

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券  
投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告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 2024 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.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产变动表.....	17

6.4 报表附注 .....	19
<b>§ 7 投资组合报告 .....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	70
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	73
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	73
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 .....	73
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 .....	73
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	73
7.12 投资组合报告附注 .....	73
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>76</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
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 .....	76
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>77</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>78</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	78
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
10.4 基金投资策略的改变 .....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
10.8 其他重大事件 .....	80
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>81</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 .....	81

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	81
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>82</b>
12.1 备查文件目录 .....	82
12.2 存放地点 .....	82
12.3 查阅方式 .....	82

## § 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	220,043,659.59 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	62,275,250.26 份	157,768,409.33 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	刘建
	联系电话	010-56716166
	电子邮箱	liujian@avicfund.cn
客户服务电话	400-666-2186	400-61-95555
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(2024年1月1日 - 2024年6月30日)	报告期(2024年1月1日 - 2024年6月30日)
本期已实现收益	-7,470,095.65	-19,341,745.61
本期利润	-5,671,479.69	-14,640,436.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0876	-0.0887
本期加权平均净值利润率	-11.86%	-12.19%
本期基金份额净值增长率	-11.29%	-11.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-19,312,947.16	-50,774,639.92
期末可供分配基金份额利润	-0.3101	-0.3218
期末基金资产净值	42,962,303.10	106,993,769.41
期末基金份额净值	0.6899	0.6782
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-31.01%	-32.18%

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	-4.25%	0.76%	-5.75%	0.81%	1.50%	-0.05%
过去三个月	-12.23%	1.39%	-5.25%	0.97%	-6.98%	0.42%
过去六个月	-11.29%	1.54%	-6.96%	1.36%	-4.33%	0.18%
过去一年	-19.55%	1.21%	-14.21%	1.08%	-5.34%	0.13%
自基金合同	-31.01%	1.13%	-24.46%	1.02%	-6.55%	0.11%

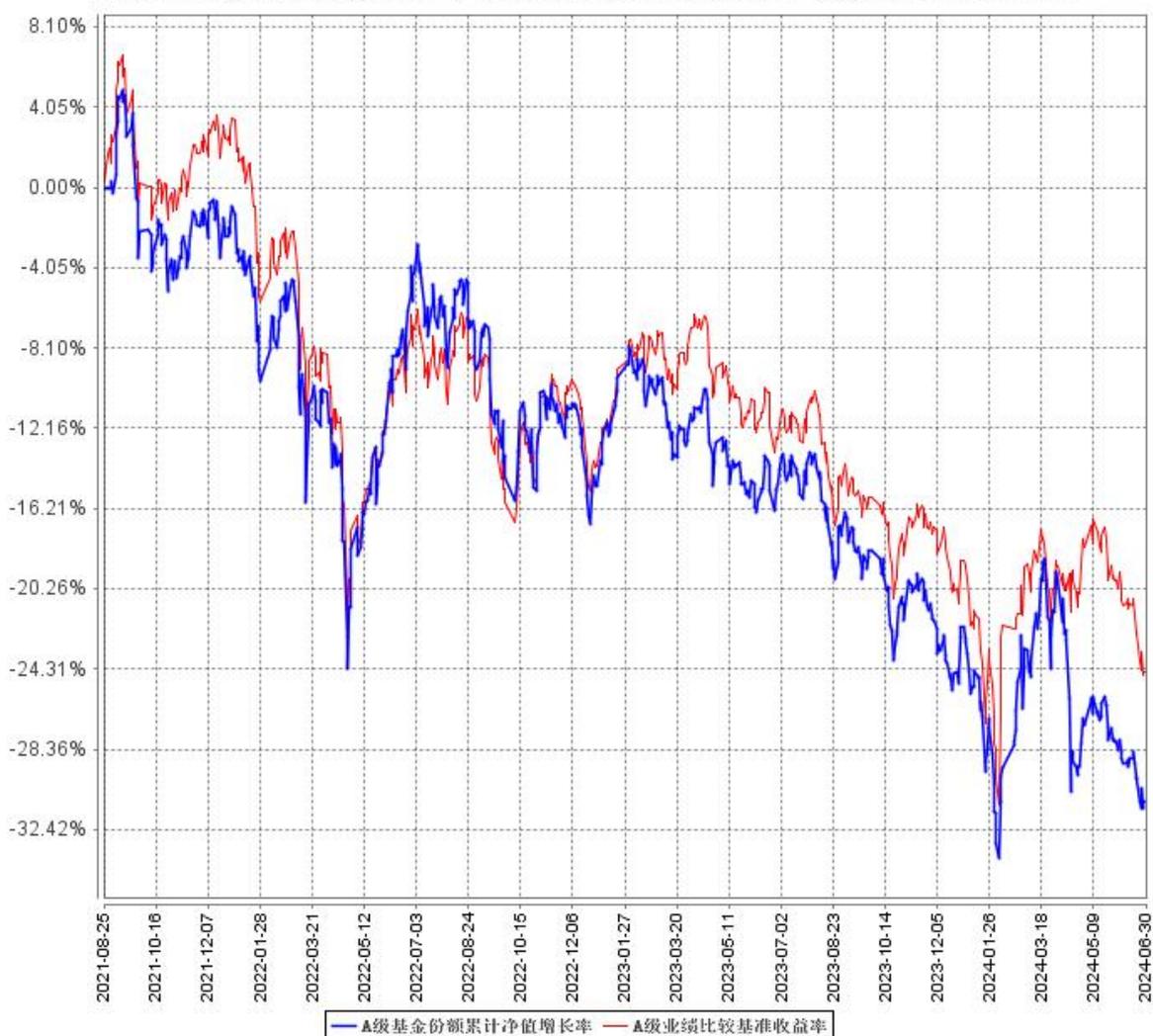
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

中航量化阿尔法六个月持有 C

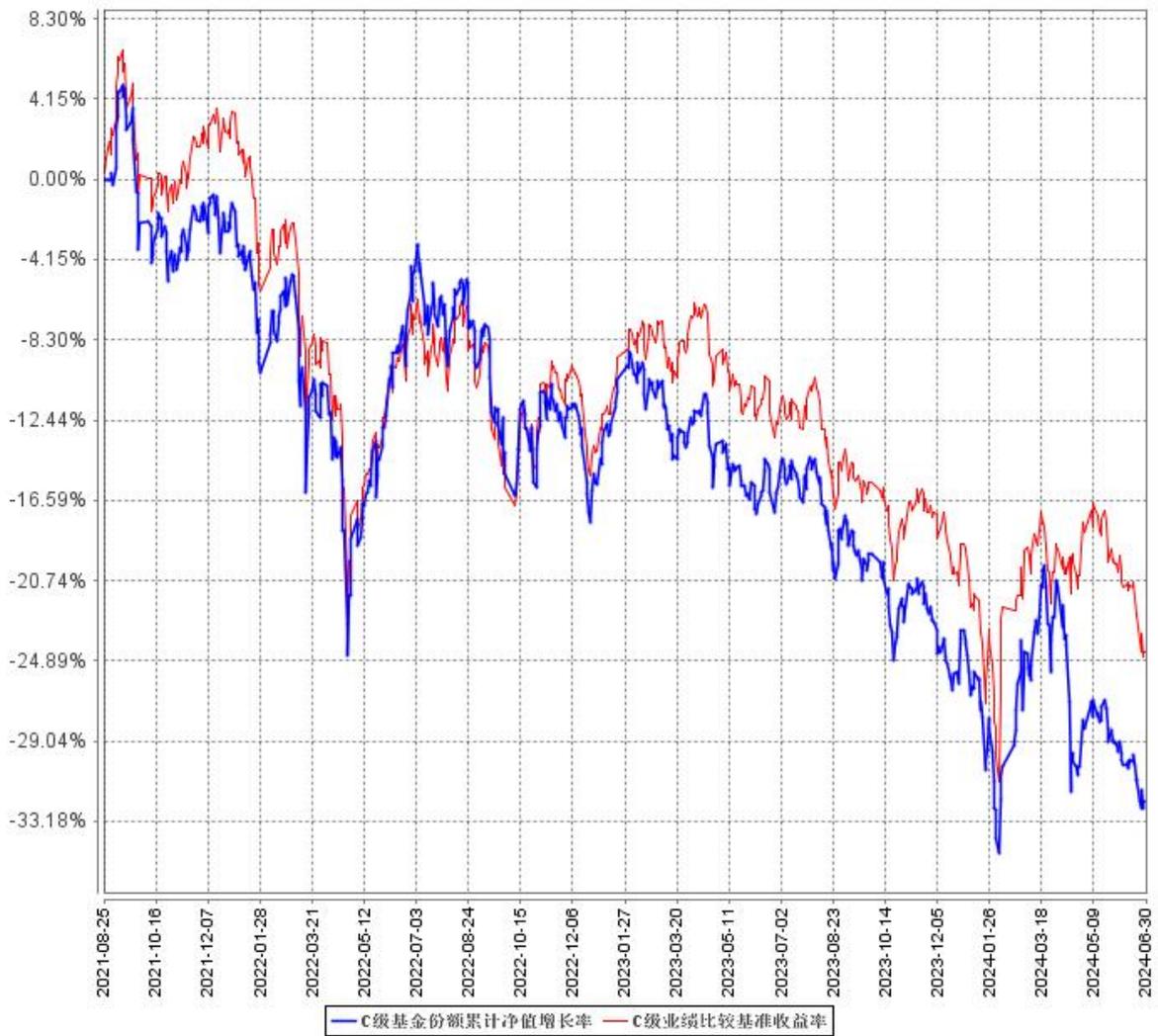
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.29%	0.76%	-5.75%	0.81%	1.46%	-0.05%
过去三个月	-12.35%	1.39%	-5.25%	0.97%	-7.10%	0.42%
过去六个月	-11.55%	1.54%	-6.96%	1.36%	-4.59%	0.18%
过去一年	-20.03%	1.21%	-14.21%	1.08%	-5.82%	0.13%
自基金合同生效起至今	-32.18%	1.13%	-24.46%	1.02%	-7.72%	0.11%

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



## § 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。
--	--	--	--	--	--------------------

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、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，力争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，市场风格出现罕见的剧烈波动，小微盘风格受流动性冲击、市场情绪等多重因素影响，上半年出现较大幅度的下跌，其中以年初和 4 月中旬的两轮下跌最为剧烈。本基金以基

本面量化模型为选股依据，在全市场范围内筛选的基本面和估值性价比优良的个股，虽并未主动暴露小市值敞口，但由于选股的范围超出大中盘宽基指数成分的范畴，在这样的市场风格中还是受到一定的影响，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 0.6899 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.29%；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 0.6782 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.55%；同期业绩比较基准收益率为-6.96%。

#### 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，随着稳增长政策的加码和落地、市场制度不断优化改善，投资者情绪有望得到恢复，结合美联储降息预期的逐步明朗，海外配置资金流向的趋势也有望边际向好，A 股下半年的重心或较上半年抬升。风格上，当前质量、成长因子拥挤度较低，A 股优质资产的性价比来到了历史上较高的位置，胜率和赔率都具有吸引力，也是我们下半年关注的重点方向。

#### 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

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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	13,697,039.42	14,530,643.47
结算备付金		1,432,318.88	1,032,044.38
存出保证金		67,963.64	25,543.81
交易性金融资产	6.4.7.2	135,852,750.39	170,644,205.42
其中：股票投资		135,852,750.39	170,644,205.42
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		30,417.59	1,904,442.60
应收股利		-	-
应收申购款		500.00	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		151,080,989.92	188,136,879.68
<b>负债和净资产</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		-	640,392.20

应付赎回款		47,423.60	396,633.22
应付管理人报酬		152,065.03	188,334.93
应付托管费		25,344.17	31,389.17
应付销售服务费		54,226.88	67,677.64
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	845,857.73	554,855.95
负债合计		1,124,917.41	1,879,283.11
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	220,043,659.59	241,951,679.74
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-70,087,587.08	-55,694,083.17
净资产合计		149,956,072.51	186,257,596.57
负债和净资产总计		151,080,989.92	188,136,879.68

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 220,043,659.59 份，其中中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值 0.6899 元，份额总额 62,275,250.26 份；中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值 0.6782 元，份额总额 157,768,409.33 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-18,708,503.17	5,156,460.28
1.利息收入		42,190.52	52,024.66
其中：存款利息收入	6.4.7.13	42,190.52	52,024.66
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-25,250,619.08	-1,882,516.59
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-26,774,533.43	-3,934,479.43
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	4.57	-

股利收益	6.4.7.19	1, 523, 909. 78	2, 051, 962. 84
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, 499, 925. 39	6, 986, 952. 21
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>		1, 603, 412. 70	2, 734, 095. 64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1, 001, 730. 56	1, 819, 466. 65
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	166, 955. 07	303, 244. 41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	358, 263. 35	533, 921. 05
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	76, 463. 72	77, 463. 53
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-20, 311, 915. 87	2, 422, 364. 64
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-20, 311, 915. 87	2, 422, 364. 64
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-20, 311, 915. 87	2, 422, 364. 64

### 6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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	241,951,679.74	-	-55,694,083.17	186,257,596.57

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	241,951,679.74	-	-55,694,083.17	186,257,596.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,908,020.15	-	-14,393,503.91	-36,301,524.06
（一）、综合收益总额	-	-	-20,311,915.87	-20,311,915.87
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-21,908,020.15	-	5,918,411.96	-15,989,608.19
其中：1.基金申购款	75,279.55	-	-20,595.23	54,684.32
2.基金赎回款	-21,983,299.70	-	5,939,007.19	-16,044,292.51
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	220,043,659.59	-	-70,087,587.08	149,956,072.51
项目	上年度可比期间			
	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	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	268,222,788.80	-	-40,061,460.53	228,161,328.27

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颁布和修订的《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”)、《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会制定的《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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 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》、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. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	13,697,039.42
等于：本金	13,695,676.22
加：应计利息	1,363.20
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	13,697,039.42

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	142,574,387.66	-	135,852,750.39	-6,721,637.27
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债	-	-	-	-
交易所市场	-	-	-	-
银行间市场	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	142,574,387.66	-	135,852,750.39	-6,721,637.27

### 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 2024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	772,759.25
其中：交易所市场	772,759.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	73,098.48
合计	845,857.73

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 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,576,433.04	67,576,433.04
本期申购	41,196.64	41,196.64
本期赎回(以“-”号填列)	-5,342,379.42	-5,342,379.42
- 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	62,275,250.26	62,275,250.26

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,375,246.70	174,375,246.70
本期申购	34,082.91	34,082.91
本期赎回(以“-”号填列)	-16,640,920.28	-16,640,920.28
- 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	157,768,409.33	157,768,409.33

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
上年度末	-12,127,137.83	-2,896,954.62	-15,024,092.45
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-12,127,137.83	-2,896,954.62	-15,024,092.45
本期利润	-7,470,095.65	1,798,615.96	-5,671,479.69
本期基金份额交易产生的变动数	1,351,282.47	31,342.51	1,382,624.98
其中：基金申购款	-12,482.84	1,100.52	-11,382.32
基金赎回款	1,363,765.31	30,241.99	1,394,007.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-18,245,951.01	-1,066,996.15	-19,312,947.16

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

上年度末	-33,244,167.15	-7,425,823.57	-40,669,990.72
加：会计政策变更（若有）	-	-	-
前期差错更正（若有）	-	-	-
其他（若有）	-	-	-
本期期初	-33,244,167.15	-7,425,823.57	-40,669,990.72
本期利润	-19,341,745.61	4,701,309.43	-14,640,436.18
本期基金份额交易产生的变动数	4,517,388.75	18,398.23	4,535,786.98
其中：基金申购款	-9,309.81	96.90	-9,212.91
基金赎回款	4,526,698.56	18,301.33	4,544,999.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-48,068,524.01	-2,706,115.91	-50,774,639.92

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	25,416.21
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	16,394.74
其他	379.57
合计	42,190.52

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	1,471,034,045.70
减：卖出股票成本总额	1,494,704,863.04
减：交易费用	3,103,716.09
买卖股票差价收入	-26,774,533.43

## **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**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货投资收益	4.57

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,523,909.78
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,523,909.78

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	6,499,925.39
——股票投资	6,499,925.39
——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	6,499,925.39
----	--------------

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	13,426.14
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款费	3,365.24
合计	76,463.72

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	9,723,348.60	0.33%	345,372,830.58	20.11%

##### 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 2024年1月1日至2024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	7,252.14	0.33%	7,252.14	0.94%
关联方名称	上年度可比期间 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%

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。

## 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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,001,730.56	1,819,466.65
其中：支付销售机构的客户维护费	491,293.11	893,275.02
应支付基金管理人的净管理费	510,437.45	926,191.63

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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	166,955.07	303,244.41

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	350,284.11	350,284.11
中航基金管理有限公司	-	21.64	21.64
中航证券有限公司	-	7,178.91	7,178.91
合计	-	357,484.66	357,484.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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自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自有资金投资本基金。

**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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	14,808,907.50	42,190.52	24,541,278.00	52,024.66

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（2024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
603350	安乃达	2024年6月26日	1个月以内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	785	16,139.60	16,139.60	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月以内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	740	13,801.00	13,801.00	-
688717	艾罗能源	2023年12月26日	1-6个月(含)	网下配售锁定	55.66	46.96	2,672	148,723.52	125,477.12	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	1-6个月(含)	网下配售锁定	126.89	188.33	354	24,997.33	66,668.82	锁定期送股
301392	汇成真空	2024年5月28日	1-6个月(含)	网下配售锁定	12.20	55.87	219	2,671.80	12,235.53	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	1-6个月(含)	网下配售锁定	86.96	209.54	53	4,608.88	11,105.62	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	1-6个月(含)	网下配售锁定	55.82	91.22	113	4,521.42	10,307.86	锁定期送股
301536	星辰科技	2024年3月20日	1-6个月(含)	网下配售锁定	16.16	32.26	300	4,848.00	9,678.00	-
688691	灿芯股份	2024年4月2日	1-6个月(含)	网下配售锁定	19.86	49.38	192	3,813.12	9,480.96	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	1-6个月(含)	网下配售锁定	10.64	24.30	361	3,841.04	8,772.30	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	1-6个月(含)	网下配售锁定	11.88	23.32	349	4,146.12	8,138.68	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	1-6个月(含)	网下配售锁定	8.90	16.75	484	4,307.60	8,107.00	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	1-6个月(含)	网下配售锁定	19.43	36.92	191	3,711.13	7,051.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	1-6个月(含)	网下配售锁定	44.95	74.00	93	4,180.35	6,882.00	-
001389	广合科技	2024年3月26日	1-6个月(含)	网下配售锁定	17.43	42.03	140	2,440.20	5,884.20	-
688709	成都华微	2024年1月31日	1-6个月(含)	网下配售锁定	15.69	18.77	307	4,816.83	5,762.39	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	1-6个月(含)	网下配售锁定	21.73	27.10	211	4,585.03	5,718.10	-
688695	中创股份	2024年3月6日	1-6个月(含)	网下配售锁定	22.43	31.54	180	4,037.40	5,677.20	-

301588	美新科技	2024年3月6日	1-6个月(含)	网下配售锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	1-6个月(含)	网下配售锁定	28.01	37.81	135	3,781.35	5,104.35	-
688584	上海合晶	2024年2月1日	1-6个月(含)	网下配售锁定	22.66	15.87	252	5,710.32	3,999.24	-
601033	永兴股份	2024年1月11日	1-6个月(含)	网下配售锁定	16.20	15.95	237	3,839.40	3,780.15	-
603341	龙旗科技	2024年2月23日	1-6个月(含)	网下配售锁定	26.00	37.48	86	2,236.00	3,223.28	-
001359	平安电工	2024年3月19日	1-6个月(含)	网下配售锁定	17.39	20.61	112	1,947.68	2,308.32	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	1-6个月(含)	网下配售锁定	15.38	15.23	144	1,707.18	2,193.12	锁定期送股
603344	星德胜	2024年3月13日	1-6个月(含)	网下配售锁定	19.18	22.66	93	1,783.74	2,107.38	-
603375	盛景微	2024年1月17日	1-6个月(含)	网下配售锁定	38.18	38.88	48	1,832.64	1,866.24	-
603325	博隆技术	2024年1月3日	1-6个月(含)	网下配售锁定	72.46	68.02	27	1,956.42	1,836.54	-
001379	腾达科技	2024年1月11日	1-6个月(含)	网下配售锁定	16.98	13.48	131	2,224.38	1,765.88	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	1-6个月(含)	网下配售锁定	23.35	26.59	64	1,494.40	1,701.76	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本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业务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。

基金的货币资金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，与该货币资金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，不投资短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 BBB 级以下的债券，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及同业存单。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券（上年末：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（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 6.4.13.3.2 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，且基金开放退出期间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货币资金、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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,697,039.42	-	-	-	13,697,039.42
结算备付金	1,432,318.88	-	-	-	1,432,318.88
存出保证金	67,963.64	-	-	-	67,963.64
交易性金融资产	-	-	-	135,852,750.39	135,852,750.39
应收清算款	-	-	-	30,417.59	30,417.59
应收申购款	-	-	-	500.00	500.00
资产总计	15,197,321.94	-	-	135,883,667.98	151,080,989.92
负债					
应付赎回款	-	-	-	47,423.60	47,423.60
应付管理人报酬	-	-	-	152,065.03	152,065.03
应付托管费	-	-	-	25,344.17	25,344.17
应付销售服务费	-	-	-	54,226.88	54,226.88
其他负债	-	-	-	845,857.73	845,857.73
负债总计	-	-	-	1,124,917.41	1,124,917.41
利率敏感度缺口	15,197,321.94	-	-	134,758,750.57	149,956,072.51
上年度末 2023年12月31日					
资产					
货币资金	14,530,643.47	-	-	-	14,530,643.47
结算备付金	1,032,044.38	-	-	-	1,032,044.38
存出保证金	25,543.81	-	-	-	25,543.81
交易性金融资产	-	-	-	170,644,205.42	170,644,205.42
应收清算款	-	-	-	1,904,442.60	1,904,442.60
资产总计	15,588,231.66	-	-	172,548,648.02	188,136,879.68
负债					
应付清算款	-	-	-	640,392.20	640,392.20
应付赎回款	-	-	-	396,633.22	396,633.22
应付管理人报酬	-	-	-	188,334.93	188,334.93
应付托管费	-	-	-	31,389.17	31,389.17
应付销售服务费	-	-	-	67,677.64	67,677.64

其他负债	-	-	-	554,855.95	554,855.95
负债总计	-	-	-	1,879,283.11	1,879,283.11
利率敏感度缺口	15,588,231.66	-	-	-170,669,364.91	186,257,596.57

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 2024 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资或资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.00% (2023 年 12 月 31 日: 0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2023 年 12 月 31 日: 同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	135,852,750.39	90.60	170,644,205.42	91.62
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	135,852,750.39	90.60	170,644,205.42	91.62

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	7,631,755.05	9,848,472.95
	业绩比较基准下降 5%	-7,631,755.05	-9,848,472.95

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	135,480,514.78	169,498,685.64
第二层次	29,940.60	212,398.56
第三层次	342,295.01	933,121.22
合计	135,852,750.39	170,644,205.42

###### 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 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### **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	135,852,750.39	89.92
	其中：股票	135,852,750.39	89.92
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	15,129,358.30	10.01
8	其他各项资产	98,881.23	0.07
9	合计	151,080,989.92	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	572,850.00	0.38
B	采矿业	7,270,195.00	4.85
C	制造业	90,717,356.61	60.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,043,808.80	2.70
E	建筑业	2,732,825.00	1.82
F	批发和零售业	2,968,085.00	1.98
G	交通运输、仓储和邮政业	2,337,579.40	1.56
H	住宿和餐饮业	179,543.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,648,793.30	5.10
J	金融业	10,956,029.80	7.31
K	房地产业	1,022,259.56	0.68
L	租赁和商务服务业	1,284,456.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	449,024.70	0.30

N	水利、环境和公共设施管理业	1,080,836.42	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	143,667.00	0.10
Q	卫生和社会工作	483,096.00	0.32
R	文化、体育和娱乐业	1,962,344.80	1.31
S	综合	-	-
	合计	135,852,750.39	90.60

### 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	600519	贵州茅台	2,800	4,108,692.00	2.74
2	300760	迈瑞医疗	7,500	2,181,825.00	1.45
3	601318	中国平安	52,600	2,175,536.00	1.45
4	000333	美的集团	27,600	1,780,200.00	1.19
5	300124	汇川技术	30,100	1,544,130.00	1.03
6	300308	中际旭创	10,700	1,475,316.00	0.98
7	300750	宁德时代	7,100	1,278,213.00	0.85
8	300502	新易盛	11,600	1,224,380.00	0.82
9	600030	中信证券	52,700	960,721.00	0.64
10	600887	伊利股份	35,400	914,736.00	0.61
11	000651	格力电器	23,300	913,826.00	0.61
12	300394	天孚通信	8,500	751,570.00	0.50
13	000725	京东方 A	183,400	750,106.00	0.50
14	000568	泸州老窖	4,900	703,101.00	0.47
15	002463	沪电股份	16,637	607,250.50	0.40
16	688169	石头科技	1,527	599,500.20	0.40
17	600690	海尔智家	20,600	584,628.00	0.39
18	601088	中国神华	13,100	581,247.00	0.39
19	600028	中国石化	82,400	520,768.00	0.35
20	300408	三环集团	17,300	504,987.00	0.34
21	600919	江苏银行	67,200	499,296.00	0.33
22	000063	中兴通讯	17,600	492,272.00	0.33
23	002371	北方华创	1,500	479,835.00	0.32

24	000338	潍柴动力	29,300	475,832.00	0.32
25	300015	爱尔眼科	45,300	467,496.00	0.31
26	601138	工业富联	17,000	465,800.00	0.31
27	601168	西部矿业	25,700	461,315.00	0.31
28	601857	中国石油	43,900	453,048.00	0.30
29	002422	科伦药业	14,700	445,851.00	0.30
30	002340	格林美	69,500	442,715.00	0.30
31	600066	宇通客车	17,000	438,600.00	0.29
32	603501	韦尔股份	4,400	437,228.00	0.29
33	002028	思源电气	6,500	434,850.00	0.29
34	300207	欣旺达	28,400	430,828.00	0.29
35	600150	中国船舶	10,500	427,455.00	0.29
36	601058	赛轮轮胎	30,500	427,000.00	0.28
37	601169	北京银行	72,300	422,232.00	0.28
38	300782	卓胜微	5,400	419,796.00	0.28
39	600160	巨化股份	17,100	412,623.00	0.28
40	002595	豪迈科技	10,700	408,419.00	0.27
41	600660	福耀玻璃	8,500	407,150.00	0.27
42	300896	爱美客	2,340	402,714.00	0.27
43	000100	TCL 科技	92,800	400,896.00	0.27
44	000423	东阿阿胶	6,400	400,640.00	0.27
45	601766	中国中车	52,900	397,279.00	0.26
46	601601	中国太保	14,100	392,826.00	0.26
47	300054	鼎龙股份	17,100	387,828.00	0.26
48	300136	信维通信	19,200	375,936.00	0.25
49	300059	东方财富	35,300	372,768.00	0.25
50	000630	铜陵有色	102,200	368,942.00	0.25
51	300474	景嘉微	5,800	366,734.00	0.24
52	002625	光启技术	21,000	364,350.00	0.24
53	300433	蓝思科技	19,900	363,175.00	0.24
54	000975	山金国际	22,200	361,638.00	0.24
55	002027	分众传媒	59,000	357,540.00	0.24
56	300724	捷佳伟创	6,600	356,466.00	0.24
57	600050	中国联通	74,200	348,740.00	0.23
58	601567	三星医疗	9,900	346,500.00	0.23
59	603993	洛阳钼业	40,700	345,950.00	0.23
60	300573	兴齐眼药	2,040	334,560.00	0.22
61	600941	中国移动	3,100	333,250.00	0.22
62	600436	片仔癀	1,600	331,472.00	0.22

63	600988	赤峰黄金	20,000	326,800.00	0.22
64	688111	金山办公	1,400	318,500.00	0.21
65	300144	宋城演艺	39,500	317,185.00	0.21
66	300661	圣邦股份	3,800	314,564.00	0.21
67	002078	太阳纸业	22,500	313,875.00	0.21
68	600938	中国海油	9,400	310,200.00	0.21
69	002456	欧菲光	39,700	310,057.00	0.21
70	600885	宏发股份	11,200	310,016.00	0.21
71	600157	永泰能源	261,000	307,980.00	0.21
72	300498	温氏股份	15,400	305,228.00	0.20
73	002156	通富微电	13,500	302,265.00	0.20
74	601108	财通证券	45,700	302,077.00	0.20
75	601390	中国中铁	45,200	294,704.00	0.20
76	601816	京沪高铁	54,500	292,665.00	0.20
77	300251	光线传媒	34,600	290,986.00	0.19
78	002384	东山精密	14,000	289,800.00	0.19
79	600048	保利发展	32,800	287,328.00	0.19
80	601600	中国铝业	37,300	284,599.00	0.19
81	300316	晶盛机电	9,900	284,427.00	0.19
82	603979	金诚信	5,500	277,915.00	0.19
83	300866	安克创新	3,900	277,719.00	0.19
84	600839	四川长虹	61,800	277,482.00	0.19
85	601555	东吴证券	46,800	276,120.00	0.18
86	300001	特锐德	13,700	275,644.00	0.18
87	601009	南京银行	26,400	274,296.00	0.18
88	300476	胜宏科技	8,500	274,210.00	0.18
89	002517	恺英网络	28,700	274,085.00	0.18
90	601728	中国电信	44,500	273,675.00	0.18
91	601668	中国建筑	51,400	272,934.00	0.18
92	600905	三峡能源	62,300	271,628.00	0.18
93	601211	国泰君安	20,000	271,000.00	0.18
94	300383	光环新网	32,000	270,400.00	0.18
95	300002	神州泰岳	33,300	270,396.00	0.18
96	002185	华天科技	33,100	269,765.00	0.18
97	601233	桐昆股份	16,900	269,724.00	0.18
98	300529	健帆生物	9,800	266,658.00	0.18
99	603939	益丰药房	10,720	263,176.00	0.18
100	000066	中国长城	29,700	259,875.00	0.17
101	603986	兆易创新	2,700	258,174.00	0.17

102	300253	卫宁健康	43,600	257,240.00	0.17
103	688617	惠泰医疗	558	254,503.80	0.17
104	601666	平煤股份	22,700	254,240.00	0.17
105	002465	海格通信	24,500	253,820.00	0.17
106	601628	中国人寿	8,100	251,505.00	0.17
107	300487	蓝晓科技	6,000	250,560.00	0.17
108	002304	洋河股份	3,100	250,294.00	0.17
109	002797	第一创业	49,100	249,919.00	0.17
110	600985	淮北矿业	14,900	249,426.00	0.17
111	300274	阳光电源	4,020	249,360.60	0.17
112	300009	安科生物	29,100	248,514.00	0.17
113	600547	山东黄金	9,000	246,420.00	0.16
114	601989	中国重工	49,500	244,035.00	0.16
115	300017	网宿科技	30,600	241,740.00	0.16
116	002138	顺络电子	8,800	241,648.00	0.16
117	002008	大族激光	11,600	241,280.00	0.16
118	002128	电投能源	11,400	240,540.00	0.16
119	300628	亿联网络	6,500	239,005.00	0.16
120	002273	水晶光电	14,000	237,720.00	0.16
121	000400	许继电气	6,900	237,429.00	0.16
122	601128	常熟银行	31,250	236,562.50	0.16
123	002532	天山铝业	29,100	236,001.00	0.16
124	600482	中国动力	12,100	235,708.00	0.16
125	600426	华鲁恒升	8,700	231,768.00	0.15
126	688099	晶晨股份	3,897	231,170.04	0.15
127	002444	巨星科技	9,300	229,710.00	0.15
128	000977	浪潮信息	6,300	229,131.00	0.15
129	300558	贝达药业	7,000	227,850.00	0.15
130	002318	久立特材	9,600	223,968.00	0.15
131	000683	远兴能源	32,400	223,884.00	0.15
132	688008	澜起科技	3,914	223,724.24	0.15
133	300775	三角防务	7,300	223,380.00	0.15
134	601916	浙商银行	80,600	222,456.00	0.15
135	000425	徐工机械	31,100	222,365.00	0.15
136	688188	柏楚电子	1,199	221,275.45	0.15
137	002409	雅克科技	3,500	220,185.00	0.15
138	002739	万达电影	18,200	220,038.00	0.15
139	603160	汇顶科技	3,200	220,000.00	0.15
140	000426	兴业银锡	16,100	218,638.00	0.15

141	301308	江波龙	2,300	217,902.00	0.15
142	002126	银轮股份	12,500	217,625.00	0.15
143	601186	中国铁建	25,200	215,964.00	0.14
144	002600	领益智造	30,300	215,736.00	0.14
145	300751	迈为股份	1,800	215,064.00	0.14
146	000538	云南白药	4,200	214,830.00	0.14
147	002195	岩山科技	85,500	214,605.00	0.14
148	601577	长沙银行	26,200	214,316.00	0.14
149	600559	老白干酒	11,700	212,706.00	0.14
150	603369	今世缘	4,600	212,520.00	0.14
151	000960	锡业股份	13,700	212,213.00	0.14
152	002311	海大集团	4,500	211,725.00	0.14
153	601717	郑煤机	14,300	211,640.00	0.14
154	300413	芒果超媒	10,100	211,090.00	0.14
155	000034	神州数码	9,200	210,588.00	0.14
156	600795	国电电力	35,100	210,249.00	0.14
157	000818	航锦科技	9,500	209,760.00	0.14
157	600886	国投电力	11,500	209,760.00	0.14
158	601966	玲珑轮胎	11,400	209,418.00	0.14
159	300832	新产业	3,100	209,064.00	0.14
160	002130	沃尔核材	14,700	207,564.00	0.14
161	600348	华阳股份	20,700	206,172.00	0.14
162	000878	云南铜业	16,500	205,590.00	0.14
163	688578	艾力斯	3,210	204,605.40	0.14
164	688180	君实生物	6,992	203,117.60	0.14
165	002472	双环传动	9,200	202,584.00	0.14
166	688036	传音控股	2,643	202,295.22	0.13
167	002984	森麒麟	8,360	201,392.40	0.13
168	603179	新泉股份	5,100	200,124.00	0.13
169	300666	江丰电子	4,200	199,752.00	0.13
170	601669	中国电建	35,700	199,563.00	0.13
171	300070	碧水源	47,600	199,444.00	0.13
172	601918	新集能源	20,400	198,900.00	0.13
173	600909	华安证券	47,000	197,870.00	0.13
174	300919	中伟股份	6,380	197,716.20	0.13
175	002152	广电运通	18,900	197,694.00	0.13
176	600529	山东药玻	7,800	197,652.00	0.13
177	300595	欧普康视	12,600	197,568.00	0.13
178	600893	航发动力	5,400	197,370.00	0.13

179	300058	蓝色光标	36,200	196,928.00	0.13
180	600584	长电科技	6,200	196,602.00	0.13
181	603589	口子窖	5,000	195,950.00	0.13
182	000921	海信家电	6,000	193,440.00	0.13
183	600141	兴发集团	10,100	192,708.00	0.13
184	600521	华海药业	11,300	192,665.00	0.13
185	605589	圣泉集团	9,400	190,726.00	0.13
186	600863	内蒙华电	41,100	190,704.00	0.13
187	000596	古井贡酒	900	189,963.00	0.13
188	000513	丽珠集团	5,100	189,771.00	0.13
189	300034	钢研高纳	11,900	189,091.00	0.13
190	601677	明泰铝业	16,300	188,428.00	0.13
191	600989	宝丰能源	10,800	187,164.00	0.12
192	601901	方正证券	24,200	187,066.00	0.12
193	688213	思特威	3,852	186,822.00	0.12
194	000728	国元证券	30,700	186,042.00	0.12
195	000528	柳工	16,600	185,754.00	0.12
196	600642	申能股份	21,000	185,430.00	0.12
197	603156	养元饮品	8,700	185,049.00	0.12
198	603129	春风动力	1,300	185,042.00	0.12
199	600970	中材国际	15,300	184,518.00	0.12
200	000403	派林生物	6,900	183,954.00	0.12
201	600761	安徽合力	8,500	183,940.00	0.12
202	000661	长春高新	2,000	183,540.00	0.12
203	000938	紫光股份	8,200	183,270.00	0.12
204	002439	启明星辰	10,600	182,956.00	0.12
205	601216	君正集团	49,500	182,655.00	0.12
206	600699	均胜电子	12,300	182,286.00	0.12
207	600820	隧道股份	27,900	182,187.00	0.12
208	000166	申万宏源	42,000	181,020.00	0.12
209	002236	大华股份	11,700	180,882.00	0.12
210	600489	中金黄金	12,200	180,560.00	0.12
211	002262	恩华药业	7,600	180,424.00	0.12
212	002558	巨人网络	19,000	179,360.00	0.12
213	000157	中联重科	23,300	178,944.00	0.12
214	300450	先导智能	10,700	177,941.00	0.12
215	002064	华峰化学	24,800	177,816.00	0.12
216	002493	荣盛石化	18,400	177,744.00	0.12
217	600312	平高电气	9,000	175,050.00	0.12

218	600566	济川药业	5,500	174,405.00	0.12
219	600711	ST 盛屯	47,500	174,325.00	0.12
220	600019	宝钢股份	26,200	174,230.00	0.12
221	600516	方大炭素	40,300	173,693.00	0.12
222	300182	捷成股份	46,700	173,257.00	0.12
223	002294	信立泰	6,500	173,095.00	0.12
224	000703	恒逸石化	24,300	172,287.00	0.11
225	600177	雅戈尔	24,000	170,880.00	0.11
226	002648	卫星化学	9,500	170,810.00	0.11
227	601990	南京证券	22,200	170,496.00	0.11
228	002155	湖南黄金	9,400	170,140.00	0.11
229	002837	英维克	7,920	169,408.80	0.11
230	002601	龙佰集团	9,100	168,987.00	0.11
231	688639	华恒生物	2,200	168,058.00	0.11
232	000623	吉林敖东	12,500	167,500.00	0.11
233	600285	羚锐制药	6,900	167,049.00	0.11
234	300677	英科医疗	6,200	166,222.00	0.11
235	600582	天地科技	24,100	166,049.00	0.11
236	002139	拓邦股份	15,500	164,610.00	0.11
237	688019	安集科技	1,300	163,540.00	0.11
238	601636	旗滨集团	25,300	163,185.00	0.11
239	002145	中核钛白	49,500	162,360.00	0.11
240	600282	南钢股份	32,600	162,348.00	0.11
241	600535	天士力	12,900	162,282.00	0.11
242	600498	烽火通信	10,200	162,180.00	0.11
243	600926	杭州银行	12,400	161,820.00	0.11
244	600499	科达制造	19,000	160,170.00	0.11
245	600511	国药股份	5,200	160,108.00	0.11
246	601198	东兴证券	20,100	159,996.00	0.11
247	000690	宝新能源	31,100	158,610.00	0.11
248	688050	爱博医疗	2,160	158,371.20	0.11
249	600008	首创环保	58,900	157,852.00	0.11
250	300346	南大光电	5,500	157,245.00	0.10
251	000738	航发控制	7,800	156,546.00	0.10
252	601001	晋控煤业	9,400	155,288.00	0.10
253	000786	北新建材	5,200	154,232.00	0.10
254	002252	上海莱士	19,700	154,054.00	0.10
255	603298	杭叉集团	7,840	153,977.60	0.10
256	002001	新和成	8,000	153,600.00	0.10

257	002065	东华软件	33,900	153,228.00	0.10
258	000830	鲁西化工	13,200	152,988.00	0.10
259	300679	电连技术	3,800	152,874.00	0.10
260	603568	伟明环保	7,400	152,292.00	0.10
261	601633	长城汽车	6,000	151,800.00	0.10
262	000060	中金岭南	35,800	151,792.00	0.10
263	601333	广深铁路	46,600	150,984.00	0.10
264	300088	长信科技	32,000	150,400.00	0.10
265	600021	上海电力	15,200	150,328.00	0.10
266	600998	九州通	30,680	149,718.40	0.10
267	002429	兆驰股份	30,900	148,629.00	0.10
268	600704	物产中大	34,200	148,428.00	0.10
269	002025	航天电器	3,200	148,416.00	0.10
270	000519	中兵红箭	10,100	148,167.00	0.10
271	600737	中粮糖业	15,300	146,727.00	0.10
272	002557	洽洽食品	5,200	146,588.00	0.10
273	601868	中国能建	69,100	146,492.00	0.10
274	600004	白云机场	15,400	145,992.00	0.10
275	002271	东方雨虹	11,800	145,612.00	0.10
276	300357	我武生物	7,200	145,584.00	0.10
277	601838	成都银行	9,500	144,305.00	0.10
278	600369	西南证券	40,300	144,274.00	0.10
279	600170	上海建工	67,100	144,265.00	0.10
280	601000	唐山港	30,600	143,820.00	0.10
281	300014	亿纬锂能	3,600	143,712.00	0.10
282	002607	中公教育	93,900	143,667.00	0.10
283	002402	和而泰	13,400	143,514.00	0.10
284	300458	全志科技	6,100	143,411.00	0.10
285	603885	吉祥航空	13,000	142,870.00	0.10
286	000887	中鼎股份	11,600	141,984.00	0.09
287	002508	老板电器	6,400	141,440.00	0.09
288	600750	江中药业	6,100	140,971.00	0.09
289	600346	恒力石化	10,100	140,895.00	0.09
290	603005	晶方科技	6,900	140,622.00	0.09
291	603505	金石资源	5,000	139,650.00	0.09
292	600685	中船防务	5,000	139,500.00	0.09
293	300999	金龙鱼	5,100	139,485.00	0.09
294	688002	睿创微纳	4,967	138,926.99	0.09
295	002958	青农商行	51,800	138,824.00	0.09

296	601016	节能风电	46,400	138,736.00	0.09
297	002831	裕同科技	5,400	138,186.00	0.09
298	002832	比音勒芬	5,700	137,769.00	0.09
299	300627	华测导航	4,600	137,310.00	0.09
300	000415	渤海租赁	53,600	136,680.00	0.09
301	002555	三七互娱	10,400	135,720.00	0.09
302	000762	西藏矿业	7,500	135,600.00	0.09
303	600201	生物股份	18,800	135,548.00	0.09
304	601021	春秋航空	2,400	135,192.00	0.09
305	603300	华铁应急	24,700	134,862.00	0.09
306	002507	涪陵榨菜	11,000	134,750.00	0.09
307	002332	仙琚制药	11,800	134,638.00	0.09
308	300735	光弘科技	6,200	133,920.00	0.09
309	300979	华利集团	2,200	133,870.00	0.09
310	600901	江苏金租	26,400	133,320.00	0.09
311	300776	帝尔激光	2,900	133,284.00	0.09
312	603379	三美股份	3,400	133,076.00	0.09
313	300738	奥飞数据	13,100	132,572.00	0.09
314	688608	恒玄科技	900	131,742.00	0.09
315	600916	中国黄金	13,600	130,832.00	0.09
316	002120	韵达股份	16,900	130,806.00	0.09
317	000963	华东医药	4,700	130,707.00	0.09
318	601991	大唐发电	43,400	130,634.00	0.09
319	000860	顺鑫农业	7,800	130,572.00	0.09
320	002180	纳思达	4,900	129,458.00	0.09
321	605499	东鹏饮料	600	129,450.00	0.09
322	000636	风华高科	9,900	129,294.00	0.09
323	000682	东方电子	11,700	129,168.00	0.09
324	600859	王府井	11,000	129,140.00	0.09
325	601689	拓普集团	2,400	128,664.00	0.09
326	002249	大洋电机	27,200	128,656.00	0.09
327	000581	威孚高科	7,900	128,612.00	0.09
328	605111	新洁能	4,200	128,478.00	0.09
329	600183	生益科技	6,100	128,466.00	0.09
330	000543	皖能电力	14,500	128,325.00	0.09
331	600602	云赛智联	11,600	128,064.00	0.09
332	600580	卧龙电驱	10,500	127,575.00	0.09
333	000875	吉电股份	23,900	127,387.00	0.08
334	688516	奥特维	3,046	127,353.26	0.08

335	002019	亿帆医药	10,300	127,308.00	0.08
336	002203	海亮股份	15,900	126,882.00	0.08
337	300638	广和通	7,400	126,540.00	0.08
338	688596	正帆科技	3,831	126,423.00	0.08
339	600821	金开新能	24,500	125,930.00	0.08
340	002245	蔚蓝锂芯	16,200	125,550.00	0.08
341	688717	艾罗能源	2,672	125,477.12	0.08
342	600390	五矿资本	30,900	125,145.00	0.08
343	603393	新天然气	3,600	125,064.00	0.08
344	000598	兴蓉环境	16,600	124,832.00	0.08
345	301035	润丰股份	2,800	124,712.00	0.08
346	603658	安图生物	2,700	124,389.00	0.08
347	603893	瑞芯微	2,100	124,257.00	0.08
348	300699	光威复材	5,000	124,150.00	0.08
349	603883	老百姓	6,760	124,113.60	0.08
350	600380	健康元	11,100	123,987.00	0.08
351	600373	中文传媒	8,300	123,172.00	0.08
352	600362	江西铜业	5,200	123,136.00	0.08
353	600739	辽宁成大	14,500	121,365.00	0.08
354	688278	特宝生物	2,264	121,237.20	0.08
355	600323	瀚蓝环境	5,800	121,220.00	0.08
356	000027	深圳能源	16,600	121,180.00	0.08
357	002807	江阴银行	32,000	120,640.00	0.08
358	600258	首旅酒店	9,700	119,795.00	0.08
359	002572	索菲亚	7,800	119,574.00	0.08
360	600219	南山铝业	31,200	118,872.00	0.08
361	002851	麦格米特	4,600	118,864.00	0.08
362	300682	朗新集团	13,900	118,289.00	0.08
363	000999	华润三九	2,770	117,946.60	0.08
364	601618	中国中冶	38,000	117,800.00	0.08
365	688088	虹软科技	4,072	117,517.92	0.08
366	600062	华润双鹤	6,000	117,480.00	0.08
367	603588	高能环境	18,700	117,436.00	0.08
368	601665	齐鲁银行	23,900	117,349.00	0.08
369	600993	马应龙	4,400	117,348.00	0.08
370	688116	天奈科技	5,077	117,177.16	0.08
371	600707	彩虹股份	17,200	117,132.00	0.08
372	688408	中信博	1,254	115,468.32	0.08
373	000155	川能动力	10,700	115,239.00	0.08

374	300075	数字政通	7,800	115,050.00	0.08
375	002400	省广集团	23,700	114,945.00	0.08
376	600598	北大荒	9,200	114,908.00	0.08
377	600233	圆通速递	7,300	114,245.00	0.08
378	601222	林洋能源	18,100	113,487.00	0.08
379	600718	东软集团	13,700	113,299.00	0.08
380	000739	普洛药业	8,300	112,631.00	0.08
381	601877	正泰电器	5,900	112,454.00	0.07
382	603556	海兴电力	2,400	112,392.00	0.07
383	601231	环旭电子	7,000	112,350.00	0.07
384	603236	移远通信	2,400	112,152.00	0.07
385	600483	福能股份	9,600	111,936.00	0.07
386	001696	宗申动力	10,500	111,720.00	0.07
386	600596	新安股份	14,700	111,720.00	0.07
387	600011	华能国际	11,600	111,592.00	0.07
388	688333	铂力特	2,300	111,435.00	0.07
389	002745	木林森	13,800	111,228.00	0.07
390	300957	贝泰妮	2,300	111,136.00	0.07
391	601336	新华保险	3,700	111,111.00	0.07
392	000032	深桑达 A	7,400	110,852.00	0.07
393	688234	天岳先进	2,360	110,731.20	0.07
394	601865	福莱特	5,500	110,550.00	0.07
395	600845	宝信软件	3,460	110,477.80	0.07
396	002032	苏泊尔	2,200	110,220.00	0.07
397	601137	博威合金	7,200	109,728.00	0.07
398	601117	中国化学	13,300	109,592.00	0.07
399	688208	道通科技	4,526	109,257.64	0.07
400	000035	中国天楹	24,100	109,173.00	0.07
401	600908	无锡银行	20,500	109,060.00	0.07
402	601933	永辉超市	43,900	108,872.00	0.07
403	603279	景津装备	5,000	108,450.00	0.07
404	000825	太钢不锈	32,000	108,160.00	0.07
405	600577	精达股份	27,200	107,984.00	0.07
406	603225	新风鸣	6,900	107,571.00	0.07
407	600971	恒源煤电	9,000	107,460.00	0.07
408	002036	联创电子	15,900	107,325.00	0.07
409	601860	紫金银行	42,700	106,750.00	0.07
410	600210	紫江企业	20,000	106,400.00	0.07
411	688016	心脉医疗	1,085	106,384.25	0.07

412	002617	露笑科技	22,100	106,080.00	0.07
413	000917	电广传媒	21,000	106,050.00	0.07
414	000951	中国重汽	7,400	105,968.00	0.07
415	002074	国轩高科	5,500	105,325.00	0.07
416	600064	南京高科	17,300	105,011.00	0.07
417	600933	爱柯迪	7,100	105,009.00	0.07
418	688772	珠海冠宇	7,031	104,761.90	0.07
419	002653	海思科	3,400	104,380.00	0.07
420	002266	浙富控股	37,400	104,346.00	0.07
421	601098	中南传媒	8,400	104,328.00	0.07
422	603323	苏农银行	21,600	103,896.00	0.07
423	300298	三诺生物	4,100	103,894.00	0.07
424	601126	四方股份	5,400	103,788.00	0.07
425	000563	陕国投 A	37,500	103,125.00	0.07
425	600801	华新水泥	7,500	103,125.00	0.07
426	600399	抚顺特钢	18,300	103,029.00	0.07
427	600332	白云山	3,500	102,655.00	0.07
428	300568	星源材质	12,500	102,500.00	0.07
429	600528	中铁工业	14,000	102,480.00	0.07
430	600456	宝钛股份	4,000	102,120.00	0.07
431	603806	福斯特	6,940	102,018.00	0.07
432	603871	嘉友国际	5,760	101,894.40	0.07
433	000937	冀中能源	15,200	101,840.00	0.07
434	603766	隆鑫通用	15,000	101,700.00	0.07
435	600959	江苏有线	38,500	101,640.00	0.07
436	601678	滨化股份	29,200	101,616.00	0.07
437	000758	中色股份	20,000	101,600.00	0.07
438	600459	贵研铂业	7,500	101,325.00	0.07
439	603308	应流股份	8,100	100,602.00	0.07
440	600557	康缘药业	6,400	100,480.00	0.07
441	600273	嘉化能源	14,000	99,960.00	0.07
442	000923	河钢资源	5,800	99,876.00	0.07
443	002212	天融信	20,500	99,835.00	0.07
444	600875	东方电气	5,400	99,630.00	0.07
445	002100	天康生物	14,300	99,099.00	0.07
446	002237	恒邦股份	8,600	98,986.00	0.07
447	600587	新华医疗	6,280	98,847.20	0.07
448	300623	捷捷微电	5,700	98,610.00	0.07
449	601898	中煤能源	7,900	98,592.00	0.07

450	300166	东方国信	16,100	98,532.00	0.07
451	600158	中体产业	12,800	98,432.00	0.07
452	002541	鸿路钢构	5,800	98,426.00	0.07
453	002004	华邦健康	25,900	98,420.00	0.07
454	002727	一心堂	6,500	98,085.00	0.07
455	601375	中原证券	28,700	97,867.00	0.07
456	688556	高测股份	8,224	97,783.36	0.07
457	002839	张家港行	24,300	97,686.00	0.07
458	300482	万孚生物	4,000	97,600.00	0.07
459	688289	圣湘生物	5,546	97,498.68	0.07
460	688220	翱捷科技	2,600	97,396.00	0.06
461	000676	智度股份	16,000	97,120.00	0.06
462	000915	华特达因	3,200	96,512.00	0.06
463	300693	盛弘股份	4,600	96,324.00	0.06
464	300910	瑞丰新材	2,200	96,184.00	0.06
465	000650	仁和药业	16,300	96,170.00	0.06
466	688798	艾为电子	1,695	95,970.90	0.06
467	600655	豫园股份	18,600	95,790.00	0.06
468	601607	上海医药	5,000	95,550.00	0.06
469	002011	盾安环境	9,700	95,351.00	0.06
470	002020	京新药业	9,100	95,277.00	0.06
471	300618	寒锐钴业	3,600	95,220.00	0.06
472	600645	中源协和	5,900	94,990.00	0.06
473	300379	东方通	11,700	94,536.00	0.06
474	002948	青岛银行	28,000	94,360.00	0.06
475	002706	良信股份	13,700	93,982.00	0.06
476	300811	铂科新材	2,140	93,946.00	0.06
477	300685	艾德生物	5,300	93,492.00	0.06
478	601615	明阳智能	9,900	93,456.00	0.06
479	300170	汉得信息	15,200	93,328.00	0.06
480	000420	吉林化纤	29,500	93,220.00	0.06
481	600420	国药现代	8,700	92,916.00	0.06
482	600409	三友化工	18,500	92,870.00	0.06
483	600888	新疆众和	13,100	92,617.00	0.06
484	688366	昊海生科	1,501	92,581.68	0.06
485	300604	长川科技	3,400	92,378.00	0.06
486	600267	海正药业	13,100	91,962.00	0.06
487	002048	宁波华翔	7,100	91,874.00	0.06
488	300303	聚飞光电	18,900	91,854.00	0.06

489	600252	中恒集团	42,300	91,791.00	0.06
490	002171	楚江新材	13,900	91,601.00	0.06
491	301050	雷电微力	1,900	91,504.00	0.06
492	002292	奥飞娱乐	15,300	91,494.00	0.06
493	002938	鹏鼎控股	2,300	91,448.00	0.06
494	601611	中国核建	11,300	91,417.00	0.06
495	603678	火炬电子	3,700	91,353.00	0.06
496	300296	利亚德	20,300	91,350.00	0.06
497	002906	华阳集团	3,400	90,984.00	0.06
498	601928	凤凰传媒	8,300	90,968.00	0.06
499	002773	康弘药业	4,200	90,930.00	0.06
500	688029	南微医学	1,475	90,801.00	0.06
501	000969	安泰科技	11,400	90,402.00	0.06
502	600562	国睿科技	6,600	90,156.00	0.06
503	600006	东风股份	14,100	90,099.00	0.06
504	600208	新湖中宝	56,900	89,902.00	0.06
505	600037	歌华有线	15,000	89,700.00	0.06
506	300122	智飞生物	3,200	89,696.00	0.06
507	002276	万马股份	12,500	89,625.00	0.06
508	300827	上能电气	4,000	89,440.00	0.06
509	688139	海尔生物	2,400	89,280.00	0.06
510	603368	柳药集团	5,100	89,250.00	0.06
511	002091	江苏国泰	13,100	89,211.00	0.06
512	600216	浙江医药	8,100	88,938.00	0.06
513	300284	苏交科	11,000	88,880.00	0.06
514	600138	中青旅	9,100	87,906.00	0.06
515	000883	湖北能源	14,600	87,746.00	0.06
516	600055	万东医疗	7,100	87,685.00	0.06
517	002244	滨江集团	12,000	87,120.00	0.06
518	000028	国药一致	2,700	87,021.00	0.06
519	002351	漫步者	6,600	86,790.00	0.06
520	601311	骆驼股份	10,800	86,616.00	0.06
521	688789	宏华数科	800	86,240.00	0.06
522	300761	立华股份	3,800	86,032.00	0.06
523	300113	顺网科技	8,400	86,016.00	0.06
524	603228	景旺电子	2,700	85,860.00	0.06
525	601702	华峰铝业	4,700	85,822.00	0.06
526	000089	深圳机场	13,400	85,626.00	0.06
527	000821	京山轻机	7,500	84,975.00	0.06

528	688018	乐鑫科技	861	84,963.48	0.06
529	600125	铁龙物流	14,200	84,774.00	0.06
530	603517	绝味食品	5,500	84,700.00	0.06
531	600586	金晶科技	14,600	84,680.00	0.06
532	002202	金风科技	12,600	84,672.00	0.06
533	600717	天津港	19,800	84,546.00	0.06
534	600098	广州发展	13,200	84,480.00	0.06
535	002215	诺普信	11,300	84,185.00	0.06
536	002023	海特高新	9,200	84,180.00	0.06
537	688409	富创精密	2,272	83,927.68	0.06
538	600848	上海临港	9,200	83,812.00	0.06
539	300457	赢合科技	4,700	83,801.00	0.06
540	300188	国投智能	7,500	83,325.00	0.06
541	603306	华懋科技	4,600	83,122.00	0.06
542	300432	富临精工	12,900	83,076.00	0.06
543	300319	麦捷科技	8,900	83,037.00	0.06
544	002127	南极电商	31,800	82,680.00	0.06
545	300035	中科电气	9,700	82,547.00	0.06
546	688739	成大生物	3,400	82,416.00	0.05
547	300463	迈克生物	7,200	81,936.00	0.05
548	603195	公牛集团	1,060	81,747.20	0.05
549	000848	承德露露	10,400	81,744.00	0.05
550	000810	创维数字	9,500	81,510.00	0.05
551	600967	内蒙一机	11,300	81,360.00	0.05
552	300470	中密控股	2,400	81,144.00	0.05
553	002867	周大生	6,200	80,972.00	0.05
554	601963	重庆银行	10,400	80,600.00	0.05
555	688425	铁建重工	21,578	79,407.04	0.05
556	688106	金宏气体	4,511	79,032.72	0.05
557	600827	百联股份	10,700	78,966.00	0.05
558	600059	古越龙山	9,900	78,606.00	0.05
559	002153	石基信息	13,700	78,501.00	0.05
560	002960	青鸟消防	6,200	78,368.00	0.05
561	000785	居然之家	32,100	78,003.00	0.05
562	300634	彩讯股份	4,600	77,418.00	0.05
563	002649	博彦科技	9,700	77,212.00	0.05
564	300109	新开源	6,650	77,007.00	0.05
565	600864	哈投股份	16,200	76,950.00	0.05
566	002233	塔牌集团	10,500	76,755.00	0.05

567	000156	华数传媒	12,200	76,616.00	0.05
568	600197	伊力特	4,300	76,583.00	0.05
569	301219	腾远钴业	2,000	76,520.00	0.05
570	002583	海能达	18,800	76,516.00	0.05
571	000559	万向钱潮	17,100	76,266.00	0.05
572	000811	冰轮环境	7,900	76,235.00	0.05
573	300031	宝通科技	5,300	76,161.00	0.05
574	300841	康华生物	1,500	75,960.00	0.05
575	600808	马钢股份	37,400	75,548.00	0.05
576	603267	鸿远电子	2,200	75,020.00	0.05
577	301171	易点天下	5,100	74,970.00	0.05
578	002468	申通快递	8,900	74,760.00	0.05
579	600315	上海家化	4,200	74,676.00	0.05
580	300418	昆仑万维	2,300	74,152.00	0.05
581	002635	安洁科技	4,800	74,112.00	0.05
582	002701	奥瑞金	17,800	74,048.00	0.05
583	600126	杭钢股份	18,000	73,980.00	0.05
584	600502	安徽建工	17,200	73,960.00	0.05
585	600480	凌云股份	7,500	73,725.00	0.05
586	300180	华峰超纤	20,800	73,424.00	0.05
587	688281	华秦科技	880	73,321.60	0.05
588	600023	浙能电力	10,300	73,233.00	0.05
589	601319	中国人保	14,200	73,130.00	0.05
590	300233	金城医药	4,900	73,108.00	0.05
591	000488	晨鸣纸业	21,100	73,006.00	0.05
591	300451	创业慧康	21,100	73,006.00	0.05
592	300347	泰格医药	1,500	72,900.00	0.05
593	000552	甘肃能化	21,000	72,870.00	0.05
594	300226	上海钢联	4,300	72,842.00	0.05
595	600132	重庆啤酒	1,200	72,840.00	0.05
596	000737	北方铜业	7,800	72,384.00	0.05
597	688123	聚辰股份	1,188	72,266.04	0.05
598	600458	时代新材	7,100	71,710.00	0.05
599	603881	数据港	5,630	71,557.30	0.05
600	000967	盈峰环境	16,900	71,487.00	0.05
601	688403	汇成股份	8,419	71,393.12	0.05
602	000928	中钢国际	12,800	71,040.00	0.05
603	300687	赛意信息	5,100	70,992.00	0.05
604	000930	中粮科技	14,100	70,923.00	0.05

605	002537	海联金汇	13,700	70,829.00	0.05
606	600776	东方通信	7,200	70,776.00	0.05
607	002081	金螳螂	23,300	70,599.00	0.05
608	002467	二六三	21,100	70,474.00	0.05
609	603699	纽威股份	4,100	70,192.00	0.05
610	603713	密尔克卫	1,300	69,576.00	0.05
611	002043	兔宝宝	6,700	69,479.00	0.05
612	000913	钱江摩托	4,400	69,344.00	0.05
613	603008	喜临门	4,000	69,320.00	0.05
614	300406	九强生物	4,500	69,210.00	0.05
615	600095	湘财股份	11,600	69,136.00	0.05
616	688187	时代电气	1,400	69,132.00	0.05
617	002226	江南化工	15,400	68,992.00	0.05
618	688389	普门科技	4,241	68,958.66	0.05
619	300855	图南股份	2,600	68,744.00	0.05
620	688100	威胜信息	1,800	68,670.00	0.05
621	601952	苏垦农发	7,600	68,552.00	0.05
622	601163	三角轮胎	4,500	68,490.00	0.05
623	002847	盐津铺子	1,600	68,432.00	0.05
624	002274	华昌化工	9,200	68,264.00	0.05
625	603650	彤程新材	2,300	67,965.00	0.05
626	002841	视源股份	2,300	67,919.00	0.05
627	000708	中信特钢	5,000	67,850.00	0.05
628	300783	三只松鼠	3,100	67,797.00	0.05
629	300409	道氏技术	7,900	67,624.00	0.05
630	002705	新宝股份	4,800	67,536.00	0.05
630	002815	崇达技术	7,200	67,536.00	0.05
631	002291	遥望科技	15,700	67,510.00	0.05
632	300856	科思股份	2,100	67,221.00	0.04
633	002929	润建股份	2,300	66,953.00	0.04
634	300770	新媒股份	2,000	66,760.00	0.04
635	000735	罗牛山	15,400	66,682.00	0.04
635	600517	国网英大	15,400	66,682.00	0.04
636	301589	诺瓦星云	354	66,668.82	0.04
637	300257	开山股份	6,600	66,660.00	0.04
638	603187	海容冷链	5,700	66,462.00	0.04
639	600575	淮河能源	17,000	66,130.00	0.04
640	600195	中牧股份	8,800	65,912.00	0.04
641	600623	华谊集团	11,400	65,892.00	0.04

642	600007	中国国贸	3,000	65,880.00	0.04
643	002006	精工科技	4,900	65,758.00	0.04
644	600531	豫光金铅	10,200	65,688.00	0.04
645	000600	建投能源	10,400	65,520.00	0.04
646	000990	诚志股份	8,800	65,472.00	0.04
647	300119	瑞普生物	4,800	65,376.00	0.04
648	002158	汉钟精机	3,900	65,208.00	0.04
649	300596	利安隆	2,400	65,112.00	0.04
650	300602	飞荣达	4,300	64,973.00	0.04
651	600389	江山股份	4,600	64,906.00	0.04
652	002390	信邦制药	19,600	64,876.00	0.04
653	002061	浙江交科	17,700	64,605.00	0.04
654	002498	汉缆股份	19,600	64,484.00	0.04
655	600339	中油工程	20,600	64,272.00	0.04
656	688158	优刻得	6,274	64,183.02	0.04
657	603786	科博达	1,000	64,150.00	0.04
658	002550	千红制药	11,900	64,141.00	0.04
659	601528	瑞丰银行	13,500	63,720.00	0.04
660	688065	凯赛生物	1,400	63,546.00	0.04
661	603100	川仪股份	2,700	63,477.00	0.04
662	600787	中储股份	13,100	63,011.00	0.04
663	600496	精工钢构	24,600	62,976.00	0.04
664	600578	京能电力	19,400	62,856.00	0.04
665	300260	新莱应材	3,000	62,820.00	0.04
666	002928	华夏航空	9,900	62,766.00	0.04
667	600710	苏美达	7,700	62,755.00	0.04
668	002563	森马服饰	10,800	62,748.00	0.04
669	601101	昊华能源	6,800	62,492.00	0.04
670	600361	创新新材	15,500	62,465.00	0.04
671	688559	海目星	1,899	62,458.11	0.04
672	300033	同花顺	600	62,220.00	0.04
673	002423	中粮资本	8,300	62,167.00	0.04
674	600835	上海机电	5,400	62,154.00	0.04
675	601399	国机重装	23,900	61,662.00	0.04
676	688276	百克生物	2,172	61,619.64	0.04
677	300772	运达股份	6,400	61,440.00	0.04
678	603936	博敏电子	7,300	61,320.00	0.04
679	603583	捷昌驱动	3,000	61,140.00	0.04
680	000950	重药控股	12,500	60,875.00	0.04

681	600477	杭萧钢构	25,900	60,347.00	0.04
682	002859	洁美科技	3,000	60,240.00	0.04
683	000966	长源电力	13,600	59,976.00	0.04
684	301236	软通动力	1,700	59,857.00	0.04
685	600754	锦江酒店	2,600	59,748.00	0.04
686	600663	陆家嘴	6,758	59,605.56	0.04
687	603128	华贸物流	10,300	59,431.00	0.04
688	600508	上海能源	4,200	59,430.00	0.04
689	300039	上海凯宝	11,100	59,385.00	0.04
690	300263	隆华科技	10,600	59,360.00	0.04
691	603920	世运电路	3,000	59,220.00	0.04
692	000065	北方国际	5,700	59,109.00	0.04
693	688709	成都华微	3,064	59,027.63	0.04
694	601609	金田股份	10,400	58,864.00	0.04
695	688127	蓝特光学	3,200	58,848.00	0.04
696	600861	北京人力	3,600	58,752.00	0.04
697	000550	江铃汽车	2,700	58,617.00	0.04
698	000617	中油资本	10,600	58,512.00	0.04
699	300271	华宇软件	12,500	58,500.00	0.04
700	600167	联美控股	11,100	57,831.00	0.04
701	300398	飞凯材料	4,700	57,810.00	0.04
702	001203	大中矿业	6,000	57,660.00	0.04
703	300428	立中集团	3,100	57,629.00	0.04
704	600997	开滦股份	8,400	57,624.00	0.04
705	300587	天铁股份	14,200	57,368.00	0.04
706	300401	花园生物	4,000	57,360.00	0.04
707	600675	中华企业	23,200	57,304.00	0.04
708	600284	浦东建设	10,700	57,138.00	0.04
709	601019	山东出版	4,800	56,736.00	0.04
710	688363	华熙生物	1,000	56,570.00	0.04
711	002545	东方铁塔	8,300	56,523.00	0.04
712	600449	宁夏建材	4,800	56,400.00	0.04
713	603919	金徽酒	3,100	56,327.00	0.04
714	600966	博汇纸业	11,700	55,926.00	0.04
715	002993	奥海科技	1,500	55,800.00	0.04
716	002761	浙江建投	7,100	55,451.00	0.04
717	600643	爱建集团	14,700	55,419.00	0.04
718	300820	英杰电气	1,400	55,076.00	0.04
719	000582	北部湾港	7,400	55,056.00	0.04

720	601808	中海油服	3,200	55,040.00	0.04
721	605507	国邦医药	3,300	54,945.00	0.04
722	600928	西安银行	16,800	54,936.00	0.04
723	600391	航发科技	3,600	54,900.00	0.04
724	000795	英洛华	9,900	54,846.00	0.04
725	603995	甬金股份	3,100	54,312.00	0.04
726	301087	可孚医疗	1,600	54,240.00	0.04
727	301015	百洋医药	2,300	54,119.00	0.04
728	300323	华灿光电	12,400	53,940.00	0.04
729	688190	云路股份	718	53,641.78	0.04
730	002204	大连重工	12,500	53,375.00	0.04
731	601801	皖新传媒	7,700	53,361.00	0.04
732	002697	红旗连锁	11,500	53,245.00	0.04
733	000061	农产品	10,900	52,974.00	0.04
734	002051	中工国际	7,600	52,896.00	0.04
735	688439	振华风光	794	52,761.30	0.04
736	603348	文灿股份	1,900	52,611.00	0.04
737	600682	南京新百	10,500	52,395.00	0.03
738	002891	中宠股份	2,500	52,175.00	0.03
739	003006	百亚股份	2,200	52,140.00	0.03
740	300003	乐普医疗	3,500	51,940.00	0.03
741	600955	维远股份	3,600	51,876.00	0.03
742	300377	赢时胜	10,200	51,816.00	0.03
743	603896	寿仙谷	2,200	51,634.00	0.03
744	000006	深振业 A	13,200	51,216.00	0.03
745	300142	沃森生物	4,500	51,210.00	0.03
746	002608	江苏国信	6,600	51,150.00	0.03
747	002068	黑猫股份	7,200	51,120.00	0.03
748	002979	雷赛智能	2,800	50,960.00	0.03
749	001213	中铁特货	12,900	50,955.00	0.03
750	600299	安迪苏	5,200	50,440.00	0.03
751	000567	海德股份	8,930	50,097.30	0.03
752	002488	金固股份	11,400	50,046.00	0.03
753	600320	振华重工	14,600	49,932.00	0.03
754	600929	雪天盐业	9,400	49,820.00	0.03
755	600507	方大特钢	13,200	49,368.00	0.03
756	603317	天味食品	4,300	49,063.00	0.03
757	600029	南方航空	8,300	48,887.00	0.03
758	603730	岱美股份	4,910	48,805.40	0.03

759	300953	震裕科技	900	48,780.00	0.03
760	688239	航宇科技	1,400	48,720.00	0.03
761	000828	东莞控股	5,400	48,654.00	0.03
762	600882	妙可蓝多	3,900	48,633.00	0.03
763	002612	朗姿股份	3,500	48,370.00	0.03
764	300759	康龙化成	2,600	48,308.00	0.03
765	601921	浙版传媒	6,300	48,132.00	0.03
766	600012	皖通高速	3,400	47,498.00	0.03
767	605376	博迁新材	2,100	47,397.00	0.03
768	002516	旷达科技	13,000	47,320.00	0.03
769	688508	芯朋微	1,300	47,281.00	0.03
770	003021	兆威机电	1,020	47,073.00	0.03
771	002646	天佑德酒	4,600	47,058.00	0.03
772	002206	海利得	12,300	46,986.00	0.03
773	600811	东方集团	71,000	46,860.00	0.03
774	300158	振东制药	12,200	46,604.00	0.03
775	301175	中科环保	10,600	46,534.00	0.03
776	603328	依顿电子	5,900	46,374.00	0.03
777	002987	京北方	4,380	46,121.40	0.03
778	002267	陕天然气	6,100	46,116.00	0.03
779	600648	外高桥	5,200	46,072.00	0.03
780	600751	海航科技	20,600	45,732.00	0.03
781	002218	拓日新能	16,000	45,600.00	0.03
782	300496	中科创达	1,000	45,590.00	0.03
783	301316	慧博云通	3,100	45,508.00	0.03
784	000062	深圳华强	5,100	45,390.00	0.03
785	603229	奥翔药业	4,500	45,225.00	0.03
786	300183	东软载波	3,900	45,162.00	0.03
787	000560	我爱我家	20,300	45,066.00	0.03
788	002556	辉隆股份	10,800	45,036.00	0.03
789	688800	瑞可达	1,600	44,928.00	0.03
790	002135	东南网架	11,300	44,748.00	0.03
791	002053	云南能投	3,700	44,733.00	0.03
792	603055	台华新材	4,400	44,572.00	0.03
793	605333	沪光股份	1,600	44,560.00	0.03
794	300223	北京君正	800	44,352.00	0.03
795	002461	珠江啤酒	5,900	43,778.00	0.03
796	600874	创业环保	7,800	43,602.00	0.03
797	300527	中船应急	6,700	43,349.00	0.03

798	603567	珍宝岛	4,100	43,173.00	0.03
799	601969	海南矿业	6,800	43,112.00	0.03
800	601069	西部黄金	3,700	43,031.00	0.03
801	000498	山东路桥	8,200	42,886.00	0.03
802	300768	迪普科技	3,600	42,660.00	0.03
803	002991	甘源食品	700	42,455.00	0.03
804	603733	仙鹤股份	2,400	42,192.00	0.03
805	603113	金能科技	7,700	42,119.00	0.03
806	300662	科锐国际	2,600	41,938.00	0.03
807	002242	九阳股份	4,000	41,920.00	0.03
808	002034	旺能环境	3,200	41,632.00	0.03
809	603105	芯能科技	4,700	41,360.00	0.03
810	600662	外服控股	10,300	41,303.00	0.03
811	300073	当升科技	1,200	41,172.00	0.03
812	002768	国恩股份	2,200	41,140.00	0.03
813	600810	神马股份	6,600	40,920.00	0.03
814	603299	苏盐井神	4,300	40,850.00	0.03
815	002573	清新环境	10,500	40,635.00	0.03
816	001323	慕思股份	1,400	40,278.00	0.03
817	000968	蓝焰控股	6,300	40,068.00	0.03
818	600032	浙江新能	5,500	40,040.00	0.03
819	300737	科顺股份	9,300	39,990.00	0.03
820	300037	新宙邦	1,400	39,984.00	0.03
821	300821	东岳硅材	5,800	39,672.00	0.03
822	300973	立高食品	1,400	39,326.00	0.03
823	000030	富奥股份	8,000	39,280.00	0.03
824	300285	国瓷材料	2,200	39,270.00	0.03
825	300012	华测检测	3,900	39,234.00	0.03
826	688381	帝奥微	2,000	38,960.00	0.03
827	000791	甘肃能源	6,300	38,871.00	0.03
828	301269	华大九天	500	38,525.00	0.03
829	301080	百普赛斯	1,100	38,500.00	0.03
830	600475	华光环能	4,400	38,324.00	0.03
831	601033	永兴股份	2,370	38,313.42	0.03
832	603439	贵州三力	3,000	38,280.00	0.03
833	603171	税友股份	1,400	37,856.00	0.03
834	688120	华海清科	196	37,157.68	0.02
835	300395	菲利华	1,200	36,900.00	0.02
836	688380	中微半导	2,200	36,784.00	0.02

837	603355	莱克电气	1,700	36,720.00	0.02
838	300146	汤臣倍健	2,700	36,585.00	0.02
839	002399	海普瑞	4,200	36,414.00	0.02
840	601326	秦港股份	11,400	36,138.00	0.02
841	000800	一汽解放	4,600	36,018.00	0.02
842	603025	大豪科技	2,600	35,932.00	0.02
843	002782	可立克	3,200	35,456.00	0.02
844	000718	苏宁环球	21,100	35,448.00	0.02
845	300454	深信服	700	35,371.00	0.02
846	000025	特力 A	2,600	34,944.00	0.02
847	688232	新点软件	1,752	34,549.44	0.02
848	301327	华宝新能	600	34,380.00	0.02
849	688695	中创股份	995	33,599.10	0.02
850	002978	安宁股份	1,200	33,432.00	0.02
851	688776	国光电气	600	33,240.00	0.02
852	603983	丸美股份	1,200	33,036.00	0.02
853	603595	东尼电子	1,600	32,944.00	0.02
854	002088	鲁阳节能	2,700	32,643.00	0.02
855	603396	金辰股份	1,000	32,470.00	0.02
856	601811	新华文轩	2,300	32,223.00	0.02
857	002866	传艺科技	2,500	32,175.00	0.02
858	601886	江河集团	6,500	31,720.00	0.02
859	301200	大族数控	1,000	31,560.00	0.02
860	300373	扬杰科技	800	31,120.00	0.02
861	600956	新天绿能	3,800	31,046.00	0.02
862	603989	艾华集团	2,200	30,932.00	0.02
863	300118	东方日升	2,500	30,250.00	0.02
864	300755	华致酒行	2,200	30,052.00	0.02
865	600618	氯碱化工	3,400	29,852.00	0.02
866	300294	博雅生物	900	29,700.00	0.02
867	000402	金融街	12,500	29,375.00	0.02
868	600903	贵州燃气	4,700	29,328.00	0.02
869	002534	西子洁能	2,900	29,029.00	0.02
870	002838	道恩股份	3,200	28,992.00	0.02
871	688046	药康生物	2,800	28,616.00	0.02
872	300567	精测电子	500	28,255.00	0.02
873	300601	康泰生物	1,800	28,098.00	0.02
874	002950	奥美医疗	4,200	27,720.00	0.02
875	300633	开立医疗	700	27,706.00	0.02

876	300390	天华新能	1,600	27,488.00	0.02
877	605222	起帆电缆	1,700	26,078.00	0.02
878	300803	指南针	700	25,487.00	0.02
879	000517	荣安地产	9,400	25,192.00	0.02
880	300763	锦浪科技	600	24,984.00	0.02
881	300676	华大基因	700	24,507.00	0.02
882	603693	江苏新能	2,100	24,402.00	0.02
883	000719	中原传媒	2,400	24,264.00	0.02
884	688128	中国电研	1,400	24,094.00	0.02
885	605369	拱东医疗	600	23,940.00	0.02
886	603530	神马电力	900	23,841.00	0.02
887	002946	新乳业	2,700	23,652.00	0.02
888	300860	锋尚文化	1,120	23,564.80	0.02
889	688209	英集芯	1,837	22,797.17	0.02
890	003039	顺控发展	1,800	22,554.00	0.02
891	605338	巴比食品	1,700	22,525.00	0.02
892	603093	南华期货	2,600	22,516.00	0.02
893	300748	金力永磁	1,700	22,032.00	0.01
894	603344	星德胜	926	21,907.79	0.01
895	002911	佛燃能源	2,370	21,661.80	0.01
896	002287	奇正藏药	1,100	21,538.00	0.01
897	300777	中简科技	1,000	21,500.00	0.01
898	601068	中铝国际	5,100	21,471.00	0.01
899	002918	蒙娜丽莎	2,300	20,838.00	0.01
900	002961	瑞达期货	1,900	20,805.00	0.01
901	603132	金徽股份	1,500	20,640.00	0.01
902	688012	中微公司	140	19,776.40	0.01
903	603103	横店影视	1,300	17,992.00	0.01
904	300769	德方纳米	600	16,920.00	0.01
905	300438	鹏辉能源	900	16,506.00	0.01
906	603350	安乃达	785	16,139.60	0.01
907	300244	迪安诊断	1,300	15,600.00	0.01
908	603285	键邦股份	740	13,801.00	0.01
909	300171	东富龙	1,100	13,079.00	0.01
910	300888	稳健医疗	500	12,650.00	0.01
911	301392	汇成真空	219	12,235.53	0.01
912	688279	峰昭科技	109	12,088.10	0.01
913	300376	ST 易事特	2,800	11,228.00	0.01
914	688200	华峰测控	122	11,193.50	0.01

915	688692	达梦数据	53	11,105.62	0.01
916	688535	华海诚科	161	11,031.72	0.01
917	300363	博腾股份	900	10,755.00	0.01
918	301538	骏鼎达	113	10,307.86	0.01
919	688332	中科蓝讯	174	10,264.26	0.01
920	688399	硕世生物	151	10,210.62	0.01
921	688631	莱斯信息	163	10,109.26	0.01
922	688630	芯碁微装	160	10,011.20	0.01
923	301029	怡合达	500	9,830.00	0.01
924	301536	星辰科技	300	9,678.00	0.01
925	688305	科德数控	148	9,540.08	0.01
926	688691	灿芯股份	192	9,480.96	0.01
927	688082	盛美上海	110	9,296.10	0.01
928	688568	中科星图	194	9,253.80	0.01
929	300726	宏达电子	400	9,120.00	0.01
930	301539	宏鑫科技	361	8,772.30	0.01
931	688621	阳光诺和	197	8,411.90	0.01
932	301095	广立微	200	8,224.00	0.01
933	301565	中仑新材	349	8,138.68	0.01
934	301566	达利凯普	484	8,107.00	0.01
935	688185	康希诺	196	8,053.64	0.01
936	300861	美畅股份	400	7,740.00	0.01
937	688668	鼎通科技	182	7,150.78	0.00
938	301591	肯特股份	191	7,051.72	0.00
939	688625	呈和科技	192	6,981.12	0.00
940	301580	爱迪特	93	6,882.00	0.00
941	688601	力芯微	155	6,771.95	0.00
942	688283	坤恒顺维	191	6,566.58	0.00
943	688159	有方科技	163	6,171.18	0.00
944	688020	方邦股份	184	6,138.24	0.00
945	688720	艾森股份	151	6,121.54	0.00
946	688627	精智达	130	6,034.60	0.00
947	688652	京仪装备	151	5,902.59	0.00
948	001389	广合科技	140	5,884.20	0.00
949	688531	日联科技	126	5,816.16	0.00
950	688682	霍莱沃	198	5,809.32	0.00
951	301587	中瑞股份	211	5,718.10	0.00
952	688603	天承科技	108	5,638.68	0.00
953	688799	华纳药厂	131	5,558.33	0.00

954	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
955	688702	盛科通信	134	5,427.00	0.00
956	688113	联测科技	186	5,276.82	0.00
957	301502	华阳智能	135	5,104.35	0.00
958	688045	必易微	169	5,081.83	0.00
959	688680	海优新材	176	5,058.24	0.00
960	688539	高华科技	186	5,005.26	0.00
961	688778	厦钨新能	160	4,998.40	0.00
962	688629	华丰科技	187	4,929.32	0.00
963	688626	翔宇医疗	154	4,887.96	0.00
964	688489	三未信安	178	4,741.92	0.00
965	688053	思科瑞	190	4,677.80	0.00
966	688651	盛邦安全	156	4,563.00	0.00
967	688322	奥比中光	170	4,540.70	0.00
968	688777	中控技术	118	4,448.60	0.00
969	688638	誉辰智能	137	4,275.77	0.00
970	688551	科威尔	132	4,158.00	0.00
971	688228	开普云	108	4,121.28	0.00
972	688646	逸飞激光	132	4,119.72	0.00
973	688584	上海合晶	252	3,999.24	0.00
974	688689	银河微电	178	3,778.94	0.00
975	688109	品茗科技	133	3,637.55	0.00
976	688251	井松智能	189	3,509.73	0.00
977	688217	睿昂基因	167	3,296.58	0.00
978	603341	龙旗科技	86	3,223.28	0.00
979	688435	英方软件	128	3,194.88	0.00
980	688767	博拓生物	123	3,083.61	0.00
981	688719	爱科赛博	117	3,050.19	0.00
982	688071	华依科技	139	3,012.13	0.00
983	688612	威迈斯	113	3,002.41	0.00
984	688051	佳华科技	181	3,000.98	0.00
985	688788	科思科技	128	2,976.00	0.00
986	688683	莱尔科技	178	2,849.78	0.00
987	688028	沃尔德	170	2,793.10	0.00
988	688737	中自科技	170	2,754.00	0.00
989	688311	盟升电子	130	2,663.70	0.00
990	688379	华光新材	190	2,604.90	0.00
991	688697	纽威数控	165	2,588.85	0.00
992	688006	杭可科技	148	2,582.60	0.00

993	688162	巨一科技	130	2,532.40	0.00
994	688093	世华科技	139	2,525.63	0.00
995	688078	龙软科技	106	2,441.18	0.00
996	688711	宏微科技	144	2,312.64	0.00
997	001359	平安电工	112	2,308.32	0.00
998	001387	雪祺电气	144	2,193.12	0.00
999	688479	友车科技	133	2,113.37	0.00
1,000	688273	麦澜德	101	1,999.80	0.00
1,001	603375	盛景微	48	1,866.24	0.00
1,002	688523	航天环宇	108	1,863.00	0.00
1,003	603325	博隆技术	27	1,836.54	0.00
1,004	688400	凌云光	108	1,801.44	0.00
1,005	001379	腾达科技	131	1,765.88	0.00
1,006	688021	奥福环保	191	1,757.20	0.00
1,007	603381	永臻股份	64	1,701.76	0.00
1,008	688135	利扬芯片	100	1,602.00	0.00
1,009	688260	昀冢科技	100	1,487.00	0.00
1,010	688593	新相微	148	1,480.00	0.00
1,011	688225	亚信安全	114	1,291.62	0.00
1,012	688163	赛伦生物	102	1,238.28	0.00
1,013	688549	中巨芯	172	1,161.00	0.00
1,014	688512	慧智微	125	1,061.25	0.00
1,015	688388	嘉元科技	100	975.00	0.00
1,016	688779	五矿新能	174	805.62	0.00
1,017	688469	芯联集成	153	605.88	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	300750	宁德时代	14,454,163.00	7.76
2	600519	贵州茅台	13,967,922.00	7.50
3	300760	迈瑞医疗	11,258,017.50	6.04
4	300274	阳光电源	9,182,291.00	4.93
5	601318	中国平安	8,610,852.00	4.62
6	300015	爱尔眼科	7,688,705.00	4.13

7	300308	中际旭创	6,455,968.20	3.47
8	300122	智飞生物	5,976,668.00	3.21
9	000858	五粮液	5,049,258.00	2.71
10	600227	赤天化	4,666,127.00	2.51
11	300014	亿纬锂能	4,632,714.00	2.49
12	600262	北方股份	4,549,741.00	2.44
13	688157	松井股份	4,533,346.50	2.43
14	300441	鲍斯股份	4,402,028.50	2.36
15	605136	丽人丽妆	4,354,577.00	2.34
16	002035	华帝股份	4,291,968.00	2.30
17	300124	汇川技术	4,143,088.00	2.22
18	002623	亚玛顿	4,066,817.00	2.18
19	600510	黑牡丹	4,016,907.00	2.16
20	603956	威派格	3,991,749.00	2.14
21	300365	恒华科技	3,977,718.00	2.14
22	600030	中信证券	3,943,328.00	2.12
23	601899	紫金矿业	3,926,096.00	2.11
24	600662	外服控股	3,913,739.00	2.10
25	600887	伊利股份	3,902,317.00	2.10
26	605108	同庆楼	3,816,033.00	2.05
27	688737	中自科技	3,772,406.87	2.03
28	300059	东方财富	3,744,192.00	2.01
29	688255	凯尔达	3,743,885.43	2.01
30	002383	合众思壮	3,738,206.00	2.01
31	002236	大华股份	3,736,807.00	2.01

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	300750	宁德时代	14,281,927.00	7.67
2	600519	贵州茅台	11,937,135.50	6.41
3	300760	迈瑞医疗	11,365,763.00	6.10
4	300274	阳光电源	11,194,814.22	6.01

5	300015	爱尔眼科	8,212,455.41	4.41
6	601318	中国平安	7,562,163.00	4.06
7	000858	五粮液	6,809,321.00	3.66
8	300122	智飞生物	6,390,635.21	3.43
9	300308	中际旭创	5,740,973.00	3.08
10	002594	比亚迪	5,608,297.00	3.01
11	300014	亿纬锂能	5,129,577.00	2.75
12	600262	北方股份	4,570,905.00	2.45
13	600887	伊利股份	4,480,258.00	2.41
14	600227	赤天化	4,452,280.00	2.39
15	300441	鲍斯股份	4,448,257.12	2.39
16	601899	紫金矿业	4,308,072.00	2.31
17	688157	松井股份	4,280,483.76	2.30
18	605136	丽人丽妆	4,272,340.00	2.29
19	002623	亚玛顿	4,269,517.00	2.29
20	002035	华帝股份	4,245,276.00	2.28
21	600510	黑牡丹	4,184,675.00	2.25
22	000651	格力电器	4,070,564.00	2.19
23	688737	中自科技	3,973,180.04	2.13
24	600030	中信证券	3,946,675.00	2.12
25	002383	合众思壮	3,923,200.00	2.11
26	300365	恒华科技	3,890,029.00	2.09
27	605108	同庆楼	3,840,702.00	2.06
28	600662	外服控股	3,830,337.00	2.06
29	300860	锋尚文化	3,814,229.48	2.05
30	603956	威派格	3,810,318.00	2.05

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	1,453,413,482.62
卖出股票收入（成交）总额	1,471,034,045.70

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

本基金在股指期货的投资中将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，采用流动性好、交易活跃的期货合约，并充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，主要遵循避险和有效管理两项策略和原则：（1）避险：在市场风险大幅累积时，减小基金投资组合因市场下跌而遭受的市场风险；（2）有效管理：利用股指期货流动性好、交易成本低等特点，通过股指期货对投资组合的仓位进行及时调整，提高投资组合的运作效率。

## 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。

### 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

本基金投资的前十名证券中，中信证券（代码：600030.SH）符合此类情形：

2024年5月10日，中国证券监督管理委员会广东监管局对中信证券作为广东泉为科技股份有限公司（原广东国立科技股份有限公司）首次公开发行股票持续督导机构，在持续督导履职过

程中存在违规行为，采取出具警示函的行政监管措施。

2024 年 4 月 20 日，中国证券监督管理委员会对中信证券在相关主体违反限制性规定转让中核钛白 2023 年非公开发行股票过程中违法违规，采取警告、罚款、没收违法所得、没收非法财物、责令改正的监管措施。

2024 年 1 月 12 日，中国证券监督管理委员会对中信证券保荐恒逸石化股份有限公司（发行人）可转债项目，发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑 50%以上，采取出具警示函的行政监管措施。

2023 年 10 月 30 日，中国证券监督管理委员会深圳监管局对中信证券存在组织架构规范整改工作中报送的整改方案不完整，金石投资有限公司（公司全资子公司，以下简称金石投资）、青岛金石灏纳投资有限公司的多个待整改项目未按要求完成清理等问题，采取责令改正措施。

2023 年 9 月 28 日，中国证券监督管理委员会对中信证券在担任航天通信控股集团股份有限公司收购智慧海派科技有限公司重大资产重组财务顾问过程中，存在违规情形，采取监管谈话的行政监管措施。

2023 年 8 月 31 日，中国证券监督管理委员会深圳证监局对中信证券及私募子公司金石投资的私募资产管理业务存在资管新规整改落实不到位，部分资管产品估值核算方法未及时调整、违约资产未及时减值处理、过渡期结束时仍存在多层嵌套产品、填报私募资管业务数据不准确、个别单一产品存在部分定期和临时报告材料缺失、在封闭运作期间追加委托投资的情形，采取出具警示函的行政监管措施。

2023 年 7 月 13 日，中国证券监督管理委员会深圳证监局对中信证券在 2023 年 6 月 19 日的网络安全事件中，存在机房基础设施建设安全性不足，信息系统设备可靠性管理疏漏等问题，违反了《证券期货业网络和信息安全管理办法》（证监会令第 218 号，以下简称《网络和信息安全管理办法》）第十三条相关规定，采取出具警示函的行政监管措施。

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的规定。

除中信证券外，本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现监管部门立案调查，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	67,963.64
2	应收清算款	30,417.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	500.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,881.23

### 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	608	102,426.40	1,422.51	0.00%	62,273,827.75	100.00%
中航量化阿尔法六个月持有 C	1,146	137,668.77	-	-	157,768,409.33	100.00%
合计	1,738	126,607.40	1,422.51	0.00%	220,042,237.08	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	429,506.87	0.69%
	中航量化阿尔法六个月持有 C	1,900,347.01	1.20%
	合计	2,329,853.88	1.06%

### 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	0~10
	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	67,576,433.04	174,375,246.70
本报告期基金总申购份额	41,196.64	34,082.91
减：本报告期基金总赎回份额	5,342,379.42	16,640,920.28
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	62,275,250.26	157,768,409.33

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. 本报告期内，基金托管人无重大人事变动。
2. 2024 年 1 月 31 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 1 月 29 日起，王华先生不再担任中航基金管理有限公司副总经理。
3. 2024 年 7 月 1 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 6 月 29 日起，刘建先生不再担任公司总经理职务、另有工作安排；武国强先生不再担任公司督察长职务。
4. 2024 年 7 月 1 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 7 月 1 日起，刘建先生担任公司督察长职务并且代履行公司总经理职务，代履行期限不超过 6 个月。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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	

东吴证券股份有限公司	2	1,739,857,256.22	59.51%	1,297,762.93	59.51%	-
国金证券股份有限公司	2	1,173,945,122.49	40.16%	875,645.23	40.16%	-
中航证券有限公司	2	9,723,348.60	0.33%	7,252.14	0.33%	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、此处的佣金指本基金通过证券公司的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该证券公司的佣金合计，不单指股票交易佣金。

2、选择标准：①实力雄厚，信誉良好；②研究、交易实力较强，选择需要支付研究服务费用的证券公司，应考察其研究服务能力，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，并能提供基金全面的信息服务。

选择程序：①对合作证券公司研究机构实行评分制；②研究部根据证券公司研究机构的评分结果及交易单元租用协议的谈判结果向投资决策委员会申请开通交易单元或调整佣金；③中央交易室根据投资决策委员会决议与证券公司签订交易单元租用协议或券结协议

3、本报告期内本基金注销 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
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 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	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 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
2	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 31 日
3	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2023 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
4	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2024 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	2024 年 4 月 20 日
5	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 6 月 26 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](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

2024 年 8 月 30 日