间，本基金均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

本报告期及上年度可比期间，本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

本报告期末及上年度末，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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	24,541,278.00	52,024.66	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

本报告期及上年度可比期间，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

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

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（2023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
601065	江盐集团	2023年3月31日	1-6个月(含)	网下配售锁定	10.36	12.59	296	3,066.56	3,726.64	-
601133	柏诚股份	2023年3月31日	1-6个月(含)	网下配售锁定	11.66	13.72	251	2,926.66	3,443.72	-
603125	常青	2023年3月31日	1-6个月	网下配售	25.98	26.51	88	2,286.24	2,332.88	-

	科技	月 30 日	(含)	售锁定						
603135	中重科技	2023 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	17.80	19.09	251	4,467.80	4,791.59	-
603137	恒尚节能	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	15.90	18.25	139	2,210.10	2,536.75	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	14.58	16.68	122	1,778.76	2,034.96	-
688146	中船特气	2023 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	36.15	39.33	219	7,916.85	8,613.27	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	19.86	18.07	1,370	27,208.20	24,755.90	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	14.16	17.20	419	5,933.04	7,206.80	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	12.10	12.63	622	7,526.20	7,855.86	-
688361	中科飞测-U	2023 年 5 月 12 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	23.60	78.84	216	5,097.60	17,029.44	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	19.20	27.88	238	4,569.60	6,635.44	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	26.66	31.78	221	5,891.86	7,023.38	-
688435	英方软件	2023 年 1 月 12 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	38.66	72.92	2,728	105,464.48	198,925.76	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	75.00	90.95	91	6,825.00	8,276.45	-
688469	中芯集成-U	2023 年 4 月 28 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	5.69	5.45	2,553	14,526.57	13,913.85	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	11.10	17.23	849	9,423.90	14,628.27	-
688478	晶升股份	2023 年 4 月 13 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	32.52	43.22	257	8,357.64	11,107.54	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	33.99	29.84	155	5,268.45	4,625.20	-
688484	南芯科技	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	39.99	38.66	257	10,277.43	9,935.62	-
688512	慧智微-U	2023 年 5 月 8 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	20.92	19.23	325	6,799.00	6,249.75	-
688523	航天环宇	2023 年 5 月 26 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	21.86	25.44	308	6,732.88	7,835.52	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	152.38	139.10	87	13,257.06	12,101.70	-

688535	华海诚科	2023年3月28日	1-6个月(含)	网下配售锁定	35.00	54.73	161	5,635.00	8,811.53	-
688543	国科军工	2023年6月14日	1-6个月(含)	网下配售锁定	43.67	53.72	151	6,594.17	8,111.72	-
688552	航天南湖	2023年5月8日	1-6个月(含)	网下配售锁定	21.17	24.18	297	6,287.49	7,181.46	-
688562	航天软件	2023年5月15日	1-6个月(含)	网下配售锁定	12.68	25.35	459	5,820.12	11,635.65	-
688570	天玛智控	2023年5月29日	1-6个月(含)	网下配售锁定	30.26	25.46	239	7,232.14	6,084.94	-
688581	安杰思	2023年5月12日	1-6个月(含)	网下配售锁定	125.80	118.07	54	6,793.20	6,375.78	-
688582	芯动联科	2023年6月21日	1-6个月(含)	网下配售锁定	26.74	45.06	232	6,203.68	10,453.92	-
688593	新相微	2023年5月25日	1-6个月(含)	网下配售锁定	11.18	16.26	525	5,869.50	8,536.50	-
688620	安凯微	2023年6月15日	1-6个月(含)	网下配售锁定	10.68	12.81	613	6,546.84	7,852.53	-
688623	双元科技	2023年5月31日	1-6个月(含)	网下配售锁定	125.88	89.31	56	7,049.28	5,001.36	-
688629	华丰科技	2023年6月16日	1-6个月(含)	网下配售锁定	9.26	22.11	587	5,435.62	12,978.57	-
688631	莱斯信息	2023年6月19日	1-6个月(含)	网下配售锁定	25.28	30.89	163	4,120.64	5,035.07	-
300804	广康生化	2023年6月15日	1-6个月(含)	网下配售锁定	42.45	33.10	177	7,513.65	5,858.70	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	1-6个月(含)	网下配售锁定	41.20	42.73	222	9,146.40	9,486.06	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	1-6个月(含)	网下配售锁定	56.50	52.92	123	6,949.50	6,509.16	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	1-6个月(含)	网下配售锁定	34.00	35.61	150	5,100.00	5,341.50	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	1-6个月(含)	网下配售锁定	46.13	34.96	180	8,303.40	6,292.80	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	1-6个月(含)	网下配售锁定	57.88	49.71	150	8,682.00	7,456.50	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	1-6个月(含)	网下配售锁定	35.66	34.28	226	8,059.16	7,747.28	-
301232	飞沃科技	2023年6月8日	1-6个月(含)	网下配售锁定	72.50	58.48	103	7,467.50	6,023.44	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	1-6个月(含)	网下配售锁定	50.00	30.71	304	15,200.00	9,335.84	-
301260	格力	2023年1月	1-6个月	网下配	30.85	23.62	525	16,196.25	12,400.50	-

	博	月 20 日	(含)	售锁定							
301262	海看股份	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	30.22	25.97	296	8,945.12	7,687.12	-	
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	31.58	25.36	263	8,305.84	6,669.68	锁定送股	
301291	明阳电气	2023 年 6 月 21 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	38.13	31.57	277	10,562.01	8,744.89	-	
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	29.60	76.12	230	6,808.00	17,507.60	-	
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	37.40	36.77	206	7,704.40	7,574.62	-	
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	26.80	22.32	508	13,614.40	11,338.56	-	
301305	朗坤环境	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	25.25	19.83	318	8,029.50	6,305.94	-	
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	32.34	32.00	302	9,766.68	9,664.00	-	
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	67.28	65.44	173	11,639.44	11,321.12	-	
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	32.29	55.59	189	6,102.81	10,506.51	-	
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	20.67	26.14	625	12,918.75	16,337.50	-	
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	13.06	23.16	642	8,384.52	14,868.72	-	
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	39.06	41.11	137	5,351.22	5,632.07	-	
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	76.80	109.43	123	9,446.40	13,459.89	-	
301332	德尔玛	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	14.81	13.74	477	7,064.37	6,553.98	-	
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	32.60	32.25	168	5,476.80	5,418.00	-	
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	73.45	46.64	97	7,124.65	4,524.08	-	
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	17.55	17.23	351	6,160.05	6,047.73	-	
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	50.00	49.08	140	7,000.00	6,871.20	-	
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	1-6 个月 (含)	网下配售锁定	23.77	42.86	336	7,986.72	14,400.96	-	
301360	荣旗	2023 年 4 月	1-6 个月	网下配	71.88	92.81	94	6,756.72	8,724.14	-	

	科技	月 17 日	(含)	售锁定						
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	33.73	31.84	239	8,061.47	7,609.76	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	24.66	22.57	262	6,460.92	5,913.34	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	23.80	35.90	242	5,759.60	8,687.80	-
301383	天键股份	2023 年 5 月 31 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	46.16	35.72	238	10,986.08	8,501.36	-
301386	未来电器	2023 年 3 月 21 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	29.99	23.79	261	7,827.39	6,209.19	-
301387	光大同创	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	58.32	45.63	214	12,480.48	9,764.82	-
301397	溯联股份	2023 年 6 月 15 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	53.27	40.93	153	8,150.31	6,262.29	-
301399	英特科技	2023 年 5 月 16 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	43.99	51.65	181	7,962.19	9,348.65	-
301408	华人健康	2023 年 2 月 22 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	16.24	16.95	578	9,386.72	9,797.10	-
301419	阿莱德	2023 年 2 月 2 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	24.80	43.78	330	8,184.00	14,447.40	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	26.35	33.25	204	5,375.40	6,783.00	-
301429	森泰股份	2023 年 4 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	28.75	21.19	444	12,765.00	9,408.36	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	19.99	16.90	342	6,836.58	5,779.80	-
001282	三联锻造	2023 年 5 月 15 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	27.93	33.12	78	2,178.54	2,583.36	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	9.60	9.93	3,767	36,163.20	37,406.31	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	11.88	25.32	310	3,682.80	7,849.20	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	18.88	20.03	114	2,152.32	2,283.42	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	20.68	29.79	108	2,233.44	3,217.32	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	15.38	16.45	152	2,337.76	2,500.40	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	44.48	42.55	52	2,312.96	2,212.60	-
001380	华纬科技	2023 年 5 月 9 日	1-6 个月(含)	网下配售锁定	28.84	30.85	127	3,662.68	3,917.95	-

688603	天承科技	2023年6月30日	6个交易日	新股流通受限	55.00	55.00	1,078	59,290.00	59,290.00	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	6个交易日	新股流通受限	36.90	36.90	1,325	48,892.50	48,892.50	-
301292	海科新源	2023年6月29日	5个交易日	新股流通受限	19.99	19.99	3,766	75,282.34	75,282.34	-
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个交易日	新股流通受限	26.68	26.68	3,074	82,014.32	82,014.32	-
301486	致尚科技	2023年6月30日	5个交易日	新股流通受限	57.66	57.66	1,446	83,376.36	83,376.36	-
301488	豪恩汽电	2023年6月26日	2个交易日	新股流通受限	39.78	39.78	1,795	71,405.10	71,405.10	-

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
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项	6.97	2023年7月3日	7.10	33,000	230,010.00	230,010.00	-
000561	烽火电子	2023年6月30日	重大事项	11.57	2023年7月14日	12.73	3,500	29,820.00	40,495.00	-
000691	亚太实业	2023年6月27日	临时停牌	4.36	2023年7月4日	4.80	50,000	205,500.00	218,000.00	-
300346	南大光电	2023年6月26日	重大事项	34.39	2023年7月6日	35.60	3,400	121,108.00	116,926.00	-

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

本基金可投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等，以数量化分析为基础，主要投资于具有良好流动性的国内依法发行上市的股票，债券投资采取稳健的投资管理方式。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力求在严格控制风险的前提下，谋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。从定性分析的角度触发，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。

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托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和

款项清算，违约风险可能性很小；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。

于本报告期末，本基金未持有信用债及资产支持证券(上年度末：无)。

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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金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。

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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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%（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上述比例限制）。

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%。

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、债券投资、买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,855,082.61	-	-	-	22,855,082.61
结算备付金	1,383,158.56	-	-	-	1,383,158.56
存出保证金	303,036.83	-	-	-	303,036.83
交易性金融资产	-	-	-	204,952,441.38	204,952,441.38
应收清算款	-	-	-	663,197.79	663,197.79
应收申购款	-	-	-	49,925.11	49,925.11
资产总计	24,541,278.00	-	-	205,665,564.28	230,206,842.28
负债					
应付清算款	-	-	-	839,143.67	839,143.67
应付管理人报酬	-	-	-	279,347.80	279,347.80
应付托管费	-	-	-	46,557.98	46,557.98
应付销售服务费	-	-	-	81,749.22	81,749.22
其他负债	-	-	-	798,715.34	798,715.34
负债总计	-	-	-	2,045,514.01	2,045,514.01
利率敏感度缺口	24,541,278.00	-	-	203,620,050.27	228,161,328.27
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	25,035,276.81	-	-	-	25,035,276.81
结算备付金	839,918.61	-	-	-	839,918.61
存出保证金	37,070.38	-	-	-	37,070.38
交易性金融资产	-	-	-	223,129,751.45	223,129,751.45
应收清算款	-	-	-	1,420,480.87	1,420,480.87
应收申购款	-	-	-	2.00	2.00
资产总计	25,912,265.80	-	-	224,550,234.32	250,462,500.12
负债					
应付清算款	-	-	-	586,337.60	586,337.60
应付赎回款	-	-	-	1,114.22	1,114.22
应付管理人报酬	-	-	-	329,359.18	329,359.18
应付托管费	-	-	-	54,893.20	54,893.20
应付销售服务费	-	-	-	97,159.98	97,159.98
其他负债	-	-	-	725,472.44	725,472.44
负债总计	-	-	-	1,794,336.62	1,794,336.62
利率敏感度缺口	25,912,265.80	-	-	222,755,897.70	248,668,163.50

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	204,952,441.38	89.83	223,129,751.45	89.73
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	204,952,441.38	89.83	223,129,751.45	89.73

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	12,040,363.29	13,232,059.62
	业绩比较基准下降5%	-12,040,363.29	-13,232,059.62

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	203,601,441.92	222,221,274.05
第二层次	420,260.62	-

第三层次	930,738.84	908,477.40
合计	204,952,441.38	223,129,751.45

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 2023 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	204,952,441.38	89.03
	其中：股票	204,952,441.38	89.03
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	24,238,241.17	10.53
8	其他各项资产	1,016,159.73	0.44
9	合计	230,206,842.28	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	3,350,397.00	1.47
B	采矿业	8,254,670.50	3.62
C	制造业	134,075,747.68	58.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,292,294.51	1.88
E	建筑业	6,003,835.10	2.63
F	批发和零售业	3,276,024.88	1.44
G	交通运输、仓储和邮政业	3,140,845.00	1.38
H	住宿和餐饮业	384,685.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,156,823.48	4.01
J	金融业	19,504,501.00	8.55
K	房地产业	4,843,256.00	2.12
L	租赁和商务服务业	1,884,271.00	0.83
M	科学研究和技术服务业	1,742,664.94	0.76

N	水利、环境和公共设施管理业	825,957.21	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	220,639.00	0.10
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,847,066.80	0.81
R	文化、体育和娱乐业	1,627,393.28	0.71
S	综合	521,369.00	0.23
	合计	204,952,441.38	89.83

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	002594	比亚迪	8,200	2,117,814.00	0.93
2	688390	固德威	11,634	1,941,249.24	0.85
3	002056	横店东磁	86,600	1,576,986.00	0.69
4	603688	石英股份	13,700	1,559,608.00	0.68
5	601958	金铂股份	136,700	1,524,205.00	0.67
6	688002	睿创微纳	32,667	1,463,481.60	0.64
7	002966	苏州银行	218,240	1,429,472.00	0.63
8	002518	科士达	32,500	1,300,325.00	0.57
9	300760	迈瑞医疗	4,100	1,229,180.00	0.54
10	300274	阳光电源	10,400	1,212,952.00	0.53
11	000997	新大陆	60,300	1,139,670.00	0.50
12	600481	双良节能	79,700	1,114,206.00	0.49
13	002625	光启技术	72,500	1,106,350.00	0.48
14	002025	航天电器	17,000	1,084,600.00	0.48
15	002373	千方科技	77,300	1,054,372.00	0.46
16	600487	亨通光电	71,900	1,054,054.00	0.46
17	002131	利欧股份	452,100	1,039,830.00	0.46
18	600887	伊利股份	35,900	1,016,688.00	0.45
19	603260	合盛硅业	14,500	1,015,290.00	0.44
20	000739	普洛药业	57,000	1,011,180.00	0.44
21	600690	海尔智家	43,000	1,009,640.00	0.44
22	000333	美的集团	17,100	1,007,532.00	0.44
23	000651	格力电器	27,500	1,004,025.00	0.44

24	002223	鱼跃医疗	27,400	986,126.00	0.43
25	300866	安克创新	11,200	980,000.00	0.43
26	600549	厦门钨业	51,243	975,154.29	0.43
27	002568	百润股份	26,800	974,180.00	0.43
28	000783	长江证券	166,800	967,440.00	0.42
29	002739	万达电影	74,882	939,020.28	0.41
30	601012	隆基绿能	32,340	927,187.80	0.41
31	002422	科伦药业	31,100	923,048.00	0.40
32	002074	国轩高科	33,000	911,460.00	0.40
33	002926	华西证券	108,300	899,973.00	0.39
34	603233	大参林	31,960	895,199.60	0.39
35	002304	洋河股份	6,800	893,180.00	0.39
36	600809	山西汾酒	4,800	888,336.00	0.39
37	000858	五粮液	5,400	883,278.00	0.39
38	002600	领益智造	127,800	883,098.00	0.39
39	603156	养元饮品	35,700	881,790.00	0.39
40	000568	泸州老窖	4,200	880,194.00	0.39
41	300136	信维通信	43,600	875,488.00	0.38
42	600109	国金证券	100,800	873,936.00	0.38
43	300487	蓝晓科技	14,000	873,880.00	0.38
44	301029	怡合达	19,484	870,545.12	0.38
45	603883	老百姓	28,800	859,680.00	0.38
46	600517	国网英大	150,800	859,560.00	0.38
47	600519	贵州茅台	500	845,500.00	0.37
48	600329	达仁堂	18,700	839,443.00	0.37
49	600161	天坛生物	30,900	838,935.00	0.37
50	688006	杭可科技	27,395	834,725.65	0.37
51	600497	驰宏锌锗	164,500	825,790.00	0.36
52	600276	恒瑞医药	17,200	823,880.00	0.36
53	300003	乐普医疗	36,300	820,743.00	0.36
54	600415	小商品城	96,100	819,733.00	0.36
55	603259	药明康德	13,100	816,261.00	0.36
56	600763	通策医疗	8,400	813,624.00	0.36
57	002714	牧原股份	19,300	813,495.00	0.36
58	300017	网宿科技	114,000	810,540.00	0.36
59	688082	盛美上海	7,341	810,446.40	0.36
60	300015	爱尔眼科	43,664	809,967.20	0.35
61	002985	北摩高科	18,358	809,954.96	0.35
62	603858	步长制药	38,900	800,951.00	0.35

63	300146	汤臣倍健	33,211	796,399.78	0.35
64	688029	南微医学	9,568	780,366.08	0.34
65	600315	上海家化	26,300	762,963.00	0.33
66	603737	三棵树	11,660	762,797.20	0.33
67	002738	中矿资源	14,968	762,469.92	0.33
68	002371	北方华创	2,400	762,360.00	0.33
69	002531	天顺风能	49,900	759,977.00	0.33
70	601162	天风证券	253,000	753,940.00	0.33
71	000423	东阿阿胶	14,100	753,645.00	0.33
72	688599	天合光能	17,524	746,697.64	0.33
73	300073	当升科技	14,700	739,851.00	0.32
74	688012	中微公司	4,600	719,670.00	0.32
75	603650	彤程新材	21,800	715,040.00	0.31
76	600908	无锡银行	132,500	710,200.00	0.31
77	688516	奥特维	3,716	700,094.40	0.31
78	002807	江阴银行	188,800	696,672.00	0.31
79	300438	鹏辉能源	14,500	696,580.00	0.31
80	002142	宁波银行	27,500	695,750.00	0.30
81	603885	吉祥航空	45,000	694,350.00	0.30
82	600919	江苏银行	94,400	693,840.00	0.30
83	601166	兴业银行	44,300	693,295.00	0.30
84	600926	杭州银行	58,900	692,075.00	0.30
85	000001	平安银行	61,600	691,768.00	0.30
86	601009	南京银行	86,400	691,200.00	0.30
87	601658	邮储银行	141,200	690,468.00	0.30
88	002244	滨江集团	77,800	686,196.00	0.30
89	002299	圣农发展	35,800	685,570.00	0.30
90	000738	航发控制	28,000	683,200.00	0.30
91	688063	派能科技	3,414	676,825.50	0.30
92	300827	上能电气	18,556	668,943.80	0.29
93	002850	科达利	4,900	648,025.00	0.28
94	002595	豪迈科技	18,300	642,879.00	0.28
95	600820	隧道股份	106,600	640,666.00	0.28
96	300750	宁德时代	2,780	636,036.20	0.28
97	000975	银泰黄金	54,300	635,310.00	0.28
98	002049	紫光国微	6,800	634,100.00	0.28
99	000623	吉林敖东	39,300	630,372.00	0.28
100	601058	赛轮轮胎	55,200	628,728.00	0.28
101	300058	蓝色光标	65,000	628,550.00	0.28

102	600535	天士力	43,200	626,832.00	0.27
103	688085	三友医疗	23,732	623,202.32	0.27
104	600085	同仁堂	10,800	621,648.00	0.27
105	601966	玲珑轮胎	27,700	615,494.00	0.27
106	002291	遥望科技	46,900	614,390.00	0.27
107	601000	唐山港	174,000	614,220.00	0.27
108	002901	大博医疗	19,600	609,168.00	0.27
109	000988	华工科技	16,000	608,160.00	0.27
110	002459	晶澳科技	14,544	606,484.80	0.27
111	600985	淮北矿业	50,800	585,216.00	0.26
112	600863	内蒙华电	140,700	583,905.00	0.26
113	300568	星源材质	33,400	574,146.00	0.25
114	603876	鼎胜新材	29,660	569,175.40	0.25
115	600150	中国船舶	17,200	566,052.00	0.25
116	300395	菲利华	11,350	558,420.00	0.24
117	000937	冀中能源	87,500	558,250.00	0.24
118	600642	申能股份	79,600	556,404.00	0.24
119	002812	恩捷股份	5,700	549,195.00	0.24
120	600893	航发动力	12,800	540,928.00	0.24
121	601989	中国重工	109,400	527,308.00	0.23
122	600399	抚顺特钢	51,200	522,240.00	0.23
123	601969	海南矿业	79,100	520,478.00	0.23
124	000563	陕国投 A	170,200	519,110.00	0.23
125	600066	宇通客车	35,100	517,374.00	0.23
126	600418	江淮汽车	40,900	514,931.00	0.23
127	300014	亿纬锂能	8,400	508,200.00	0.22
128	300308	中际旭创	3,400	501,330.00	0.22
129	000728	国元证券	75,900	494,868.00	0.22
130	601688	华泰证券	35,900	494,343.00	0.22
131	300316	晶盛机电	6,900	489,210.00	0.21
132	600598	北大荒	36,300	483,879.00	0.21
133	600377	宁沪高速	49,100	482,653.00	0.21
134	603868	飞科电器	7,611	480,177.99	0.21
135	600895	张江高科	34,400	478,848.00	0.21
136	688188	柏楚电子	2,535	477,999.60	0.21
137	002683	广东宏大	16,100	473,984.00	0.21
138	600909	华安证券	98,200	458,594.00	0.20
139	002737	葵花药业	18,700	455,158.00	0.20
140	600883	博闻科技	59,600	452,364.00	0.20

141	600516	方大炭素	72,400	448,880.00	0.20
142	002409	雅克科技	6,100	444,568.00	0.19
143	688234	天岳先进	6,000	443,640.00	0.19
144	600060	海信视像	17,900	443,025.00	0.19
145	002791	坚朗五金	6,800	440,028.00	0.19
146	603228	景旺电子	17,000	436,050.00	0.19
147	688208	道通科技	14,380	435,857.80	0.19
148	601908	京运通	72,000	435,600.00	0.19
149	600837	海通证券	47,200	435,184.00	0.19
150	002372	伟星新材	21,000	431,340.00	0.19
151	300842	帝科股份	4,700	429,768.00	0.19
152	600438	通威股份	12,500	428,875.00	0.19
153	600871	石化油服	213,500	422,730.00	0.19
154	600271	航天信息	30,600	418,914.00	0.18
155	002960	青鸟消防	22,900	417,009.00	0.18
156	300499	高澜股份	23,600	415,832.00	0.18
157	688005	容百科技	7,691	415,467.82	0.18
158	300990	同飞股份	8,240	414,472.00	0.18
159	002563	森马服饰	66,100	411,142.00	0.18
160	000630	铜陵有色	140,900	407,201.00	0.18
161	300902	国安达	10,800	404,460.00	0.18
162	688281	华秦科技	1,988	402,570.00	0.18
163	002129	TCL 中环	12,125	402,550.00	0.18
164	002065	东华软件	56,700	400,302.00	0.18
165	601555	东吴证券	57,500	399,050.00	0.17
166	600928	西安银行	113,100	398,112.00	0.17
167	000031	大悦城	108,300	396,378.00	0.17
168	002466	天齐锂业	5,600	391,496.00	0.17
169	300970	华绿生物	16,500	385,440.00	0.17
170	600258	首旅酒店	20,300	384,685.00	0.17
171	600732	爱旭股份	12,420	381,915.00	0.17
172	002603	以岭药业	14,800	380,212.00	0.17
173	300837	浙矿股份	9,900	380,160.00	0.17
174	300206	理邦仪器	24,900	375,492.00	0.16
175	601519	大智慧	52,300	374,468.00	0.16
176	600348	华阳股份	47,250	373,747.50	0.16
177	600582	天地科技	64,100	373,703.00	0.16
178	000048	京基智农	19,100	372,832.00	0.16
179	603878	武进不锈	43,980	371,631.00	0.16

180	002314	南山控股	112,600	371,580.00	0.16
181	301116	益客食品	24,100	371,140.00	0.16
182	603367	辰欣药业	24,400	370,392.00	0.16
183	600251	冠农股份	41,000	370,230.00	0.16
184	688126	沪硅产业	17,584	367,505.60	0.16
185	300869	康泰医学	16,000	367,360.00	0.16
186	600748	上实发展	93,000	367,350.00	0.16
187	600512	腾达建设	136,600	366,088.00	0.16
188	600635	大众公用	110,200	365,864.00	0.16
189	301089	拓新药业	5,900	365,446.00	0.16
190	600489	中金黄金	34,900	360,517.00	0.16
191	603218	日月股份	18,700	355,113.00	0.16
192	600728	佳都科技	51,200	354,816.00	0.16
193	600968	海油发展	115,400	354,278.00	0.16
194	002867	周大生	19,900	353,822.00	0.16
195	688819	天能股份	9,580	352,927.20	0.15
196	603000	人民网	11,700	341,640.00	0.15
197	300390	天华新能	9,530	341,174.00	0.15
198	601186	中国铁建	34,600	340,810.00	0.15
199	600248	陕建股份	71,400	340,578.00	0.15
200	002941	新疆交建	22,000	340,560.00	0.15
201	601390	中国中铁	44,800	339,584.00	0.15
202	000065	北方国际	22,600	339,452.00	0.15
203	600853	龙建股份	80,200	339,246.00	0.15
204	601618	中国中冶	85,300	338,641.00	0.15
205	600970	中材国际	26,500	337,875.00	0.15
206	000928	中钢国际	35,000	337,750.00	0.15
207	002051	中工国际	28,300	337,619.00	0.15
208	000709	河钢股份	149,100	336,966.00	0.15
209	000591	太阳能	49,500	335,610.00	0.15
210	000733	振华科技	3,500	335,475.00	0.15
211	603185	弘元绿能	4,480	333,984.00	0.15
212	688722	同益中	17,849	330,920.46	0.15
213	000683	远兴能源	45,900	330,021.00	0.14
214	300729	乐歌股份	18,470	329,504.80	0.14
215	002460	赣锋锂业	5,400	329,184.00	0.14
216	601128	常熟银行	48,200	328,724.00	0.14
217	600958	东方证券	33,600	325,920.00	0.14
218	601668	中国建筑	56,500	324,310.00	0.14

219	600703	三安光电	18,800	324,112.00	0.14
220	603786	科博达	4,900	321,930.00	0.14
221	002170	芭田股份	46,600	320,142.00	0.14
222	000776	广发证券	21,700	319,207.00	0.14
223	002572	索菲亚	18,300	318,786.00	0.14
224	600143	金发科技	36,500	318,645.00	0.14
225	603619	中曼石油	18,800	318,096.00	0.14
226	000014	沙河股份	27,800	318,032.00	0.14
227	300041	回天新材	26,940	317,892.00	0.14
228	000009	中国宝安	26,300	317,441.00	0.14
229	600699	均胜电子	17,900	315,756.00	0.14
230	600667	太极实业	43,200	313,632.00	0.14
231	600827	百联股份	23,100	308,847.00	0.14
232	000878	云南铜业	27,900	308,295.00	0.14
233	601108	财通证券	42,100	304,804.00	0.13
234	002893	京能热力	28,300	304,791.00	0.13
235	603056	德邦股份	19,700	303,774.00	0.13
236	600256	广汇能源	44,200	303,212.00	0.13
237	601377	兴业证券	48,700	298,044.00	0.13
238	000998	隆平高科	19,400	297,790.00	0.13
239	600745	闻泰科技	5,900	288,510.00	0.13
240	002394	联发股份	33,900	288,489.00	0.13
241	301319	唯特偶	4,815	288,177.75	0.13
242	603338	浙江鼎力	5,100	285,651.00	0.13
243	688560	明冠新材	10,225	284,152.75	0.12
244	688680	海优新材	2,283	278,115.06	0.12
245	300775	三角防务	8,100	273,618.00	0.12
246	688223	晶科能源	19,300	271,358.00	0.12
247	002623	亚玛顿	9,700	271,018.00	0.12
248	002500	山西证券	48,300	269,514.00	0.12
249	603596	伯特利	3,400	269,484.00	0.12
250	300118	东方日升	10,500	269,115.00	0.12
251	000066	中国长城	18,600	257,238.00	0.11
252	688072	拓荆科技	600	255,582.00	0.11
253	600967	内蒙一机	25,300	255,530.00	0.11
254	300035	中科电气	21,000	252,420.00	0.11
255	603315	福鞍股份	21,000	251,580.00	0.11
256	002772	众兴菌业	22,200	250,860.00	0.11
257	300890	翔丰华	6,100	250,710.00	0.11

258	603659	璞泰来	6,535	249,767.70	0.11
259	601985	中国核电	35,200	248,160.00	0.11
260	600884	杉杉股份	16,365	247,766.10	0.11
261	688772	珠海冠宇	12,270	247,240.50	0.11
262	300207	欣旺达	15,100	246,432.00	0.11
263	688567	孚能科技	11,315	244,290.85	0.11
264	600339	中油工程	60,000	244,200.00	0.11
265	600482	中国动力	10,400	243,776.00	0.11
266	601877	正泰电器	8,800	243,320.00	0.11
267	688122	西部超导	4,335	241,589.55	0.11
268	002731	萃华珠宝	16,800	239,736.00	0.11
269	000729	燕京啤酒	18,900	235,683.00	0.10
270	600208	新湖中宝	94,600	234,608.00	0.10
271	002128	电投能源	17,600	232,672.00	0.10
272	301117	佳缘科技	3,600	232,632.00	0.10
273	002673	西部证券	36,600	232,410.00	0.10
274	601298	青岛港	33,000	230,010.00	0.10
275	000155	川能动力	15,900	228,960.00	0.10
276	002468	申通快递	21,000	227,220.00	0.10
277	603283	赛腾股份	5,100	226,950.00	0.10
278	000537	广宇发展	19,200	224,064.00	0.10
279	600021	上海电力	20,700	222,939.00	0.10
280	688737	中自科技	5,709	222,593.91	0.10
281	002939	长城证券	27,300	221,949.00	0.10
282	688718	唯赛勃	12,775	221,135.25	0.10
283	688211	中科微至	4,891	220,926.47	0.10
284	688621	阳光诺和	3,753	220,751.46	0.10
285	300736	百邦科技	18,100	220,639.00	0.10
286	605077	华康股份	8,300	219,784.00	0.10
287	688556	高测股份	4,135	219,733.90	0.10
288	600847	万里股份	17,900	218,559.00	0.10
289	002852	道道全	16,900	218,517.00	0.10
290	000691	亚太实业	50,000	218,000.00	0.10
291	002998	优彩资源	30,700	217,970.00	0.10
292	002103	广博股份	36,300	217,437.00	0.10
293	600510	黑牡丹	35,800	217,306.00	0.10
294	300622	博士眼镜	9,200	217,120.00	0.10
295	002782	可立克	14,200	217,118.00	0.10
296	002078	太阳纸业	20,300	217,007.00	0.10

297	603861	白云电器	22,600	216,960.00	0.10
298	600051	宁波联合	29,800	216,944.00	0.10
299	603466	风语筑	15,600	216,840.00	0.10
300	605167	利柏特	22,400	216,832.00	0.10
301	300619	金银河	3,500	216,825.00	0.10
302	002104	恒宝股份	24,900	216,630.00	0.09
303	002937	兴瑞科技	8,800	216,480.00	0.09
304	688257	新锐股份	8,155	216,189.05	0.09
305	600639	浦东金桥	17,400	215,934.00	0.09
306	002912	中新赛克	4,900	215,649.00	0.09
307	603661	恒林股份	6,500	215,540.00	0.09
308	002588	史丹利	35,400	215,232.00	0.09
309	002746	仙坛股份	27,300	215,124.00	0.09
310	603508	思维列控	12,600	214,830.00	0.09
311	001218	丽臣实业	9,500	214,795.00	0.09
312	688711	宏微科技	3,680	214,691.20	0.09
313	002743	富煌钢构	37,300	214,475.00	0.09
314	600611	大众交通	72,400	214,304.00	0.09
315	301043	绿岛风	6,700	214,199.00	0.09
316	603950	长源东谷	14,300	213,928.00	0.09
317	000912	泸天化	46,700	213,886.00	0.09
318	603628	清源股份	13,500	213,705.00	0.09
319	002458	益生股份	17,300	213,655.00	0.09
320	688038	中科通达	14,281	213,643.76	0.09
321	603816	顾家家居	5,600	213,640.00	0.09
322	603787	新日股份	12,700	213,487.00	0.09
323	605287	德才股份	9,000	213,300.00	0.09
324	002779	中坚科技	8,100	213,111.00	0.09
325	688510	航亚科技	10,697	212,763.33	0.09
326	600460	士兰微	7,000	211,890.00	0.09
327	000089	深圳机场	30,200	209,890.00	0.09
328	000750	国海证券	62,200	208,370.00	0.09
329	600531	豫光金铅	32,900	207,270.00	0.09
330	301239	普瑞眼科	2,100	205,968.00	0.09
331	002973	侨银股份	17,700	205,320.00	0.09
332	600616	金枫酒业	29,700	204,336.00	0.09
333	002062	宏润建设	37,700	203,957.00	0.09
334	600603	广汇物流	29,300	203,928.00	0.09
335	600383	金地集团	28,200	203,322.00	0.09

336	000002	万科 A	14,500	203,290.00	0.09
337	603689	皖天然气	23,100	202,587.00	0.09
338	002381	双箭股份	26,200	202,264.00	0.09
339	002203	海亮股份	16,800	201,768.00	0.09
340	600048	保利发展	15,400	200,662.00	0.09
341	600637	东方明珠	25,650	200,583.00	0.09
342	002745	木林森	21,800	200,560.00	0.09
343	603927	中科软	5,200	200,512.00	0.09
344	688435	英方软件	2,728	198,925.76	0.09
345	688777	中控技术	3,157	198,196.46	0.09
346	600369	西南证券	54,200	197,830.00	0.09
347	300304	云意电气	35,600	197,224.00	0.09
348	002368	太极股份	4,700	193,499.00	0.08
349	600998	九州通	18,578	192,839.64	0.08
350	601098	中南传媒	16,320	189,312.00	0.08
351	601717	郑煤机	15,100	187,995.00	0.08
352	600079	人福医药	6,900	185,886.00	0.08
353	601077	渝农商行	51,700	185,603.00	0.08
354	002465	海格通信	17,700	183,018.00	0.08
355	600061	国投资本	25,400	180,848.00	0.08
356	600879	航天电子	20,900	177,441.00	0.08
357	600095	湘财股份	22,600	176,280.00	0.08
358	002511	中顺洁柔	15,800	176,170.00	0.08
359	000570	苏常柴 A	31,200	173,784.00	0.08
360	000818	航锦科技	5,200	173,524.00	0.08
361	000055	方大集团	34,900	172,755.00	0.08
362	600905	三峡能源	32,000	171,840.00	0.08
363	300852	四会富仕	4,100	169,986.00	0.07
364	300511	雪榕生物	22,200	168,720.00	0.07
365	603187	海容冷链	8,400	167,916.00	0.07
366	300889	爱克股份	11,200	167,664.00	0.07
367	002885	京泉华	7,660	167,294.40	0.07
368	600173	卧龙地产	31,700	167,059.00	0.07
369	002768	国恩股份	6,900	166,911.00	0.07
370	000017	深中华 A	38,600	166,752.00	0.07
371	688518	联赢激光	5,979	166,574.94	0.07
372	002580	圣阳股份	17,700	166,203.00	0.07
373	301158	德石股份	9,600	166,176.00	0.07
374	603150	万朗磁塑	6,300	166,068.00	0.07

375	600658	电子城	30,000	165,900.00	0.07
376	000913	钱江摩托	9,100	165,893.00	0.07
377	601666	平煤股份	22,000	165,880.00	0.07
378	300546	雄帝科技	9,000	165,870.00	0.07
379	301256	华融化学	18,700	165,682.00	0.07
380	300194	福安药业	42,700	165,676.00	0.07
381	688296	和达科技	9,280	165,648.00	0.07
382	600096	云天化	9,700	165,579.00	0.07
383	002215	诺普信	22,000	165,220.00	0.07
384	603136	天目湖	6,400	165,120.00	0.07
385	002871	伟隆股份	12,500	165,000.00	0.07
386	002053	云南能投	14,700	164,934.00	0.07
387	002066	瑞泰科技	13,800	164,910.00	0.07
388	603385	惠达卫浴	21,900	164,907.00	0.07
389	002952	亚世光电	9,300	164,889.00	0.07
390	300384	三联虹普	9,700	164,803.00	0.07
391	002728	特一药业	10,800	164,700.00	0.07
392	603519	立霸股份	11,100	164,502.00	0.07
393	600035	楚天高速	40,300	164,424.00	0.07
394	001230	劲旅环境	6,700	164,217.00	0.07
395	603102	百合股份	3,800	164,122.00	0.07
396	000822	山东海化	24,100	164,121.00	0.07
397	300575	中旗股份	15,800	164,004.00	0.07
398	000652	泰达股份	39,800	163,976.00	0.07
399	300951	博硕科技	3,000	163,890.00	0.07
400	600522	中天科技	10,300	163,873.00	0.07
401	603609	禾丰股份	18,000	163,800.00	0.07
402	002233	塔牌集团	21,200	163,664.00	0.07
403	002392	北京利尔	45,200	163,624.00	0.07
404	002161	远望谷	31,400	163,594.00	0.07
405	601137	博威合金	10,500	163,380.00	0.07
406	605168	三人行	1,900	163,286.00	0.07
407	605378	野马电池	7,000	163,170.00	0.07
408	600502	安徽建工	30,900	163,152.00	0.07
409	605196	华通线缆	22,900	163,048.00	0.07
410	605090	九丰能源	7,300	163,009.00	0.07
411	605123	派克新材	1,500	162,975.00	0.07
412	003002	壶化股份	10,300	162,946.00	0.07
413	600288	大恒科技	13,500	162,945.00	0.07

414	601366	利群股份	30,400	162,640.00	0.07
415	600566	济川药业	5,600	162,624.00	0.07
416	603176	汇通集团	25,400	162,560.00	0.07
417	300462	华铭智能	13,800	162,012.00	0.07
417	601038	一拖股份	13,800	162,012.00	0.07
418	600062	华润双鹤	9,300	162,006.00	0.07
419	002185	华天科技	17,600	161,920.00	0.07
420	688335	复洁环保	6,593	161,792.22	0.07
421	002968	新大正	10,700	161,677.00	0.07
422	002202	金风科技	15,200	161,424.00	0.07
423	605368	蓝天燃气	16,860	161,350.20	0.07
424	600551	时代出版	14,600	161,330.00	0.07
425	603639	海利尔	9,000	161,280.00	0.07
426	600118	中国卫星	5,700	160,797.00	0.07
427	603488	展鹏科技	20,000	160,600.00	0.07
428	688618	三旺通信	2,371	160,564.12	0.07
429	300861	美畅股份	3,700	160,469.00	0.07
430	002268	电科网安	5,700	158,859.00	0.07
431	301160	翔楼新材	4,500	158,175.00	0.07
432	600486	扬农化工	1,800	157,356.00	0.07
433	688396	华润微	3,000	157,230.00	0.07
434	300545	联得装备	5,600	155,512.00	0.07
435	003017	大洋生物	4,600	154,790.00	0.07
436	300943	春晖智控	9,100	154,336.00	0.07
437	605158	华达新材	20,200	153,520.00	0.07
438	002478	常宝股份	20,600	153,470.00	0.07
439	002038	双鹭药业	15,200	153,368.00	0.07
440	603161	科华控股	10,500	152,985.00	0.07
441	603987	康德莱	11,800	152,456.00	0.07
442	300697	电工合金	12,700	152,146.00	0.07
443	600397	安源煤业	52,200	151,380.00	0.07
444	603290	斯达半导	700	150,640.00	0.07
445	688120	华海清科	596	150,221.80	0.07
446	603109	神驰机电	8,400	149,940.00	0.07
447	002389	航天彩虹	6,700	148,807.00	0.07
448	600215	派斯林	17,400	148,770.00	0.07
449	688682	霍莱沃	1,773	148,471.02	0.07
450	002448	中原内配	21,100	147,700.00	0.06
451	300699	光威复材	4,740	146,229.00	0.06

452	000519	中兵红箭	8,000	144,720.00	0.06
453	002423	中粮资本	18,000	144,000.00	0.06
454	000413	东旭光电	82,700	142,244.00	0.06
455	300777	中简科技	3,000	141,780.00	0.06
456	003043	华亚智能	2,500	141,175.00	0.06
457	688200	华峰测控	922	141,066.00	0.06
458	605117	德业股份	940	140,577.00	0.06
459	301095	广立微	1,700	140,505.00	0.06
460	301039	中集车辆	10,600	140,238.00	0.06
461	688206	概伦电子	4,922	138,012.88	0.06
462	300604	长川科技	2,900	137,721.00	0.06
463	688060	云涌科技	2,497	137,584.70	0.06
464	688053	思科瑞	2,197	136,521.58	0.06
465	301200	大族数控	3,400	135,592.00	0.06
466	688037	芯源微	792	135,392.40	0.06
467	300155	安居宝	26,600	134,064.00	0.06
468	600583	海油工程	22,900	133,965.00	0.06
469	600571	信雅达	14,500	132,530.00	0.06
470	601619	嘉泽新能	29,100	132,405.00	0.06
471	600170	上海建工	49,100	132,079.00	0.06
472	300433	蓝思科技	11,200	131,712.00	0.06
473	301369	联动科技	1,650	131,505.00	0.06
474	688409	富创精密	1,200	130,800.00	0.06
475	600398	海澜之家	19,000	130,720.00	0.06
476	600050	中国联通	27,200	130,560.00	0.06
477	002414	高德红外	16,564	128,702.28	0.06
478	600918	中泰证券	18,000	124,380.00	0.05
479	300706	阿石创	4,200	123,396.00	0.05
480	000547	航天发展	12,300	123,000.00	0.05
481	300666	江丰电子	1,800	122,328.00	0.05
482	600416	湘电股份	6,400	122,176.00	0.05
483	003026	中晶科技	3,100	121,923.00	0.05
484	002119	康强电子	9,400	121,918.00	0.05
485	600206	有研新材	9,200	120,888.00	0.05
486	688233	神工股份	3,800	120,004.00	0.05
487	002151	北斗星通	3,400	119,544.00	0.05
488	688138	清溢光电	5,642	119,102.62	0.05
489	688035	德邦科技	2,000	118,960.00	0.05
490	605588	冠石科技	2,500	117,950.00	0.05

491	300346	南大光电	3,400	116,926.00	0.05
492	600685	中船防务	3,900	116,805.00	0.05
493	002736	国信证券	13,300	116,109.00	0.05
494	688385	复旦微电	2,280	114,228.00	0.05
495	002156	通富微电	5,000	113,000.00	0.05
496	000629	钒钛股份	28,900	112,999.00	0.05
497	600167	联美控股	16,200	112,914.00	0.05
498	300070	碧水源	21,000	112,560.00	0.05
499	000778	新兴铸管	27,400	111,792.00	0.05
500	603712	七一二	3,700	111,777.00	0.05
501	601991	大唐发电	33,600	111,216.00	0.05
502	600027	华电国际	16,500	110,385.00	0.05
503	300034	钢研高纳	2,800	110,292.00	0.05
504	603806	福斯特	2,760	102,644.40	0.04
505	301141	中科磁业	2,214	101,317.26	0.04
506	601615	明阳智能	6,000	101,280.00	0.04
507	600378	昊华科技	2,600	97,864.00	0.04
508	601198	东兴证券	12,100	97,042.00	0.04
509	002508	老板电器	3,800	96,102.00	0.04
510	688248	南网科技	2,440	93,671.60	0.04
511	003816	中国广核	29,400	91,434.00	0.04
512	600456	宝钛股份	2,700	91,368.00	0.04
513	603678	火炬电子	2,600	89,596.00	0.04
514	300373	扬杰科技	2,200	89,254.00	0.04
515	688070	纵横股份	1,919	88,082.10	0.04
516	603267	鸿远电子	1,300	84,890.00	0.04
517	603206	嘉环科技	4,900	84,525.00	0.04
518	300936	中英科技	2,500	84,350.00	0.04
519	300668	杰恩设计	3,600	84,060.00	0.04
520	688607	康众医疗	4,365	83,458.80	0.04
521	301486	致尚科技	1,446	83,376.36	0.04
522	605258	协和电子	3,200	83,136.00	0.04
523	688329	艾隆科技	2,548	82,555.20	0.04
524	002929	润建股份	1,900	82,479.00	0.04
525	600089	特变电工	3,700	82,473.00	0.04
526	000042	中洲控股	11,000	82,280.00	0.04
526	600156	华升股份	18,700	82,280.00	0.04
527	600356	恒丰纸业	10,500	82,215.00	0.04
528	600857	宁波中百	8,300	82,170.00	0.04

529	688681	科汇股份	5,080	82,092.80	0.04
530	600361	创新新材	17,100	82,080.00	0.04
531	688178	万德斯	4,233	82,077.87	0.04
532	301395	仁信新材	3,074	82,014.32	0.04
533	301197	工大科雅	3,400	81,940.00	0.04
534	300593	新雷能	3,570	81,788.70	0.04
535	002391	长青股份	11,900	81,753.00	0.04
536	000850	华茂股份	22,000	81,620.00	0.04
537	601698	中国卫通	4,100	81,508.00	0.04
538	603586	金麒麟	5,100	81,447.00	0.04
539	301097	天益医疗	1,700	81,311.00	0.04
540	300693	盛弘股份	2,200	81,224.00	0.04
541	002976	瑞玛精密	2,900	81,113.00	0.04
542	300854	中兰环保	5,100	81,090.00	0.04
543	003031	中瓷电子	600	79,872.00	0.04
544	300763	锦浪科技	750	78,075.00	0.03
545	301050	雷电微力	1,200	77,916.00	0.03
546	600562	国睿科技	4,800	77,760.00	0.03
547	301292	海科新源	3,766	75,282.34	0.03
548	000686	东北证券	10,600	73,564.00	0.03
549	601611	中国核建	8,700	73,515.00	0.03
550	601865	福莱特	1,900	73,169.00	0.03
551	002384	东山精密	2,800	72,520.00	0.03
552	002444	巨星科技	3,300	72,204.00	0.03
553	000060	中金岭南	15,100	71,725.00	0.03
554	300726	宏达电子	1,600	71,552.00	0.03
555	000400	许继电气	3,100	71,455.00	0.03
556	301488	豪恩汽电	1,795	71,405.10	0.03
557	600529	山东药玻	2,600	70,772.00	0.03
558	002155	湖南黄金	5,800	70,760.00	0.03
559	300144	宋城演艺	5,700	70,680.00	0.03
560	600166	福田汽车	20,600	70,040.00	0.03
561	002439	启明星辰	2,300	68,448.00	0.03
562	688520	神州细胞-U	1,200	68,088.00	0.03
563	300724	捷佳伟创	600	67,410.00	0.03
564	688603	天承科技	1,078	59,290.00	0.03
565	002338	奥普光电	1,400	59,010.00	0.03
566	300762	上海瀚讯	4,800	56,496.00	0.02
567	601888	中国中免	500	55,265.00	0.02

568	600764	中国海防	2,000	54,440.00	0.02
569	688021	奥福环保	2,075	53,784.00	0.02
570	000020	深华发 A	4,600	53,222.00	0.02
571	688033	天宜上佳	2,760	52,771.20	0.02
572	000538	云南白药	1,000	52,480.00	0.02
573	301211	亨迪药业	2,100	52,290.00	0.02
574	605222	起帆电缆	2,500	51,650.00	0.02
575	601028	玉龙股份	4,800	51,600.00	0.02
576	002990	盛视科技	1,400	51,520.00	0.02
577	603071	物产环能	3,100	51,429.00	0.02
578	002080	中材科技	2,500	51,300.00	0.02
579	603020	爱普股份	5,600	51,296.00	0.02
580	300872	天阳科技	3,300	51,282.00	0.02
581	600410	华胜天成	6,900	51,198.00	0.02
582	301149	隆华新材	4,900	51,156.00	0.02
583	002017	东信和平	3,900	51,129.00	0.02
584	603366	日出东方	8,800	51,128.00	0.02
585	000338	潍柴动力	4,100	51,086.00	0.02
586	601311	骆驼股份	5,500	51,040.00	0.02
587	002234	民和股份	2,800	50,988.00	0.02
588	002701	奥瑞金	11,300	50,963.00	0.02
589	002077	大港股份	3,400	50,830.00	0.02
590	603507	振江股份	1,400	50,764.00	0.02
591	000685	中山公用	6,700	50,719.00	0.02
592	603949	雪龙集团	3,200	50,496.00	0.02
593	300332	天壕能源	4,400	50,468.00	0.02
594	002275	桂林三金	2,800	50,428.00	0.02
595	000625	长安汽车	3,900	50,427.00	0.02
596	002335	科华数据	1,400	50,330.00	0.02
597	600576	祥源文旅	6,300	50,211.00	0.02
598	688299	长阳科技	3,200	50,144.00	0.02
599	603719	良品铺子	2,000	50,020.00	0.02
600	600320	振华重工	13,400	49,982.00	0.02
601	000605	渤海股份	7,900	49,928.00	0.02
602	603768	常青股份	2,800	49,756.00	0.02
603	300443	金雷股份	1,400	49,630.00	0.02
604	603567	珍宝岛	3,300	49,368.00	0.02
605	301261	恒工精密	1,325	48,892.50	0.02
606	300123	亚光科技	6,700	48,776.00	0.02

607	688303	大全能源	1,200	48,540.00	0.02
608	601606	长城军工	3,500	47,845.00	0.02
609	688593	新相微	2,748	46,572.03	0.02
610	688352	颀中科技	3,417	45,420.66	0.02
611	301262	海看股份	1,651	45,288.37	0.02
612	300527	中船应急	4,600	43,700.00	0.02
613	002935	天奥电子	2,071	40,964.38	0.02
614	000561	烽火电子	3,500	40,495.00	0.02
615	300696	爱乐达	1,640	40,344.00	0.02
616	300900	广联航空	1,400	40,334.00	0.02
617	600990	四创电子	1,190	37,651.60	0.02
618	001286	陕西能源	3,767	37,406.31	0.02
619	600864	哈投股份	6,900	35,259.00	0.02
620	688779	长远锂科	2,974	33,516.98	0.01
621	300629	新劲刚	1,564	32,265.32	0.01
622	600184	光电股份	2,400	31,512.00	0.01
623	300424	航新科技	1,900	27,892.00	0.01
624	688778	厦钨新能	560	27,720.00	0.01
625	688707	振华新材	884	27,218.36	0.01
626	688479	友车科技	848	26,433.91	0.01
627	600390	五矿资本	4,800	25,824.00	0.01
628	002507	涪陵榨菜	1,410	25,817.10	0.01
629	600155	华创云信	4,100	25,502.00	0.01
630	600298	安琪酵母	700	25,347.00	0.01
631	688249	晶合集成	1,370	24,755.90	0.01
632	603589	口子窖	500	24,675.00	0.01
633	300581	晨曦航空	2,210	24,420.50	0.01
634	003009	中天火箭	400	24,100.00	0.01
635	300772	运达股份	1,860	23,956.80	0.01
636	002933	新兴装备	800	23,496.00	0.01
637	300722	新余国科	710	23,259.60	0.01
638	001209	洪兴股份	1,300	23,153.00	0.01
639	300875	捷强装备	500	20,015.00	0.01
640	300922	天秦装备	1,000	19,990.00	0.01
641	301293	三博脑科	230	17,507.60	0.01
642	688361	中科飞测-U	216	17,029.44	0.01
643	301317	鑫磊股份	625	16,337.50	0.01
644	603137	恒尚节能	782	15,017.38	0.01
645	301320	豪江智能	642	14,868.72	0.01

646	688700	东威科技	148	14,760.04	0.01
647	688472	阿特斯	849	14,628.27	0.01
648	301419	阿莱德	330	14,447.40	0.01
649	301358	湖南裕能	336	14,400.96	0.01
650	688469	中芯集成-U	2,553	13,913.85	0.01
651	301325	曼恩斯特	123	13,459.89	0.01
652	688630	芯碁微装	160	13,443.20	0.01
653	688629	华丰科技	587	12,978.57	0.01
654	688668	鼎通科技	130	12,714.00	0.01
655	301260	格力博	525	12,400.50	0.01
656	688531	日联科技	87	12,101.70	0.01
657	688661	和林微纳	172	12,091.60	0.01
658	688391	钜泉科技	171	11,740.86	0.01
659	688562	航天软件	459	11,635.65	0.01
660	301303	真兰仪表	508	11,338.56	0.00
661	301310	鑫宏业	173	11,321.12	0.00
662	688489	三未信安	178	11,258.50	0.00
663	688478	晶升股份	257	11,107.54	0.00
664	688768	容知日新	132	10,542.84	0.00
665	301315	威士顿	189	10,506.51	0.00
666	688766	普冉股份	98	10,468.36	0.00
667	688582	芯动联科	232	10,453.92	0.00
668	688484	南芯科技	257	9,935.62	0.00
669	688301	奕瑞科技	35	9,885.05	0.00
670	688258	卓易信息	147	9,809.31	0.00
671	301408	华人健康	578	9,797.10	0.00
672	688155	先惠技术	180	9,766.80	0.00
673	301387	光大同创	214	9,764.82	0.00
674	688123	聚辰股份	180	9,669.60	0.00
675	301307	美利信	302	9,664.00	0.00
676	301429	森泰股份	444	9,408.36	0.00
677	688205	德科立	128	9,359.36	0.00
678	301399	英特科技	181	9,348.65	0.00
679	301246	宏源药业	304	9,335.84	0.00
680	688535	华海诚科	161	8,811.53	0.00
681	301291	明阳电气	277	8,744.89	0.00
682	301360	荣旗科技	94	8,724.14	0.00
683	301382	蜂助手	242	8,687.80	0.00
684	688146	中船特气	219	8,613.27	0.00

685	301383	天键股份	238	8,501.36	0.00
686	688399	硕世生物	151	8,335.20	0.00
687	688458	美芯晟	91	8,276.45	0.00
688	688543	国科军工	151	8,111.72	0.00
689	688620	安凯微	613	7,852.53	0.00
690	001287	中电港	310	7,849.20	0.00
691	688523	航天环宇	308	7,835.52	0.00
692	301225	恒勃股份	226	7,747.28	0.00
693	301373	凌玮科技	239	7,609.76	0.00
694	301295	美硕科技	206	7,574.62	0.00
695	301210	金杨股份	150	7,456.50	0.00
696	688799	华纳药厂	182	7,392.84	0.00
697	688334	西高院	419	7,206.80	0.00
698	688552	航天南湖	297	7,181.46	0.00
699	688433	华曙高科	221	7,023.38	0.00
700	301357	北方长龙	140	6,871.20	0.00
701	301428	世纪恒通	204	6,783.00	0.00
702	688217	睿昂基因	167	6,705.05	0.00
703	301281	科源制药	263	6,669.68	0.00
704	688429	时创能源	238	6,635.44	0.00
705	688056	莱伯泰科	149	6,606.66	0.00
706	301332	德尔玛	477	6,553.98	0.00
707	002139	拓邦股份	500	6,525.00	0.00
708	301157	华塑科技	123	6,509.16	0.00
709	688581	安杰思	54	6,375.78	0.00
710	301305	朗坤环境	318	6,305.94	0.00
711	301203	国泰环保	180	6,292.80	0.00
712	301397	溯联股份	153	6,262.29	0.00
713	688512	慧智微-U	325	6,249.75	0.00
714	301386	未来电器	261	6,209.19	0.00
715	688539	高华科技	133	6,171.20	0.00
716	688611	杭州柯林	143	6,127.55	0.00
717	688570	天玛智控	239	6,084.94	0.00
718	301355	南王科技	351	6,047.73	0.00
719	301232	飞沃科技	103	6,023.44	0.00
720	301376	致欧科技	262	5,913.34	0.00
721	300804	广康生化	177	5,858.70	0.00
722	688508	芯朋微	100	5,799.00	0.00
723	301439	泓淋电力	342	5,779.80	0.00

724	688048	长光华芯	60	5,671.20	0.00
725	301323	新莱福	137	5,632.07	0.00
726	688228	开普云	108	5,546.88	0.00
727	688251	井松智能	180	5,490.00	0.00
728	301337	亚华电子	168	5,418.00	0.00
729	688008	澜起科技	94	5,397.48	0.00
730	301170	锡南科技	150	5,341.50	0.00
731	002931	锋龙股份	400	5,220.00	0.00
732	688022	瀚川智能	141	5,094.33	0.00
733	688631	莱斯信息	163	5,035.07	0.00
734	688623	双元科技	56	5,001.36	0.00
735	603135	中重科技	251	4,791.59	0.00
736	688196	卓越新能	99	4,578.75	0.00
737	301345	涛涛车业	97	4,524.08	0.00
738	688358	祥生医疗	88	4,488.00	0.00
739	688090	瑞松科技	115	4,246.95	0.00
740	688159	有方科技	104	4,116.32	0.00
741	688338	赛科希德	73	4,047.85	0.00
742	688683	莱尔科技	178	3,960.50	0.00
743	688278	特宝生物	90	3,951.90	0.00
744	001380	华纬科技	127	3,917.95	0.00
745	688262	国芯科技	93	3,784.17	0.00
746	601065	江盐集团	296	3,726.64	0.00
747	688011	新光光电	142	3,666.44	0.00
748	688218	江苏北人	160	3,521.60	0.00
749	601133	柏诚股份	251	3,443.72	0.00
750	688109	品茗科技	129	3,341.10	0.00
751	688030	山石网科	154	3,300.22	0.00
752	688400	凌云光	108	3,291.84	0.00
753	688088	虹软科技	76	3,249.00	0.00
754	688058	宝兰德	57	3,248.43	0.00
755	001328	登康口腔	108	3,217.32	0.00
756	688288	鸿泉物联	125	3,177.50	0.00
757	688069	德林海	140	2,973.60	0.00
758	688601	力芯微	60	2,826.00	0.00
759	688600	皖仪科技	113	2,801.27	0.00
760	688377	迪威尔	110	2,755.50	0.00
761	688066	航天宏图	43	2,618.70	0.00
762	001282	三联锻造	78	2,583.36	0.00

763	688202	美迪西	30	2,557.50	0.00
764	688677	海泰新光	45	2,553.30	0.00
765	001360	南矿集团	152	2,500.40	0.00
766	688225	亚信安全	114	2,388.30	0.00
767	603125	常青科技	88	2,332.88	0.00
768	001324	长青科技	114	2,283.42	0.00
769	001367	海森药业	52	2,212.60	0.00
770	688501	青达环保	92	2,047.00	0.00
771	603172	万丰股份	122	2,034.96	0.00
772	688322	奥比中光-UW	47	1,960.84	0.00
773	688626	翔宇医疗	43	1,956.93	0.00
774	688669	聚石化学	107	1,939.91	0.00
775	688559	海目星	40	1,880.40	0.00
776	688226	威腾电气	86	1,876.52	0.00
777	688219	会通股份	194	1,852.70	0.00
778	688260	昀冢科技	100	1,838.00	0.00
779	688071	华依科技	29	1,773.35	0.00
780	688093	世华科技	77	1,544.62	0.00
781	688039	当虹科技	41	1,469.44	0.00
782	688015	交控科技	80	1,397.60	0.00
783	688106	金宏气体	49	1,332.80	0.00
784	688004	博汇科技	38	1,328.86	0.00
785	688096	京源环保	130	1,279.20	0.00
786	688369	致远互联	22	1,216.60	0.00
787	688557	兰剑智能	28	987.84	0.00
788	688468	科美诊断	97	921.50	0.00
789	688330	宏力达	22	771.76	0.00
790	688528	秦川物联	67	717.57	0.00
791	688981	中芯国际	14	707.28	0.00
792	688378	奥来德	14	691.60	0.00
793	688010	福光股份	27	658.80	0.00
794	688102	斯瑞新材	40	488.00	0.00
795	688579	山大地纬	19	313.12	0.00
796	688312	燕麦科技	15	291.15	0.00
797	688655	迅捷兴	16	263.04	0.00
798	688013	天臣医疗	10	237.10	0.00
799	688148	芳源股份	19	231.80	0.00
800	688239	航宇科技	3	209.85	0.00
801	688183	生益电子	16	193.60	0.00

802	688215	瑞晟智能	4	157.76	0.00
803	688285	高铁电气	15	150.00	0.00
804	688101	三达膜	9	120.06	0.00
805	688609	九联科技	10	119.00	0.00
806	688298	东方生物	2	75.44	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	002594	比亚迪	4,370,055.00	1.76
2	603260	合盛硅业	4,221,680.00	1.70
3	688390	固德威	3,331,920.50	1.34
4	603688	石英股份	3,086,158.00	1.24
5	688063	派能科技	2,927,878.48	1.18
6	002056	横店东磁	2,840,343.00	1.14
7	601958	金钼股份	2,749,207.00	1.11
8	002738	中矿资源	2,698,709.60	1.09
9	002603	以岭药业	2,633,302.00	1.06
10	002250	联化科技	2,307,044.00	0.93
11	300136	信维通信	2,258,155.00	0.91
12	000997	新大陆	2,244,629.00	0.90
13	000739	普洛药业	2,207,257.00	0.89
14	000988	华工科技	2,136,940.00	0.86
15	002739	万达电影	2,038,887.37	0.82
16	002422	科伦药业	2,027,993.00	0.82
17	601668	中国建筑	2,025,541.00	0.81
18	002409	雅克科技	2,022,090.00	0.81
19	600173	卧龙地产	2,018,044.00	0.81
20	688006	杭可科技	1,997,492.80	0.80

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	603260	合盛硅业	4,332,373.00	1.74
2	002738	中矿资源	3,638,049.80	1.46
3	002850	科达利	3,617,259.28	1.45
4	688063	派能科技	3,370,076.65	1.36
5	300115	长盈精密	3,330,946.00	1.34
6	688390	固德威	2,917,893.25	1.17
7	000878	云南铜业	2,913,683.00	1.17
8	002192	融捷股份	2,901,686.00	1.17
9	300073	当升科技	2,851,774.09	1.15
10	601231	环旭电子	2,842,022.40	1.14
11	002384	东山精密	2,810,631.08	1.13
12	300861	美畅股份	2,716,350.60	1.09
13	300568	星源材质	2,680,324.00	1.08
14	603613	国联股份	2,629,518.46	1.06
15	002497	雅化集团	2,500,302.00	1.01
16	002048	宁波华翔	2,470,845.00	0.99
17	601869	长飞光纤	2,436,136.00	0.98
18	002603	以岭药业	2,425,806.77	0.98
19	300832	新产业	2,404,927.00	0.97
20	300136	信维通信	2,359,117.00	0.95

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	850,925,411.45
卖出股票收入（成交）总额	874,423,760.57

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

本报告期内，本基金未投资于国债期货。

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

睿创微纳（代码：688002）

因股份支付费用、购买理财产品情况披露不准确，2022 年 7 月 29 日，中国证券监督管理委员会山东监管局对睿创微纳采取责令改正的行政监管措施。

因对限制性股票激励计划的会计处理出现差错，导致 2021 年、2022 年多期定期报告相关财务信息披露不准确，2022 年 10 月 10 日，上海证券交易所对睿创微纳予以通报批评。

本基金为量化投资基金，采用量化选股模型构建股票组合，投资决策符合本基金合同约定及

公司投资决策制度规定。

本基金除睿创微纳外，投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	303,036.83
2	应收清算款	663,197.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	49,925.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,016,159.73

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	710	100,867.10	1,422.51	0.00%	71,614,215.66	100.00%
中航量化阿尔法六个月持有 C	1,393	141,139.38	-	-	196,607,150.63	100.00%
合计	2,103	127,542.93	1,422.51	0.00%	268,221,366.29	100.00%

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	834,009.27	1.16%
	中航量化阿尔法六个月持有 C	1,900,367.01	0.97%
	合计	2,734,376.28	1.02%

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	77,208,340.07	217,188,462.10
本报告期基金总申购份额	326,124.06	294,069.42
减：本报告期基金总赎回份额	5,918,825.96	20,875,380.89
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	71,615,638.17	196,607,150.63

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

本报告期内未召开持有人大会。

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、2023 年 6 月 2 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告》，王君彧先生担任中航基金管理有限公司首席信息官。
- 2、本报告期内，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	基金管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 3 月 2 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到的具体措施类型	暂停新增私募资管产品备案 3 个月的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	部分产品主动管理责任履行不到位，部分内部控制制度不完善或执行不到位。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司积极进行整改，截至报告期末，已完成全部整改工作。
其他	截至本报告披露日，整改成果已经监管机构验收通过。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	
国金证券股份有限公司	2	583,202,072.31	33.97%	426,492.47	33.96%	-
东吴证券股份有限公司	2	558,911,295.27	32.55%	408,742.30	32.55%	-
中航证券有限公司	2	345,372,830.58	20.11%	252,563.18	20.11%	-
东方财富证券股份有限公司	1	229,580,087.12	13.37%	167,895.47	13.37%	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	新增
华金证券	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 4 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
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

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	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 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 1 月 20 日
2	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品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	2023 年 3 月 24 日
3	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2022 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023 年 3 月 30 日
4	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2023 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	2023 年 4 月 21 日
5	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品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	2023 年 5 月 19 日
6	中航基金管理有限公司关于首席信息官任职的公告	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	2023 年 6 月 2 日

		网站	
7	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品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	2023 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

本基金报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 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规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 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 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
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

2023 年 8 月 29 日