

江信同福灵活配置混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:江信基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

送出日期:2025 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年01月01日起至2025年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	79
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
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	81
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	82
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	82
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	82
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
7.12 投资组合报告附注	82
§8 基金份额持有人信息	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	84
§9 开放式基金份额变动	84
§10 重大事件揭示	84
10.1 基金份额持有人大会决议	84
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	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
10.4 基金投资策略的改变	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
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	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	85
10.8 其他重大事件	86
§11 影响投资者决策的其他重要信息	88
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	88
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	88
§12 备查文件目录	88
12.1 备查文件目录	88
12.2 存放地点	88
12.3 查阅方式	88

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	江信同福灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	江信同福	
基金主代码	001675	
交易代码	001675	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年08月28日	
基金管理人	江信基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	10,846,701.98份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	江信同福A	江信同福C
下属分级基金的交易代码	001675	001676
报告期末下属分级基金的份额总额	5,926,261.94份	4,920,440.04份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力争实现基金资产较高的长期稳健回报。
投资策略	本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在有效控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。
业绩比较基准	沪深300指数×50%+上证国债指数×50%。
风险收益特征	本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和

	债券型基金，低于股票型基金。	
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。	本基金属于主动式混合型证券投资基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

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		江信基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	孙剑	王茵
	联系电话	400-622-0583	010-63639180
	电子邮箱	customer@jxfund.cn	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-622-0583	95595
传真		010-57380988	010-63639132
注册地址		北京市海淀区复兴路69号院11号楼3层101	北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
办公地址		北京市海淀区华熙LIVE中心11号楼B座3层	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
邮政编码		100039	100033
法定代表人		孙桢磳	吴利军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.jxfund.cn
基金中期报告备置地点	北京市海淀区华熙LIVE中心11号楼B座3层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	江信同福A	江信同福C
本期已实现收益	711,661.97	526,078.57
本期利润	1,055,471.11	822,208.50
加权平均基金份额本期利润	0.1675	0.1484
本期加权平均净值利润率	10.87%	10.12%
本期基金份额净值增长率	11.48%	11.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
期末可供分配利润	1,019,206.08	538,137.10
期末可供分配基金份额利润	0.1720	0.1094
期末基金资产净值	9,834,251.88	7,778,628.61
期末基金份额净值	1.6594	1.5809
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	72.35%	63.40%

- 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，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。
- 3、基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平

要低于所列数字。

4、表中的“期末”均指报告期最后一日，无论该日是否为开放日或交易所的交易日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

江信同福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	3.15%	0.59%	1.39%	0.25%	1.76%	0.34%
过去三个月	7.45%	1.28%	1.24%	0.47%	6.21%	0.81%
过去六个月	11.48%	1.10%	0.75%	0.44%	10.73%	0.66%
过去一年	33.19%	1.57%	8.96%	0.61%	24.23%	0.96%
过去三年	-2.78%	1.33%	1.06%	0.50%	-3.84%	0.83%
自基金合同生效起至今	72.35%	1.33%	36.21%	0.62%	36.14%	0.71%

江信同福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	3.10%	0.59%	1.39%	0.25%	1.71%	0.34%
过去三个月	7.32%	1.28%	1.24%	0.47%	6.08%	0.81%
过去六个月	11.21%	1.10%	0.75%	0.44%	10.46%	0.66%
过去一年	32.53%	1.57%	8.96%	0.61%	23.57%	0.96%
过去三年	-4.23%	1.33%	1.06%	0.50%	-5.29%	0.83%
自基金合同生效起至今	63.40%	1.33%	36.21%	0.62%	27.19%	0.71%

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

江信同福A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年08月28日-2025年06月30日)



江信同福C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年08月28日-2025年06月30日)



§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

江信基金管理有限公司是2012年12月经中国证监会（证监基字[2012]1717号文）批准设立的基金管理公司，注册资本1.8亿元人民币，股东为：国盛证券有限责任公司、安徽恒生阳光控股有限公司、金麒麟投资有限公司、鹰潭红石投资管理有限合伙企业、鹰

潭聚福投资管理有限合伙企业。目前，各家持股比例分别为：30%、17.5%、17.5%、17.5%、17.5%。公司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。截至2025年06月30日，本基金管理人管理的开放式基金为：江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、江信祺福债券型证券投资基金、江信添福债券型证券投资基金、江信洪福纯债债券型证券投资基金、江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金、江信一年定期开放债券型证券投资基金、江信增利货币市场基金。同时，公司还管理着多个资产管理计划。

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		
高鹏飞	本基金的基金经理，权益投资总部总监	2023-09-15	-	11年	高鹏飞先生，硕士，CPA。曾任德勤会计师事务所审计师；投中资本分析师。2013年8月至2017年11月担任海通证券股份有限公司投资经理。2017年11月至2020年5月担任华夏久盈资产管理有限责任公司投资经理。2020年6月加入江信基金管理有限公司，任职于权益投资总部，现任权益投资总部总监，并担任江信瑞福灵活配置混合型证券投资基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、江信祺福债券型证券投资基金基金经理。具有基金从业资格。中国国籍。
李悦	本基金基金经理助	2024-	-	3年	李悦，硕士研究生。2021年

	理	03-11			加入江信基金管理有限公司，现就职于权益投资总部。具有基金从业资格。中国国籍。
--	---	-------	--	--	--

- 1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期或基金成立日期填写；
- 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

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

为保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者的合法权益，避免不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，本公司根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《江信基金管理有限公司公平交易管理办法》，形成涵盖封闭式基金、开放式基金和资产管理计划的投资管理，涉及交易所市场、银行间市场等投资市场，并包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各环节的公平交易机制。

本报告期内，基金管理人通过不断完善研究方法和投资决策流程，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合享有公平的投资决策机会；公司严格贯彻投资管理职能和交易执行职能相隔离的原则，实行集中交易制度，建立和完善公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会；公司不断加强对投资交易行为的监察稽核力度，确保做好对公平交易各环节的监控和分析评估工作。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易行为。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与交易所公开竞价交易，未出现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的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

2025年上半年中国GDP同比增长5.2%，其中二季度增速回升至5.4%，较一季度（5.0%）明显改善。生产端持续走强，工业增加值同比增长6.1%，高技术制造业增速达11.2%，新能源装备、半导体设备产量增幅超20%。

投资端：基建投资同比增长9.8%（专项债加速投放+设备更新专项资金落地）；制造业投资增长7.5%（政策贴息支持技术改造）；地产投资降幅收窄至-3.1%（核心城市限购松绑带动销售回暖）。消费端：社会零售总额增长4.5%，服务消费（旅游/餐饮增速8.3%）强于商品，汽车销售因以旧换新补贴放量增长11%。出口端：前6月以人民币计价出口增长3.8%，电动车、锂电池贡献主要增量，对东盟出口增速达12.6%。

上半年货币财政政策积极发力：央行推出“结构性降息”，定向调降科技企业贷款利率50BP；财政前置发力，1-6月新增专项债发行2.8万亿元（同比+40%），推动基建形成实物工作量。CPI温和回升至0.8%，PPI筑底企稳（6月同比-0.5%）。

上半年，以基本面因子为主轴，筛选营收、利润、ROE等有长期增长趋势的公司，并通过因子边际变化率来体现动量势能，继而结合估值和业绩预期来动态调整标的、最后参考量价等技术类指标形成最终持仓组合。并对各项因子进行均衡动态调正，达到配置更加均衡和稳健的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末江信同福A基金份额净值为1.6594元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.48%，同期业绩比较基准收益率为0.75%；截至报告期末江信同福C基金份额净值为1.5809元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为11.21%，同期业绩比较基准收益率为0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预期下半年政策延续精准发力：预计特别国债项目加速落地（三季度集中拨付超1万亿元），基建投资增速维持8%以上；制造业设备更新贷款贴息政策延至年底，支撑制造业投资韧性。

消费有望渐进修复：服务消费（文旅、健康）保持高景气，商品消费受“以旧换新”政策退坡影响增速略有回落，全年社零增速预计4.3%-4.8%。

通胀有望温和回升：CPI有望于Q4攀升至1.5%附近（低基数+猪周期触底），PPI在三季度末转正（上游资源品补库+基建需求释放）

风格切换：上半年高股息防御策略占优，预期下半年可逐步布局景气反转行业等新质生产力领域；反内卷政策会一定程度在供给侧孕育出新的板块机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会负责人为公司总经理，成员包括投资、会计、研究、风控、合规等岗位资深人员。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经验。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

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

本基金自2023年9月19日至本报告期末，期间基金资产净值低于5000万元。本基金存在连续60个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，本基金管理人已按法规要求向中国证监会报送解决方案。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在江信同福灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生

任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作、信息披露等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面由投资管理人依据基金合同及实际运作情况进行处理。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

中国光大银行股份有限公司依法对基金管理人编制的《江信同福灵活配置混合型证券投资基金2025年中期报告》进行了复核，认为报告中相关财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：江信同福灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,484,485.51	2,439,514.36
结算备付金		216,939.28	291,265.70
存出保证金		11,437.51	24,643.18
交易性金融资产	6.4.7.2	15,665,960.80	17,926,673.10
其中：股票投资		15,665,960.80	17,926,673.10
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	-	-
应收清算款		387,401.98	5,893.86
应收股利		-	-
应收申购款		38,759.30	6,610.66
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		17,804,984.38	20,694,600.86
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024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		-	293,491.24
应付赎回款		55,272.55	13,707.99
应付管理人报酬		10,031.07	12,307.29
应付托管费		2,149.51	2,637.25
应付销售服务费		3,177.13	4,327.49
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	6.4.7.5	121,473.63	291,384.68
负债合计		192,103.89	617,855.94
净资产：			

实收基金	6.4.7.6	10,846,701.98	13,801,176.69
未分配利润	6.4.7.7	6,766,178.51	6,275,568.23
净资产合计		17,612,880.49	20,076,744.92
负债和净资产总计		17,804,984.38	20,694,600.86

6.2 利润表

会计主体：江信同福灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
一、营业总收入		1,988,641.49	-3,886,133.91
1.利息收入		6,809.25	48,178.38
其中：存款利息收入	6.4.7.8	6,809.25	16,367.19
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		-	31,811.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		1,339,100.83	-3,392,070.91
其中：股票投资收益	6.4.7.9	1,143,046.91	-3,538,915.28
基金投资收益	6.4.7.10	-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	38,841.62
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	196,053.92	108,002.75
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	639,939.07	-548,442.99
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	2,792.34	6,201.61
减：二、营业总支出		110,961.88	227,676.41
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	62,029.80	83,825.37
2.托管费	6.4.10.2.2	13,292.09	17,962.56
3.销售服务费	6.4.10.2.3	20,232.48	27,725.36
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	15,407.51	98,163.12
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		1,877,679.61	-4,113,810.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		1,877,679.61	-4,113,810.32
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,877,679.61	-4,113,810.32

6.3 净资产变动表

会计主体：江信同福灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,801,176.69	6,275,568.23	20,076,744.92
二、本期期初净资产	13,801,176.69	6,275,568.23	20,076,744.92
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,954,474.71	490,610.28	-2,463,864.43
（一）、综合收益总额	-	1,877,679.61	1,877,679.61
（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）	-2,954,474.71	-1,387,069.33	-4,341,544.04
其中：1.基金申购款	1,030,527.10	530,403.70	1,560,930.80
2.基金赎回款	-3,985,001.81	-1,917,473.03	-5,902,474.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	10,846,701.98	6,766,178.51	17,612,880.49
项目	上年度可比期间		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	19,920,664.35	8,651,215.72	28,571,880.07
二、本期期初净资产	19,920,664.35	8,651,215.72	28,571,880.07
三、本期增减变动	-2,432,010.71	-4,771,583.33	-7,203,594.04

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-4,113,810.32	-4,113,810.32
（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）	-2,432,010.71	-657,773.01	-3,089,783.72
其中：1.基金申购款	1,889,525.51	567,875.61	2,457,401.12
2.基金赎回款	-4,321,536.22	-1,225,648.62	-5,547,184.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	17,488,653.64	3,879,632.39	21,368,286.03

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：

孙剑

孙剑

刘健菲

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

江信同福灵活配置混合型证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2015]1496号文《关于核准江信同福灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由江信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《江信同福灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责在2015年8月10日至2015年8月21日公开募集。

本基金根据认购/申购费用、销售服务收取方式的不同，将基金份额分级。其中在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称

为A类基金份额，其基金代码为001675,基金简称为"江信同福A";在投资者认购/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额，其基金代码为001676,基金简称为"江信同福C"。

本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集，江信同福A不包括认购资金利息共募集127,337,397.62元，江信同福C不包括认购资金利息共募集112,999,629.74元，合计240,337,027.36元，已经大华会计师事务所（特殊普通合伙）大华验字[2015]000850号验资报告予以验证。经中国证监会备案，《江信同福灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年8月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为240,348,155.57份基金份额，其中认购资金利息折合11,128.21基金份额。本基金的基金管理人为江信基金管理有限公司，基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业/公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。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。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的0%-95%；权证投资占基金资产净值的0%-3%；在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或监管机构以后变更投资品种的投资比例限额，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数×50%+上证国债指数×50%。如果今后法律法规发生变化，或指数编制机构调整或停止该等指数的发布，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时，基金管理人可以在与基金托管人协商一致并报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

本财务报表由本基金的基金管理人江信基金管理有限公司于2025年08月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

（一）编制基础

本基金以持续经营为基础，根据实际发生的交易和事项，按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》和各项具体会计准则、企业会计准则应用指南、企业会计准则解释及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)，同时参照《资产管理产品相关会计

处理规定》、《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编报规则第3号——会计报表附注的编制及披露》以及《证券投资基金会计核算业务指引》等财政部、中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定编制财务报表。

（二）持续经营能力评价

本基金不存在导致对报告期末起12个月内的持续经营假设产生重大疑虑的事项或情况。

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，同时参照《资产管理产品相关会计处理规定》《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编报规则第3号——会计报表附注的编制及披露》以及《证券投资基金会计核算业务指引》等财政部、中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和净值变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

会计年度自公历1月1日起至6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金采用人民币为记账本位币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

本基金根据所管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为以下三类：

- （1）以摊余成本计量的金融资产。
- （2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。
- （3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金以摊余成本计量的金融资产主要包括货币资金、买入返售金融资产等，本基金没有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

2、金融负债的分类

本基金根据所发行金融工具的合同条款及其所反映的经济实质而非仅以法律形式，结合金融负债和权益工具的定义，在初始确认时将该金融工具或其组成部分分类为金融

负债或权益工具。金融负债在初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、其他金融负债、被指定为有效套期工具的衍生工具。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1、金融资产的初始确认、后续计量

金融资产在初始确认时以公允价值计量，但是因销售商品或提供服务等产生的应收账款或应收票据未包含重大融资成分或不考虑不超过一年的融资成分的，按照交易价格进行初始计量。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，相关交易费用直接计入当期损益，其他类别的金融资产相关交易费用计入其初始确认金额。

金融资产的后续计量取决于其分类，当且仅当本公司改变管理金融资产的业务模式时，才对所有受影响的相关金融资产进行重分类。

(1) 分类为以摊余成本计量的金融资产

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。

本基金对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入，按摊余成本进行后续计量，其发生减值时或终止确认、修改产生的利得或损失，计入当期损益。除下列情况外，本基金根据金融资产账面余额乘以实际利率计算确定利息收入：

1) 对于购入或源生的已发生信用减值的金融资产，本基金自初始确认起，按照该金融资产的摊余成本和经信用调整的实际利率计算确定其利息收入。

2) 对于购入或源生的未发生信用减值、但在后续期间成为已发生信用减值的金融资产，本基金在后续期间，按照该金融资产的摊余成本和实际利率计算确定其利息收入。若该金融工具在后续期间因其信用风险有所改善而不再存在信用减值，本基金转按实际利率乘以该金融资产账面余额来计算确定利息收入。

(2) 分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

金融资产的合同条款规定在特定日期产生的现金流量仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付，且管理该金融资产的业务模式既以收取合同现金流量为目标又以出售该金融资产为目标，则本基金将该金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金对此类金融资产采用实际利率法确认利息收入。除利息收入、减值损失及汇兑差额确认为当期损益外，其余公允价值变动计入其他综合收益。当该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入当期损益。

(3) 指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产

在初始确认时，本基金可以单项金融资产为基础不可撤销地将非交易性权益工具投资指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

此类金融资产的公允价值变动计入其他综合收益，不需计提减值准备。该金融资产终止确认时，之前计入其他综合收益的累计利得或损失从其他综合收益中转出，计入留存收益。本基金持有该权益工具投资期间，在本基金收取股利的权利已经确立，与股利相关的经济利益很可能流入本基金，且股利的金额能够可靠计量时，确认股利收入并计入当期损益。本基金对此类金融资产在其他权益工具投资项目下列报。

权益工具投资满足下列条件之一的，属于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：取得该金融资产的目的主要是为了近期出售；初始确认时属于集中管理的可辨认金融资产工具组合的一部分，且有客观证据表明近期实际存在短期获利模式；属于衍生工具（符合财务担保合同定义的以及被指定为有效套期工具的衍生工具除外）。

（4）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

不符合分类为以摊余成本计量或以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件、亦不指定为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产均分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

本基金对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产、其他非流动金融资产项目列报。

（5）指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

在初始确认时，本基金为了消除或显著减少会计错配，可以单项金融资产为基础不可撤销地将金融资产指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

混合合同包含一项或多项嵌入衍生工具，且其主合同不属于以上金融资产的，本基金可以将其整体指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具。但下列情况除外：

- 1) 嵌入衍生工具不会对混合合同的现金流量产生重大改变。
- 2) 在初次确定类似的混合合同是否需要分拆时，几乎不需分析就能明确其包含的嵌入衍生工具不应分拆。如嵌入贷款的提前还款权，允许持有人以接近摊余成本的金额提前偿还贷款，该提前还款权不需要分拆。

本基金对此类金融资产采用公允价值进行后续计量，将公允价值变动形成的利得或损失以及与此类金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。

本基金对此类金融资产根据其流动性在交易性金融资产、其他非流动金融资产项目列报。

2、金融负债的初始确认、后续计量

金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，相关的交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

金融负债的后续计量取决于其分类：

(1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

此类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和初始确认时指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

满足下列条件之一的，属于交易性金融负债：承担相关金融负债的目的主要是为了在近期内出售或回购；属于集中管理的可辨认金融工具组合的一部分，且有客观证据表明企业近期采用短期获利方式模式；属于衍生工具，但是，被指定且为有效套期工具的衍生工具、符合财务担保合同的衍生工具除外。交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具），按照公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，所有公允价值变动均计入当期损益。

在初始确认时，为了提供更相关的会计信息，本基金将满足下列条件之一的金融负债不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债：

1) 能够消除或显著减少会计错配。

2) 根据正式书面文件载明的企业风险管理或投资策略，以公允价值为基础对金融负债组合或金融资产和金融负债组合进行管理和业绩评价，并在企业内部以此为基础向关键管理人员报告。

本基金对此类金融负债采用公允价值进行后续计量，除由本基金自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益之外，其他公允价值变动计入当期损益。除非由本基金自身信用风险变动引起的公允价值变动计入其他综合收益会造成或扩大损益中的会计错配，本基金将所有公允价值变动（包括自身信用风险变动的的影响金额）计入当期损益。

(2) 其他金融负债

除下列各项外，本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债，对此类金融负债采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销产生的利得或损失计入当期损益：

1) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

2) 金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债。

3) 不属于本条前两类情形的财务担保合同，以及不属于本条第1)类情形的以低于市场利率贷款的贷款承诺。

财务担保合同是指当特定债务人到期不能按照最初或修改后的债务工具条款偿付债务时，要求发行方向蒙受损失的合同持有人赔付特定金额的合同。不属于指定为以公

允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债的财务担保合同，在初始确认后按照损失准备金额以及初始确认金额扣除担保期内的累计摊销额后的余额孰高进行计量。

3、金融资产和金融负债的终止确认

(1) 金融资产满足下列条件之一的，终止确认金融资产，即从其账户和资产负债表内予以转销：

- 1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止。
- 2) 该金融资产已转移，且该转移满足金融资产终止确认的规定。

(2) 金融负债终止确认条件

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，则终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

本基金与借出方之间签订协议，以承担新金融负债方式替换原金融负债，且新金融负债与原金融负债的合同条款实质上不同的，或对原金融负债（或其一部分）的合同条款做出实质性修改的，则终止确认原金融负债，同时确认一项新金融负债，账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，计入当期损益。

本基金回购金融负债一部分的，按照继续确认部分和终止确认部分在回购日各自的公允价值占整体公允价值的比例，对该金融负债整体的账面价值进行分配。分配给终止确认部分的账面价值与支付的对价（包括转出的非现金资产或承担的负债）之间的差额，应当计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具等金融资产和负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融资产或金融负债，以活跃市场的报价确定其公允价值，除非该项金融资产存在针对资产本身的限售期。对于针对资产本身的限售的金融资产，按照活跃市场的报价扣除市场参与者因承担指定期间内无法在公开市场上出售该金融资产的风险而要求获得的补偿金额后确定。活跃市场的报价包括易于且可定期从交易所、交易商、经纪人、行业集团、定价机构或监管机构等获得相关资产或负债的报价，且能代表在公平交易基础上实际并经常发生的市场交易。

初始取得或衍生的金融资产或承担的金融负债，以市场交易价格作为确定其公允价值的基础。

不存在活跃市场的金融资产或金融负债，采用估值技术确定其公允价值。在估值时，本公司采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，选择与市场参与者在相关资产或负债的交易中所考虑的资产或负债特征相一致的输入值，并尽可能优先使用相关可观察输入值。在相关可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，使用不可观察输入值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- (1) 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- (2) 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

1、利息收入

对于以摊余成本计量的金融资产及分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产中计息的金融工具，基金按照实际利率法确认利息收入。

分类为债权投资以及其他债权投资的债券投资和资产支持证券投资在持有期间按照实际利率法计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

应收款项在持有期间按照实际利率法确认利息收入，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

买入返售金融资产在返售期间内按实际利率法确认利息收入。

2、投资收益

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具在持有期间取得的收益确认为投资收益，在持有期间的公允价值变动扣除按照票面或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额

确认为公允价值变动损益，处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益，同时将原计入公允价值变动损益的金额结转至投资收益。

分类为交易性金融资产的债券投资和资产支持证券投资在持有期间按照票面或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的费用支出包括：管理人报酬、托管费、信息披露费用、与本基金相关的审计费和律师费以及按照国家规定可以列入的其他费用。

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按本基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。暂估业绩报酬为假设本基金于本报告期末按照当日的基金份额净值(计提业绩报酬前)清算，根据基金份额持有人持有的基金份额(包括未到期份额)至该日止持有期间的收益情况估算的业绩报酬。

卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为6次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的50%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

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

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期未发生外币交易。

6.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金在运用会计政策过程中，由于经营活动内在的不确定性，本基金需要对无法准确计量的报表项目的账面价值进行判断、估计和假设。这些判断、估计和假设是基于本基金的管理人过去的历史经验，并在考虑其他相关因素的基础上做出的。这些判断、估计和假设会影响收入、费用、资产和负债的报告金额以及资产负债表日或有负债的披露。然而，这些估计的不确定性所导致的实际结果可能与本基金管理层当前的估计存在差异，进而造成对未来受影响的资产或负债的账面金额进行重大调整。本基金对前述判断、估计和假设在持续经营的基础上进行定期复核，会计估计的变更仅影响变更当期的，其影响数在变更当期予以确认；既影响变更当期又影响未来期间的，其影响数在变更当期和未来期间予以确认。于资产负债表日，本基金需对财务报表项目金额进行判断、估计和假设的重要领域如下：

1、金融工具的减值

本基金采用预期信用损失模型对以摊余成本计量的应收款项及债权投资等的减值进行评估。运用预期信用损失模型涉及基金管理人的重大判断和估计。预期信用损失计量的关键参数包括违约概率、违约损失率和违约风险敞口。本基金考虑历史统计数据的定量分析及前瞻性信息，建立违约概率、违约损失率及违约风险敞口模型。实际的金融工具减值结果与原先估计的差异将在估计被改变的期间影响金融工具的账面价值及信用减值损失的计提或转回。

2、公允价值计量

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

（1）对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金按照中国证监会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)的规定，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和资产支持证券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》(证监会公告[2017]13号)及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》，采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和资产支持证券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本期本基金无会计政策变更事项。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本期本基金无会计估计变更事项。

6.4.5.3 差错更正的说明

本期本基金无差错更正事项。

6.4.6 税项

1、主要税种及税率

税种	计税依据	税率
增值税	销售货物或提供应税劳务过程中产生的增值额	按3%税率计缴
城市维护建设税	实际缴纳的流转税税额	7%
教育费附加	实际缴纳的流转税税额	3%
地方教育附加	实际缴纳的流转税税额	2%
企业所得税	应纳税所得额	25%

2、税收优惠及批文

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财

税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，本基金主要享有以下税收优惠：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(4) 本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 2025年06月30日
活期存款	1,484,485.51
等于：本金	1,484,318.34
加：应计利息	167.17
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-

存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,484,485.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,658,469.25	-	15,665,960.80	7,491.55
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	15,658,469.25	-	15,665,960.80	7,491.55

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本期末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末，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

本期末，本基金无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06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	115,366.12	
其中：交易所市场	115,366.12	
银行间市场	-	
应付利息	-	
预提费用	6,107.51	
合计	121,473.63	

6.4.7.6 实收基金

6.4.7.6.1 江信同福A

金额单位：人民币元

项目 (江信同福A)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	6,824,415.31
本期申购	476,060.60	476,060.60
本期赎回（以“-”号填列）	-1,374,213.97	-1,374,213.97
本期末	5,926,261.94	5,926,261.94

6.4.7.6.2 江信同福C

金额单位：人民币元

项目 (江信同福C)	本期 2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
	上年度末	6,976,761.38
本期申购	554,466.50	554,466.50

本期赎回（以“-”号填列）	-2,610,787.84	-2,610,787.84
本期末	4,920,440.04	4,920,440.04

申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

6.4.7.7.1 江信同福A

单位：人民币元

项目 (江信同福A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	355,233.87	2,978,813.68	3,334,047.55
本期期初	355,233.87	2,978,813.68	3,334,047.55
本期利润	711,661.97	343,809.14	1,055,471.11
本期基金份额交易产生的变动数	-47,689.76	-433,838.96	-481,528.72
其中：基金申购款	34,008.62	217,567.79	251,576.41
基金赎回款	-81,698.38	-651,406.75	-733,105.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,019,206.08	2,888,783.86	3,907,989.94

6.4.7.7.2 江信同福C

单位：人民币元

项目 (江信同福C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-8,930.52	2,950,451.20	2,941,520.68
本期期初	-8,930.52	2,950,451.20	2,941,520.68
本期利润	526,078.57	296,129.93	822,208.50
本期基金份额交易产生的变动数	20,989.05	-926,529.66	-905,540.61
其中：基金申购款	26,854.92	251,972.37	278,827.29
基金赎回款	-5,865.87	-1,178,502.03	-1,184,367.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	538,137.10	2,320,051.47	2,858,188.57

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
活期存款利息收入	6,412.15
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	370.68
其他	26.42
合计	6,809.25

本报告期内"其他"为结算保证金利息收入。

6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出股票成交总额	158,702,255.63
减：卖出股票成本总额	157,344,371.31
减：交易费用	214,837.41
买卖股票差价收入	1,143,046.91

6.4.7.10 基金投资收益

本期本基金无基金投资收益。

6.4.7.11 债券投资收益

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本期本基金无买卖权证价差收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本期本基金无衍生工具——其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	196,053.92
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	196,053.92

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	639,939.07
——股票投资	639,939.07
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	639,939.07

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
基金赎回费收入	2,792.34
合计	2,792.34

6.4.7.18 信用减值损失

本期本基金无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	6,107.51
信息披露费	-
证券出借违约金	-
帐户维护费	9,000.00
其他费用	300.00
合计	15,407.51

本基金管理人主动承担了本基金自2025年1月1日起的信息披露费、审计费、银行间账户维护费等固定费用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截止本报告期期末，本基金无重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告日止，本公司无应披露未披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国盛证券有限责任公司	本基金管理人股东
江信基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司	基金托管人、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

下述关联方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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06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
国盛证券 有限责任 公司	90,830,032.50	29.01%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及去年同期，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及去年同期，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及去年同期，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本报告期内及去年同期，本基金未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06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
国盛证券有限责任公司	42,319.69	36.68%	42,319.69	36.68%

(1) 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 该类佣金协议的服务范围符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》相关规定。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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 2025年01月01日至2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	62,029.80	83,825.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	26,063.55	35,533.45
应支付基金管理人的净管理	35,966.25	48,291.92

费		
---	--	--

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提，基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,292.09	17,962.56

注：基金的托管费按前一日的基金资产净值的0.15%的年费率计提，基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	江信同福A	江信同福C	合计
国盛证券有限责任公司	0.00	1,163.48	1,163.48
中国光大银行股份有限公司	0.00	1,644.44	1,644.44
江信基金	0.00	854.52	854.52

管理有限 公司			
合计	0.00	3,662.44	3,662.44
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	江信同福A	江信同福C	合计
国盛证券 有限责任 公司	0.00	1,093.13	1,093.13
中国光大 银行股份 有限公司	0.00	2,325.61	2,325.61
江信基金 管理有限 公司	0.00	776.04	776.04
合计	0.00	4,194.78	4,194.78

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年率为0.50%，销售服务费按前一日C类基金份额的资产净值0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日资产净值

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

本报告期内及去年同期，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期内及去年同期，本基金未参与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

本报告期内及去年同期，本基金未参与转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内，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

本报告期内，除本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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国光大银行股份有限公司	1,484,485.51	6,412.15	2,183,045.10	12,726.86

本基金的银行存款由基金托管人中国光大银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末无因认购新股/新债而于期末持有的流通受限证券。

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	股	停	停牌	期	复	复	数量	期末成本	期末估值	备
---	---	---	----	---	---	---	----	------	------	---

票代码	票名称	牌日期	原因	末估值单价	牌日期	牌开盘单价	(股)	总额	总额	注
300280	*ST紫天	2025-03-17	因公司未能在法定期限内披露年度报告,公司股票自2025年5月6日起继续停牌。	8.74	2025-07-07	6.99	1,000	8,760.00	8,740.00	-

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

截至本报告期末,本基金未持有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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,本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

1、风险管理政策

本基金是一只混合型证券投资基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务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标是在有效控制风险的基础上，通过主动管理，力争创造高于业绩比较基准的投资收益。

2、风险治理组织架构

本基金的基金管理人风险管理组织体系由三级构成:第一级次为董事会层面的合规与风险管理委员会、督察长；第二级次为经营层面的总经理、风险控制委员会、风控稽核总部；第三级次为公司各业务部门对各自部门的风险控制负责。

本基金的基金管理人主要采取定量和定性相结合的方法。

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。

本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国光大银行，与该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信用风险。通过内部信用评级制度，结合外部信用评级，进行信用风险管理；根据交易对手的资质、交易记录、信用记录和交收违约记录等因素对交易对手进行信用评级。

截至本期报告期末，本基金未持有债券。

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

按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。本报告期末，本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

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，本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

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，本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。本报告期末，本基金未持有按长期信用评级列示的债券投资。

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，本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

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，本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一是在某种情况下因市场交易量不足，某些投资品种的流动性不佳，可能导致证券不能迅速、低成本地转变为现金，进而影响到基金投资收益的实现；二是在本基金的开放期内投资人的连续大量赎回将会导致基金的现金支付出现困难，或迫使基金以不适当的价格大量抛售证券，使基金的净值增长率受到不利影响。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在开放期内为保持较高的组合流动性，方便投资人安排投资，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，减小基金净值的波动。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%，本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%。因此除附注12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

截至本报告期末，本基金所承担的金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

金融工具的市场风险，是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。

本基金部分投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年0 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	1,484,485.51	-	-	-	1,484,485.51
结算备付金	216,939.28	-	-	-	216,939.28
存出保证金	11,437.51	-	-	-	11,437.51
交易性金融资产	-	-	-	15,665,960.80	15,665,960.80
应收清算款	-	-	-	387,401.98	387,401.98
应收申购款	-	-	-	38,759.30	38,759.30
资产总计	1,712,862.30	-	-	16,092,122.08	17,804,984.38

计					
负债					
应付赎回款	-	-	-	55,272.55	55,272.55
应付管理人报酬	-	-	-	10,031.07	10,031.07
应付托管费	-	-	-	2,149.51	2,149.51
应付销售服务费	-	-	-	3,177.13	3,177.13
其他负债	-	-	-	121,473.63	121,473.63
负债总计	-	-	-	192,103.89	192,103.89
利率敏感度缺口	1,712,862.30	-	-	15,900,018.19	17,612,880.49
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,439,514.36	-	-	-	2,439,514.36
结算备付金	291,265.70	-	-	-	291,265.70
存出保证金	24,643.18	-	-	-	24,643.18
交易性金融资产	-	-	-	17,926,673.10	17,926,673.10
应收清算款	-	-	-	5,893.86	5,893.86
应收申	-	-	-	6,610.66	6,610.66

购款					
资产总计	2,755,423.24	-	-	17,939,177.62	20,694,600.86
负债					
应付清算款	-	-	-	293,491.24	293,491.24
应付赎回款	-	-	-	13,707.99	13,707.99
应付管理人报酬	-	-	-	12,307.29	12,307.29
应付托管费	-	-	-	2,637.25	2,637.25
应付销售服务费	-	-	-	4,327.49	4,327.49
其他负债	-	-	-	291,384.68	291,384.68
负债总计	-	-	-	617,855.94	617,855.94
利率敏感度缺口	2,755,423.24	-	-	17,321,321.68	20,076,744.92

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

本报告期末，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具主要以人民币计价，因此本基金所承担的外汇变动市场风险不重大。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金股票投资占基金资产的0%-95%；权证投资占基金资产净值的0%-3%；在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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 2025年06月30日		上年度末 2024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	15,665,960.80	88.95	17,926,673.10	89.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,665,960.80	88.95	17,926,673.10	89.29

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降5%
----	------------------------------

2.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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	权益性投资的市场价格上升5%	783,298.04	896,333.66
	权益性投资的市场价格下降5%	-783,298.04	-896,333.66

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	15,665,960.80	17,926,673.10
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	15,665,960.80	17,926,673.10

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。本报告期内，本基金不存在公允价值所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本报告期内，本基金不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本报告期内，本基金不存在持有不以公允价值计量的金融工具的情况。

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	15,665,960.80	87.99
	其中：股票	15,665,960.80	87.99
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	1,701,424.79	9.56
8	其他各项资产	437,598.79	2.46
9	合计	17,804,984.38	100.00

由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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

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	98,957.00	0.56
B	采矿业	523,738.00	2.97
C	制造业	8,117,899.80	46.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	978,200.00	5.55
E	建筑业	561,185.00	3.19
F	批发和零售业	583,799.00	3.31
G	交通运输、仓储和邮政业	772,761.00	4.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	341,898.00	1.94
J	金融业	1,813,763.00	10.30
K	房地产业	449,777.00	2.55
L	租赁和商务服务业	249,257.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	203,374.00	1.15
N	水利、环境和公共设施管理业	389,491.00	2.21
O	居民服务、修理和其他服务业	9,531.00	0.05
P	教育	19,665.00	0.11
Q	卫生和社会工作	40,590.00	0.23
R	文化、体育和娱乐业	502,247.00	2.85
S	综合	9,828.00	0.06
	合计	15,665,960.80	88.95

由于四舍五入的原因金额占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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(元)	占基金资产净值比
----	------	------	-------	---------	----------

					例(%)
1	600282	南钢股份	13,600	57,120.00	0.32
2	002601	龙佰集团	3,500	56,735.00	0.32
3	600373	中文传媒	5,500	56,485.00	0.32
4	002932	明德生物	2,900	56,434.00	0.32
5	600901	江苏金租	9,300	56,358.00	0.32
6	603565	中谷物流	5,900	56,345.00	0.32
7	000932	华菱钢铁	12,800	56,320.00	0.32
8	600782	新钢股份	15,900	56,286.00	0.32
9	601838	成都银行	2,800	56,280.00	0.32
10	601398	工商银行	7,400	56,166.00	0.32
11	601998	中信银行	6,600	56,100.00	0.32
12	605368	蓝天燃气	5,700	56,088.00	0.32
13	600123	兰花科创	8,600	56,072.00	0.32
14	600325	华发股份	11,500	56,005.00	0.32
15	000429	粤高速 A	4,200	55,986.00	0.32
16	600461	洪城环境	5,800	55,912.00	0.32
17	601019	山东出版	5,900	55,873.00	0.32
18	601288	农业银行	9,500	55,860.00	0.32
19	601928	凤凰传媒	5,000	55,850.00	0.32
20	002088	鲁阳节能	5,200	55,848.00	0.32
21	603878	武进不锈	10,300	55,826.00	0.32
22	601658	邮储银行	10,200	55,794.00	0.32
23	601009	南京银行	4,800	55,776.00	0.32
24	601101	昊华能源	7,700	55,748.00	0.32
25	600295	鄂尔多斯	6,400	55,744.00	0.32
26	601939	建设银行	5,900	55,696.00	0.32
27	600757	长江传媒	6,000	55,680.00	0.32
27	600398	海澜之家	8,000	55,680.00	0.32
29	601187	厦门银行	8,200	55,678.00	0.32
30	000157	中联重科	7,700	55,671.00	0.32

31	600755	厦门国贸	9,200	55,660.00	0.32
32	002327	富安娜	7,500	55,650.00	0.32
33	601988	中国银行	9,900	55,638.00	0.32
34	601000	唐山港	13,700	55,622.00	0.32
35	601636	旗滨集团	11,100	55,611.00	0.32
36	000090	天健集团	15,700	55,578.00	0.32
37	601857	中国石油	6,500	55,575.00	0.32
37	600016	民生银行	11,700	55,575.00	0.32
39	600057	厦门象屿	7,900	55,537.00	0.32
40	600064	南京高科	7,200	55,512.00	0.32
41	002233	塔牌集团	7,500	55,500.00	0.32
42	600548	深高速	5,300	55,491.00	0.32
43	600971	恒源煤电	8,400	55,440.00	0.31
43	600039	四川路桥	5,600	55,440.00	0.31
45	601963	重庆银行	5,100	55,386.00	0.31
46	600015	华夏银行	7,000	55,370.00	0.31
47	600997	开滦股份	9,400	55,366.00	0.31
48	601169	北京银行	8,100	55,323.00	0.31
49	601825	沪农商行	5,700	55,290.00	0.31
50	002267	陕天然气	7,300	55,261.00	0.31
51	601328	交通银行	6,900	55,200.00	0.31
51	000937	冀中能源	9,600	55,200.00	0.31
53	601098	中南传媒	4,200	55,104.00	0.31
54	000983	山西焦煤	8,600	55,040.00	0.31
55	600273	嘉化能源	6,500	54,990.00	0.31
56	601077	渝农商行	7,700	54,978.00	0.31
57	600919	江苏银行	4,600	54,924.00	0.31
58	601997	贵阳银行	8,800	54,912.00	0.31
59	600694	大商股份	2,900	53,795.00	0.31
60	300470	中密控股	600	22,062.00	0.13
61	300685	艾德生物	1,000	21,530.00	0.12

62	603868	飞科电器	600	21,522.00	0.12
63	688352	颀中科技	1,900	21,337.00	0.12
64	300171	东富龙	1,600	21,264.00	0.12
65	300406	九强生物	1,500	21,225.00	0.12
66	603233	大参林	1,300	21,190.00	0.12
67	301363	美好医疗	1,200	21,168.00	0.12
68	603698	航天工程	1,200	21,144.00	0.12
69	002967	广电计量	1,200	21,108.00	0.12
70	301267	华夏眼科	1,100	21,087.00	0.12
71	603025	大豪科技	1,500	21,030.00	0.12
72	601882	海天精工	1,100	21,010.00	0.12
73	603638	艾迪精密	1,200	20,988.00	0.12
74	002075	沙钢股份	3,600	20,952.00	0.12
75	301069	凯盛新材	1,300	20,943.00	0.12
76	002320	海峡股份	3,200	20,928.00	0.12
77	300151	昌红科技	1,700	20,927.00	0.12
78	300303	聚飞光电	3,300	20,922.00	0.12
79	688387	信科移动	3,700	20,905.00	0.12
80	605116	奥锐特	1,000	20,900.00	0.12
81	688549	中巨芯	2,700	20,898.00	0.12
82	600197	伊力特	1,400	20,888.00	0.12
83	603103	横店影视	1,300	20,865.00	0.12
83	002832	比音勒芬	1,300	20,865.00	0.12
85	603997	继峰股份	1,600	20,864.00	0.12
86	688556	高测股份	2,900	20,822.00	0.12
87	300134	大富科技	1,700	20,791.00	0.12
88	600586	金晶科技	4,300	20,769.00	0.12
89	601279	英利汽车	5,200	20,748.00	0.12
90	000902	新洋丰	1,500	20,745.00	0.12
91	603733	仙鹤股份	1,000	20,740.00	0.12
92	603806	福斯特	1,600	20,736.00	0.12

92	300393	中来股份	3,600	20,736.00	0.12
94	002643	万润股份	1,800	20,718.00	0.12
95	688389	普门科技	1,600	20,672.00	0.12
96	001311	多利科技	1,000	20,670.00	0.12
97	002203	海亮股份	2,000	20,640.00	0.12
98	300129	泰胜风能	2,900	20,619.00	0.12
99	000636	风华高科	1,500	20,610.00	0.12
100	600640	国脉文化	1,700	20,604.00	0.12
101	603328	依顿电子	2,100	20,601.00	0.12
102	600499	科达制造	2,100	20,580.00	0.12
102	300768	迪普科技	1,200	20,580.00	0.12
104	003022	联泓新科	1,300	20,579.00	0.12
105	605577	龙版传媒	1,600	20,576.00	0.12
106	002739	万达电影	1,800	20,574.00	0.12
107	002581	未名医药	2,300	20,562.00	0.12
108	601033	永兴股份	1,300	20,553.00	0.12
109	600995	南网储能	2,100	20,538.00	0.12
110	600195	中牧股份	2,800	20,524.00	0.12
110	002434	万里扬	2,800	20,524.00	0.12
112	601222	林洋能源	3,600	20,520.00	0.12
112	600176	中国巨石	1,800	20,520.00	0.12
114	002960	青鸟消防	2,100	20,517.00	0.12
115	600867	通化东宝	2,500	20,500.00	0.12
116	601801	皖新传媒	3,000	20,490.00	0.12
117	002745	木林森	2,600	20,488.00	0.12
117	002673	西部证券	2,600	20,488.00	0.12
119	300080	易成新能	4,900	20,482.00	0.12
120	688289	圣湘生物	1,000	20,480.00	0.12
120	000682	东方电子	2,000	20,480.00	0.12
122	600718	东软集团	2,100	20,475.00	0.12
122	300360	炬华科技	1,300	20,475.00	0.12

122	002244	滨江集团	2,100	20,475.00	0.12
122	002079	苏州固锝	2,100	20,475.00	0.12
126	601107	四川成渝	3,400	20,468.00	0.12
127	002507	涪陵榨菜	1,600	20,464.00	0.12
128	301215	中汽股份	3,300	20,460.00	0.12
129	000050	深天马 A	2,400	20,448.00	0.12
130	002545	东方铁塔	2,300	20,447.00	0.12
131	601106	中国一重	7,300	20,440.00	0.12
132	600623	华谊集团	2,700	20,439.00	0.12
133	300821	东岳硅材	2,600	20,436.00	0.12
134	002171	楚江新材	2,100	20,433.00	0.12
135	688575	亚辉龙	1,400	20,426.00	0.12
136	000791	甘肃能源	3,200	20,416.00	0.12
137	000990	诚志股份	2,700	20,412.00	0.12
138	601619	嘉泽新能	5,700	20,406.00	0.12
139	301268	铭利达	1,100	20,405.00	0.12
140	600285	羚锐制药	900	20,403.00	0.12
141	688425	铁建重工	5,000	20,400.00	0.12
141	600556	天下秀	4,000	20,400.00	0.12
141	002243	力合科创	2,500	20,400.00	0.12
144	601811	新华文轩	1,400	20,398.00	0.12
144	600667	太极实业	3,100	20,398.00	0.12
144	600507	方大特钢	4,700	20,398.00	0.12
144	002249	大洋电机	3,100	20,398.00	0.12
148	600925	苏能股份	3,900	20,397.00	0.12
149	600812	华北制药	3,300	20,394.00	0.12
150	301526	国际复材	5,600	20,384.00	0.12
151	002007	华兰生物	1,300	20,371.00	0.12
152	002726	龙大美食	3,500	20,370.00	0.12
153	688105	诺唯赞	900	20,367.00	0.12
154	001308	康冠科技	900	20,358.00	0.12

155	603327	福蓉科技	2,200	20,350.00	0.12
155	600267	海正药业	2,200	20,350.00	0.12
157	000725	京东方 A	5,100	20,349.00	0.12
158	600535	天士力	1,300	20,345.00	0.12
159	600552	凯盛科技	1,800	20,340.00	0.12
159	003039	顺控发展	1,500	20,340.00	0.12
159	000623	吉林敖东	1,200	20,340.00	0.12
162	601015	陕西黑猫	6,200	20,336.00	0.12
163	601900	南方传媒	1,300	20,332.00	0.12
164	301090	华润材料	2,700	20,331.00	0.12
165	300861	美畅股份	1,000	20,330.00	0.12
166	600958	东方证券	2,100	20,328.00	0.12
166	600795	国电电力	4,200	20,328.00	0.12
166	600271	航天信息	2,200	20,328.00	0.12
166	000012	南玻 A	4,400	20,328.00	0.12
170	301039	中集车辆	2,500	20,325.00	0.12
170	000544	中原环保	2,500	20,325.00	0.12
172	002461	珠江啤酒	1,800	20,322.00	0.12
173	600352	浙江龙盛	2,000	20,320.00	0.12
174	688209	英集芯	1,100	20,317.00	0.12
175	603219	富佳股份	1,400	20,314.00	0.12
176	600873	梅花生物	1,900	20,311.00	0.12
176	000828	东莞控股	1,900	20,311.00	0.12
178	002635	安洁科技	1,500	20,310.00	0.12
179	600746	江苏索普	2,600	20,306.00	0.12
179	300185	通裕重工	7,100	20,306.00	0.12
179	000767	晋控电力	7,100	20,306.00	0.12
182	603588	高能环境	3,600	20,304.00	0.12
182	603218	日月股份	1,600	20,304.00	0.12
182	600061	国投资本	2,700	20,304.00	0.12
185	603877	太平鸟	1,400	20,300.00	0.12

185	601969	海南矿业	2,800	20,300.00	0.12
187	601118	海南橡胶	4,300	20,296.00	0.12
187	600959	江苏有线	5,900	20,296.00	0.12
189	002221	东华能源	2,100	20,286.00	0.12
190	002498	汉缆股份	6,000	20,280.00	0.12
191	300232	洲明科技	2,800	20,272.00	0.12
192	600299	安迪苏	2,100	20,265.00	0.12
193	300088	长信科技	3,400	20,264.00	0.12
194	002588	史丹利	2,300	20,263.00	0.12
195	603043	广州酒家	1,300	20,254.00	0.11
196	600596	新安股份	2,500	20,250.00	0.11
196	300070	碧水源	4,500	20,250.00	0.11
198	002399	海普瑞	1,700	20,247.00	0.11
199	688007	光峰科技	1,400	20,244.00	0.11
199	600483	福能股份	2,100	20,244.00	0.11
201	600664	哈药股份	5,500	20,240.00	0.11
201	600252	中恒集团	8,000	20,240.00	0.11
201	000875	吉电股份	4,000	20,240.00	0.11
204	600420	国药现代	1,900	20,235.00	0.11
205	301207	华兰疫苗	1,200	20,232.00	0.11
205	300146	汤臣倍健	1,800	20,232.00	0.11
205	002534	西子洁能	1,800	20,232.00	0.11
208	300463	迈克生物	1,700	20,230.00	0.11
208	002701	奥瑞金	3,400	20,230.00	0.11
208	002063	远光软件	3,400	20,230.00	0.11
211	000629	钒钛股份	7,900	20,224.00	0.11
212	600618	氯碱化工	2,100	20,223.00	0.11
213	600021	上海电力	2,300	20,217.00	0.11
214	603885	吉祥航空	1,500	20,205.00	0.11
214	600578	京能电力	4,500	20,205.00	0.11
216	600583	海油工程	3,700	20,202.00	0.11

216	002698	博实股份	1,300	20,202.00	0.11
216	000425	徐工机械	2,600	20,202.00	0.11
219	601990	南京证券	2,500	20,200.00	0.11
219	002385	大北农	5,000	20,200.00	0.11
221	002324	普利特	1,900	20,197.00	0.11
222	601668	中国建筑	3,500	20,195.00	0.11
223	000685	中山公用	2,300	20,194.00	0.11
223	000591	太阳能	4,600	20,194.00	0.11
225	600248	陕建股份	5,300	20,193.00	0.11
226	000598	兴蓉环境	2,800	20,188.00	0.11
227	600597	光明乳业	2,400	20,184.00	0.11
227	600155	华创云信	2,900	20,184.00	0.11
227	002390	信邦制药	5,800	20,184.00	0.11
230	000528	柳工	2,100	20,181.00	0.11
231	603355	莱克电气	900	20,178.00	0.11
231	603033	三维股份	1,800	20,178.00	0.11
233	002332	仙琚制药	2,200	20,174.00	0.11
234	601369	陕鼓动力	2,300	20,171.00	0.11
234	600109	国金证券	2,300	20,171.00	0.11
236	600637	东方明珠	2,700	20,169.00	0.11
237	600728	佳都科技	3,700	20,165.00	0.11
238	600649	城投控股	4,700	20,163.00	0.11
238	301175	中科环保	3,900	20,163.00	0.11
238	000035	中国天楹	4,700	20,163.00	0.11
241	600780	通宝能源	3,400	20,162.00	0.11
241	000657	中钨高新	1,700	20,162.00	0.11
243	601827	三峰环境	2,400	20,160.00	0.11
243	600682	南京新百	3,000	20,160.00	0.11
243	600217	中再资环	4,500	20,160.00	0.11
243	002511	中顺洁柔	3,000	20,160.00	0.11
243	000761	本钢板材	5,600	20,160.00	0.11

248	601229	上海银行	1,900	20,159.00	0.11
249	600063	皖维高新	4,400	20,152.00	0.11
249	000060	中金岭南	4,400	20,152.00	0.11
251	601921	浙版传媒	2,500	20,150.00	0.11
252	600572	康恩贝	4,600	20,148.00	0.11
252	002429	兆驰股份	4,600	20,148.00	0.11
252	002034	旺能环境	1,200	20,148.00	0.11
255	601233	桐昆股份	1,900	20,140.00	0.11
256	600863	内蒙华电	4,900	20,139.00	0.11
257	600820	隧道股份	3,300	20,130.00	0.11
257	002489	浙江永强	5,500	20,130.00	0.11
257	000785	居然智家	6,600	20,130.00	0.11
260	688779	五矿新能	3,700	20,128.00	0.11
260	600801	华新水泥	1,700	20,128.00	0.11
260	000567	海德股份	3,400	20,128.00	0.11
263	603077	和邦生物	11,500	20,125.00	0.11
264	688538	和辉光电	8,600	20,124.00	0.11
264	000597	东北制药	3,900	20,124.00	0.11
266	600639	浦东金桥	1,900	20,121.00	0.11
267	000758	中色股份	4,000	20,120.00	0.11
268	000683	博源化工	4,200	20,118.00	0.11
269	603227	雪峰科技	2,400	20,112.00	0.11
269	002939	长城证券	2,400	20,112.00	0.11
271	601068	中铝国际	4,400	20,108.00	0.11
271	600827	百联股份	2,200	20,108.00	0.11
271	000589	贵州轮胎	4,400	20,108.00	0.11
274	000825	太钢不锈	5,600	20,104.00	0.11
275	600320	振华重工	4,600	20,102.00	0.11
276	300027	华谊兄弟	7,500	20,100.00	0.11
276	002120	韵达股份	3,000	20,100.00	0.11
278	600305	恒顺醋业	2,600	20,098.00	0.11

278	600058	五矿发展	2,600	20,098.00	0.11
280	000783	长江证券	2,900	20,097.00	0.11
281	000928	中钢国际	3,200	20,096.00	0.11
282	300009	安科生物	2,400	20,088.00	0.11
282	000930	中粮科技	3,600	20,088.00	0.11
282	000709	河钢股份	9,300	20,088.00	0.11
285	603055	台华新材	2,200	20,086.00	0.11
285	600169	太原重工	8,300	20,086.00	0.11
287	002516	旷达科技	3,900	20,085.00	0.11
288	000166	申万宏源	4,000	20,080.00	0.11
289	600330	天通股份	2,800	20,076.00	0.11
289	600170	上海建工	8,400	20,076.00	0.11
289	600020	中原高速	4,200	20,076.00	0.11
292	301376	致欧科技	1,100	20,075.00	0.11
293	600956	新天绿能	2,600	20,072.00	0.11
294	601868	中国能建	9,000	20,070.00	0.11
295	600903	贵州燃气	2,900	20,068.00	0.11
296	600717	天津港	4,400	20,064.00	0.11
296	000537	中绿电	2,400	20,064.00	0.11
298	000959	首钢股份	5,900	20,060.00	0.11
299	603229	奥翔药业	2,300	20,056.00	0.11
300	600025	华能水电	2,100	20,055.00	0.11
301	600166	福田汽车	7,400	20,054.00	0.11
301	000650	仁和药业	3,700	20,054.00	0.11
303	600776	东方通信	1,800	20,052.00	0.11
303	002941	新疆交建	1,800	20,052.00	0.11
305	600606	绿地控股	12,300	20,049.00	0.11
306	688009	中国通号	3,900	20,046.00	0.11
306	600998	九州通	3,900	20,046.00	0.11
306	000927	中国铁物	7,800	20,046.00	0.11
309	688548	广钢气体	2,000	20,040.00	0.11

310	600866	星湖科技	2,900	20,039.00	0.11
310	000600	建投能源	2,900	20,039.00	0.11
312	688469	芯联集成	4,200	20,034.00	0.11
312	600740	山西焦化	5,400	20,034.00	0.11
312	002275	桂林三金	1,400	20,034.00	0.11
315	601319	中国人保	2,300	20,033.00	0.11
316	601872	招商轮船	3,200	20,032.00	0.11
316	600313	农发种业	3,200	20,032.00	0.11
318	601918	新集能源	3,100	20,026.00	0.11
318	601228	广州港	6,200	20,026.00	0.11
318	600707	彩虹股份	3,100	20,026.00	0.11
318	600704	物产中大	3,800	20,026.00	0.11
318	000030	富奥股份	3,400	20,026.00	0.11
323	600004	白云机场	2,200	20,020.00	0.11
323	003012	东鹏控股	3,500	20,020.00	0.11
323	002266	浙富控股	6,500	20,020.00	0.11
323	000690	宝新能源	4,400	20,020.00	0.11
327	002004	华邦健康	4,800	20,016.00	0.11
328	002239	奥特佳	6,900	20,010.00	0.11
328	001286	陕西能源	2,300	20,010.00	0.11
328	000089	深圳机场	2,900	20,010.00	0.11
331	601866	中远海发	8,100	20,007.00	0.11
331	000552	甘肃能化	8,100	20,007.00	0.11
333	002299	圣农发展	1,400	20,006.00	0.11
334	601916	浙商银行	5,900	20,001.00	0.11
335	600783	鲁信创投	1,600	20,000.00	0.11
335	600428	中远海特	3,200	20,000.00	0.11
335	600098	广州发展	3,200	20,000.00	0.11
338	603876	鼎胜新材	2,200	19,998.00	0.11
338	300039	上海凯宝	3,300	19,998.00	0.11
340	600335	国机汽车	3,100	19,995.00	0.11

341	600968	海油发展	4,900	19,992.00	0.11
341	600928	西安银行	5,100	19,992.00	0.11
341	002567	唐人神	4,200	19,992.00	0.11
341	002531	天顺风能	2,800	19,992.00	0.11
341	000708	中信特钢	1,700	19,992.00	0.11
341	000498	山东路桥	3,400	19,992.00	0.11
341	000301	东方盛虹	2,400	19,992.00	0.11
348	002314	南山控股	7,600	19,988.00	0.11
349	600018	上港集团	3,500	19,985.00	0.11
350	603866	桃李面包	3,700	19,980.00	0.11
350	600655	豫园股份	3,600	19,980.00	0.11
350	000885	城发环境	1,500	19,980.00	0.11
350	000019	深粮控股	3,000	19,980.00	0.11
354	600266	城建发展	4,400	19,976.00	0.11
355	603567	珍宝岛	1,700	19,975.00	0.11
356	600163	中闽能源	3,900	19,968.00	0.11
357	600975	新五丰	3,300	19,965.00	0.11
358	000813	德展健康	6,200	19,964.00	0.11
358	000718	苏宁环球	9,200	19,964.00	0.11
360	000950	重药控股	4,000	19,960.00	0.11
361	600848	上海临港	2,200	19,954.00	0.11
362	601158	重庆水务	4,300	19,952.00	0.11
362	600516	方大炭素	4,300	19,952.00	0.11
362	000898	鞍钢股份	8,600	19,952.00	0.11
365	600688	上海石化	7,000	19,950.00	0.11
365	002807	江阴银行	4,200	19,950.00	0.11
365	002242	九阳股份	2,100	19,950.00	0.11
368	002928	华夏航空	2,400	19,944.00	0.11
368	000058	深赛格	2,400	19,944.00	0.11
370	601117	中国化学	2,600	19,942.00	0.11
371	601333	广深铁路	6,900	19,941.00	0.11

371	601016	节能风电	6,900	19,941.00	0.11
373	600963	岳阳林纸	4,500	19,935.00	0.11
374	600918	中泰证券	3,100	19,933.00	0.11
375	600008	首创环保	6,600	19,932.00	0.11
375	000088	盐田港	4,400	19,932.00	0.11
377	600662	外服控股	3,900	19,929.00	0.11
378	002154	报喜鸟	5,300	19,928.00	0.11
379	600528	中铁工业	2,700	19,926.00	0.11
379	600409	三友化工	4,100	19,926.00	0.11
379	600073	光明肉业	2,700	19,926.00	0.11
379	002216	三全食品	1,800	19,926.00	0.11
383	002252	上海莱士	2,900	19,923.00	0.11
384	601949	中国出版	3,000	19,920.00	0.11
384	601568	北元集团	4,800	19,920.00	0.11
384	002948	青岛银行	4,000	19,920.00	0.11
384	002145	中核钛白	4,800	19,920.00	0.11
388	600219	南山铝业	5,200	19,916.00	0.11
389	603730	岱美股份	3,500	19,915.00	0.11
390	603919	金徽酒	1,100	19,910.00	0.11
390	000517	荣安地产	11,000	19,910.00	0.11
392	601208	东材科技	2,100	19,908.00	0.11
393	601128	常熟银行	2,700	19,899.00	0.11
394	002081	金螳螂	5,800	19,894.00	0.11
394	001213	中铁特货	4,900	19,894.00	0.11
394	000987	越秀资本	2,900	19,894.00	0.11
397	600575	淮河能源	5,700	19,893.00	0.11
398	600966	博汇纸业	4,500	19,890.00	0.11
398	600635	大众公用	5,100	19,890.00	0.11
398	600517	国网英大	3,900	19,890.00	0.11
398	600508	上海能源	1,700	19,890.00	0.11
398	000557	西部创业	3,900	19,890.00	0.11

403	603299	苏盐井神	2,100	19,887.00	0.11
404	600075	新疆天业	4,700	19,881.00	0.11
405	601577	长沙银行	2,000	19,880.00	0.11
406	600477	杭萧钢构	7,500	19,875.00	0.11
407	688432	有研硅	1,800	19,872.00	0.11
407	601678	滨化股份	4,800	19,872.00	0.11
407	601096	宏盛华源	4,800	19,872.00	0.11
407	600675	中华企业	6,900	19,872.00	0.11
407	002493	荣盛石化	2,400	19,872.00	0.11
412	600037	歌华有线	2,600	19,864.00	0.11
413	002500	山西证券	3,400	19,856.00	0.11
413	002096	易普力	1,600	19,856.00	0.11
413	000719	中原传媒	1,600	19,856.00	0.11
416	002958	青农商行	5,500	19,855.00	0.11
417	002038	双鹭药业	2,800	19,852.00	0.11
418	300595	欧普康视	1,300	19,851.00	0.11
419	601200	上海环境	2,500	19,850.00	0.11
419	000156	华数传媒	2,500	19,850.00	0.11
421	000899	赣能股份	2,300	19,849.00	0.11
422	600737	中粮糖业	2,100	19,845.00	0.11
422	001203	大中矿业	2,100	19,845.00	0.11
424	000883	湖北能源	4,400	19,844.00	0.11
425	600094	大名城	6,400	19,840.00	0.11
425	600017	日照港	6,400	19,840.00	0.11
427	600657	信达地产	5,100	19,839.00	0.11
428	000686	东北证券	2,600	19,838.00	0.11
429	002060	广东建工	5,700	19,836.00	0.11
430	002064	华峰化学	3,000	19,830.00	0.11
431	603609	禾丰股份	2,400	19,824.00	0.11
431	600033	福建高速	5,600	19,824.00	0.11
433	601500	通用股份	4,300	19,823.00	0.11

433	002183	怡亚通	4,300	19,823.00	0.11
435	600909	华安证券	3,400	19,822.00	0.11
436	002053	云南能投	1,800	19,818.00	0.11
437	600125	铁龙物流	3,500	19,810.00	0.11
437	002056	横店东磁	1,400	19,810.00	0.11
439	000061	农产品	3,100	19,809.00	0.11
440	002100	天康生物	3,200	19,808.00	0.11
441	601860	紫金银行	6,600	19,800.00	0.11
441	600739	辽宁成大	1,800	19,800.00	0.11
441	002839	张家港行	4,400	19,800.00	0.11
441	002061	浙江交科	5,000	19,800.00	0.11
445	600475	华光环能	1,900	19,798.00	0.11
446	600987	航民股份	2,800	19,796.00	0.11
447	002697	红旗连锁	3,700	19,795.00	0.11
448	002608	江苏国信	2,700	19,791.00	0.11
449	600906	财达证券	2,900	19,778.00	0.11
449	600888	新疆众和	2,900	19,778.00	0.11
449	000027	深圳能源	3,100	19,778.00	0.11
452	002936	郑州银行	9,600	19,776.00	0.11
453	601901	方正证券	2,500	19,775.00	0.11
453	601061	中信金属	2,500	19,775.00	0.11
455	605507	国邦医药	1,000	19,770.00	0.11
456	600582	天地科技	3,300	19,767.00	0.11
457	001227	兰州银行	7,900	19,750.00	0.11
457	000672	上峰水泥	2,500	19,750.00	0.11
459	600115	中国东航	4,900	19,747.00	0.11
460	300140	节能环境	3,200	19,744.00	0.11
461	601952	苏垦农发	2,000	19,740.00	0.11
461	600502	安徽建工	4,200	19,740.00	0.11
463	603027	千禾味业	1,700	19,737.00	0.11
464	600970	中材国际	2,300	19,734.00	0.11

464	600929	雪天盐业	3,900	19,734.00	0.11
464	000680	山推股份	2,200	19,734.00	0.11
467	000728	国元证券	2,500	19,725.00	0.11
468	601598	中国外运	4,000	19,720.00	0.11
468	002302	西部建设	3,400	19,720.00	0.11
468	002011	盾安环境	1,700	19,720.00	0.11
471	601139	深圳燃气	3,100	19,716.00	0.11
472	601600	中国铝业	2,800	19,712.00	0.11
472	002408	齐翔腾达	4,400	19,712.00	0.11
474	601326	秦港股份	6,100	19,703.00	0.11
475	600874	创业环保	3,300	19,701.00	0.11
476	688351	微电生理	1,000	19,700.00	0.11
477	601528	瑞丰银行	3,400	19,686.00	0.11
478	605222	起帆电缆	1,300	19,682.00	0.11
478	600587	新华医疗	1,300	19,682.00	0.11
480	688106	金宏气体	1,100	19,679.00	0.11
481	603057	紫燕食品	900	19,674.00	0.11
482	601163	三角轮胎	1,400	19,670.00	0.11
483	688584	上海合晶	1,100	19,668.00	0.11
484	002274	华昌化工	2,700	19,656.00	0.11
485	600750	江中药业	900	19,647.00	0.11
486	600056	中国医药	1,900	19,646.00	0.11
487	002003	伟星股份	1,800	19,638.00	0.11
488	603323	苏农银行	3,500	19,635.00	0.11
489	002091	江苏国泰	2,700	19,629.00	0.11
490	002572	索菲亚	1,400	19,614.00	0.11
491	002706	良信股份	2,200	19,602.00	0.11
492	688128	中国电研	800	19,600.00	0.11
492	002043	兔宝宝	2,000	19,600.00	0.11
494	002736	国信证券	1,700	19,584.00	0.11
495	600369	西南证券	4,500	19,575.00	0.11

496	000830	鲁西化工	1,900	19,570.00	0.11
497	600908	无锡银行	3,100	19,561.00	0.11
498	601126	四方股份	1,200	19,524.00	0.11
499	002911	佛燃能源	1,900	19,494.00	0.11
500	600663	陆家嘴	2,200	19,492.00	0.11
501	603858	步长制药	1,200	19,488.00	0.11
502	600131	国网信通	1,100	19,470.00	0.11
503	002430	杭氧股份	1,000	19,420.00	0.11
504	600233	圆通速递	1,500	19,335.00	0.11
505	002532	天山铝业	2,300	19,113.00	0.11
506	688739	成大生物	700	18,480.00	0.10
507	688517	金冠电气	800	11,504.00	0.07
508	688528	秦川物联	1,100	11,396.00	0.06
509	688681	科汇股份	800	11,200.00	0.06
510	688092	爱科科技	500	11,150.00	0.06
511	688565	力源科技	1,200	11,100.00	0.06
512	300549	优德精密	600	10,974.00	0.06
513	300977	深圳瑞捷	600	10,848.00	0.06
514	688067	爱威科技	500	10,755.00	0.06
515	688701	卓锦股份	1,300	10,712.00	0.06
516	300813	泰林生物	500	10,705.00	0.06
517	688021	奥福科技	700	10,703.00	0.06
518	301356	天振股份	600	10,674.00	0.06
519	002830	名雕股份	700	10,668.00	0.06
520	003008	开普检测	500	10,625.00	0.06
521	688466	金科环境	600	10,608.00	0.06
522	688367	工大高科	600	10,590.00	0.06
523	301056	森赫股份	1,000	10,560.00	0.06
524	688355	明志科技	600	10,542.00	0.06
525	688296	和达科技	800	10,504.00	0.06
526	603058	永吉股份	1,200	10,488.00	0.06

527	688679	通源环境	700	10,479.00	0.06
528	688659	元琛科技	1,200	10,476.00	0.06
529	605186	健麾信息	500	10,470.00	0.06
530	688119	中钢洛耐	2,500	10,450.00	0.06
531	300371	汇中股份	900	10,440.00	0.06
532	002942	新农股份	600	10,428.00	0.06
533	605566	福莱茵特	500	10,425.00	0.06
534	300668	杰恩设计	600	10,422.00	0.06
535	300519	新光药业	700	10,388.00	0.06
536	300246	宝莱特	1,300	10,387.00	0.06
537	002836	新宏泽	1,100	10,362.00	0.06
538	605180	华生科技	700	10,360.00	0.06
538	300675	建科院	700	10,360.00	0.06
540	002404	嘉欣丝绸	1,600	10,352.00	0.06
541	002817	黄山胶囊	1,400	10,332.00	0.06
542	688247	宣泰医药	1,000	10,330.00	0.06
543	300599	雄塑科技	1,200	10,320.00	0.06
543	002054	德美化工	1,500	10,320.00	0.06
545	688310	迈得医疗	700	10,318.00	0.06
546	600857	宁波中百	1,000	10,310.00	0.06
547	603856	东宏股份	900	10,305.00	0.06
547	300030	阳普医疗	1,500	10,305.00	0.06
549	688468	科美诊断	1,400	10,304.00	0.06
549	300642	透景生命	700	10,304.00	0.06
551	688509	正元地信	2,400	10,296.00	0.06
551	301037	保立佳	800	10,296.00	0.06
551	300512	中亚股份	1,200	10,296.00	0.06
554	600768	宁波富邦	900	10,287.00	0.06
555	002788	鹭燕医药	1,200	10,284.00	0.06
556	603458	勘设股份	1,300	10,283.00	0.06
556	300912	凯龙高科	700	10,283.00	0.06

558	603839	安正时尚	1,400	10,276.00	0.06
559	301010	晶雪节能	600	10,272.00	0.06
559	300509	新美星	1,200	10,272.00	0.06
561	300610	晨化股份	900	10,260.00	0.06
562	688033	天宜新材	1,600	10,256.00	0.06
563	688257	新锐股份	700	10,255.00	0.06
564	603122	合富中国	1,500	10,245.00	0.06
565	301059	金三江	900	10,242.00	0.06
566	603968	醋化股份	900	10,233.00	0.06
567	605567	春雪食品	1,000	10,230.00	0.06
568	603926	铁流股份	900	10,224.00	0.06
568	603272	联翔股份	600	10,224.00	0.06
570	600082	海泰发展	2,600	10,218.00	0.06
570	300270	中威电子	1,300	10,218.00	0.06
572	300103	达刚控股	1,500	10,215.00	0.06
573	300305	裕兴股份	1,600	10,208.00	0.06
573	300264	佳创视讯	1,600	10,208.00	0.06
573	002905	金逸影视	1,100	10,208.00	0.06
573	002442	龙星科技	1,600	10,208.00	0.06
577	600883	博闻科技	1,300	10,205.00	0.06
578	301265	华新环保	1,000	10,200.00	0.06
578	300187	永清环保	2,000	10,200.00	0.06
580	002012	凯恩股份	1,800	10,188.00	0.06
581	300838	浙江力诺	700	10,178.00	0.06
581	002790	瑞尔特	1,400	10,178.00	0.06
583	300405	科隆股份	1,800	10,170.00	0.06
583	000626	远大控股	1,500	10,170.00	0.06
585	301515	港通医疗	500	10,165.00	0.06
585	300385	雪浪环境	1,900	10,165.00	0.06
587	600051	宁波联合	1,400	10,164.00	0.06
587	300126	锐奇股份	1,400	10,164.00	0.06

589	300412	迦南科技	2,000	10,160.00	0.06
590	688323	瑞华泰	700	10,157.00	0.06
591	603903	中持股份	1,300	10,153.00	0.06
591	603811	诚意药业	1,100	10,153.00	0.06
593	002963	豪尔赛	800	10,152.00	0.06
593	002883	中设股份	900	10,152.00	0.06
595	603717	天域生物	1,400	10,150.00	0.06
595	300970	华绿生物	700	10,150.00	0.06
597	605287	德才股份	700	10,143.00	0.06
597	003018	金富科技	900	10,143.00	0.06
599	603321	梅轮电梯	1,300	10,140.00	0.06
599	002863	今飞凯达	2,000	10,140.00	0.06
599	002566	益盛药业	1,300	10,140.00	0.06
602	603216	梦天家居	800	10,128.00	0.06
603	002381	双箭股份	1,500	10,125.00	0.06
604	688217	睿昂基因	400	10,120.00	0.06
605	300160	秀强股份	1,800	10,116.00	0.06
606	688585	上纬新材	1,300	10,114.00	0.06
607	603073	彩蝶实业	600	10,110.00	0.06
608	300732	设研院	1,400	10,108.00	0.06
609	603020	爱普股份	1,100	10,098.00	0.06
609	600807	济高发展	3,300	10,098.00	0.06
611	002728	特一药业	1,200	10,092.00	0.06
612	000790	华神科技	2,600	10,088.00	0.06
613	300141	和顺电气	1,100	10,087.00	0.06
614	603176	汇通集团	2,100	10,080.00	0.06
614	600692	亚通股份	1,400	10,080.00	0.06
614	600526	菲达环保	2,100	10,080.00	0.06
614	002659	凯文教育	2,000	10,080.00	0.06
618	603500	祥和实业	1,100	10,076.00	0.06
619	301198	喜悦智行	900	10,071.00	0.06

620	605001	威奥股份	1,400	10,066.00	0.06
621	600538	国发股份	1,800	10,062.00	0.06
622	001231	农心科技	500	10,060.00	0.06
623	605138	盛泰集团	1,500	10,050.00	0.06
624	300978	东箭科技	900	10,044.00	0.06
625	688079	美迪凯	1,000	10,040.00	0.06
625	300155	安居宝	2,000	10,040.00	0.06
625	300150	世纪瑞尔	2,000	10,040.00	0.06
625	002209	达意隆	800	10,040.00	0.06
629	603617	君禾股份	1,400	10,038.00	0.06
629	603159	上海亚虹	600	10,038.00	0.06
631	002454	松芝股份	1,300	10,036.00	0.06
632	002702	海欣食品	2,400	10,032.00	0.06
633	688571	杭华股份	1,300	10,023.00	0.06
634	603558	健盛集团	1,100	10,021.00	0.06
635	000782	恒申新材	2,000	10,020.00	0.06
636	002871	伟隆股份	900	10,017.00	0.06
637	603987	康德莱	1,300	10,010.00	0.06
637	603177	德创环保	1,100	10,010.00	0.06
637	600683	京投发展	2,600	10,010.00	0.06
637	600594	益佰制药	2,600	10,010.00	0.06
637	002672	东江环保	2,200	10,010.00	0.06
637	002661	克明食品	1,000	10,010.00	0.06
643	600488	津药药业	2,400	10,008.00	0.06
643	300417	南华仪器	800	10,008.00	0.06
643	000586	汇源通信	900	10,008.00	0.06
646	600235	民丰特纸	1,600	10,000.00	0.06
647	603116	红蜻蜓	1,700	9,996.00	0.06
648	300686	智动力	1,000	9,990.00	0.06
649	301126	达嘉维康	900	9,981.00	0.06
649	300800	力合科技	900	9,981.00	0.06

649	300517	海波重科	900	9,981.00	0.06
652	000757	浩物股份	2,200	9,966.00	0.06
653	603808	歌力思	1,200	9,960.00	0.06
653	603385	惠达卫浴	1,500	9,960.00	0.06
655	300425	中建环能	1,900	9,956.00	0.06
655	002486	嘉麟杰	3,800	9,956.00	0.06
657	300112	万讯自控	1,100	9,955.00	0.06
658	603311	金海高科	900	9,954.00	0.06
658	603012	创力集团	1,800	9,954.00	0.06
658	300535	达威股份	600	9,954.00	0.06
661	300883	龙利得	1,600	9,952.00	0.06
661	002412	汉森制药	1,600	9,952.00	0.06
663	600337	美克家居	4,500	9,945.00	0.06
664	600512	腾达建设	4,400	9,944.00	0.06
665	300259	新天科技	2,800	9,940.00	0.06
665	300234	开尔新材	2,000	9,940.00	0.06
665	002084	海鸥住工	2,800	9,940.00	0.06
668	603326	我乐家居	1,200	9,936.00	0.06
669	600791	京能置业	2,100	9,933.00	0.06
670	002133	广宇集团	3,400	9,928.00	0.06
671	301046	能辉科技	500	9,925.00	0.06
672	300931	通用电梯	1,300	9,919.00	0.06
673	600231	凌钢股份	5,700	9,918.00	0.06
673	000068	华控赛格	2,900	9,918.00	0.06
675	301298	东利机械	600	9,912.00	0.06
676	300235	方直科技	900	9,909.00	0.06
677	000698	沈阳化工	2,600	9,906.00	0.06
678	688718	唯赛勃	800	9,904.00	0.06
678	603126	中材节能	1,600	9,904.00	0.06
680	603488	展鹏科技	1,200	9,900.00	0.06
680	600847	万里股份	900	9,900.00	0.06

680	600159	大龙地产	3,600	9,900.00	0.06
680	300154	瑞凌股份	1,100	9,900.00	0.06
680	002652	扬子新材	3,000	9,900.00	0.06
680	002524	光正眼科	2,200	9,900.00	0.06
686	603817	海峡环保	1,700	9,894.00	0.06
687	603551	奥普科技	900	9,891.00	0.06
688	000952	广济药业	1,600	9,888.00	0.06
689	002228	合兴包装	2,800	9,884.00	0.06
689	000655	金岭矿业	1,400	9,884.00	0.06
691	600854	春兰股份	1,900	9,880.00	0.06
691	300289	利德曼	1,900	9,880.00	0.06
691	000838	财信发展	3,800	9,880.00	0.06
694	002394	联发股份	1,200	9,876.00	0.06
695	000153	丰原药业	1,600	9,872.00	0.06
696	300670	大烨智能	1,500	9,870.00	0.06
696	000955	欣龙控股	2,100	9,870.00	0.06
698	688597	煜邦电力	1,260	9,865.80	0.06
699	301057	汇隆新材	600	9,864.00	0.06
700	603889	新澳股份	1,700	9,860.00	0.06
700	300639	凯普生物	1,700	9,860.00	0.06
702	300329	海伦钢琴	1,300	9,854.00	0.06
702	002775	文科股份	2,600	9,854.00	0.06
704	688455	科捷智能	700	9,849.00	0.06
705	000570	苏常柴A	1,700	9,843.00	0.06
706	688026	洁特生物	600	9,840.00	0.06
707	603797	联泰环保	2,200	9,834.00	0.06
707	600067	冠城新材	3,300	9,834.00	0.06
709	600620	天宸股份	1,800	9,828.00	0.06
709	600533	栖霞建设	3,900	9,828.00	0.06
709	300335	迪森股份	1,800	9,828.00	0.06
709	000789	万年青	1,800	9,828.00	0.06

713	002663	普邦股份	5,300	9,805.00	0.06
714	600257	大湖股份	1,900	9,804.00	0.06
714	002787	华源控股	1,200	9,804.00	0.06
714	002495	佳隆股份	3,800	9,804.00	0.06
717	688485	九州一轨	900	9,801.00	0.06
717	300948	冠中生态	900	9,801.00	0.06
717	002377	国创高新	3,300	9,801.00	0.06
720	002729	好利科技	700	9,800.00	0.06
721	002802	洪汇新材	700	9,793.00	0.06
722	601999	出版传媒	1,400	9,786.00	0.06
723	002694	顾地科技	2,000	9,780.00	0.06
724	300621	维业股份	1,100	9,779.00	0.06
725	688098	申联生物	1,600	9,776.00	0.06
725	600653	申华控股	5,200	9,776.00	0.06
725	000529	广弘控股	1,600	9,776.00	0.06
728	300086	康芝药业	1,800	9,774.00	0.06
729	300190	维尔利	2,800	9,772.00	0.06
729	002999	天禾股份	1,400	9,772.00	0.06
729	000720	新能泰山	2,800	9,772.00	0.06
732	603628	清源股份	800	9,768.00	0.06
732	001366	播恩集团	800	9,768.00	0.06
734	688670	金迪克	700	9,765.00	0.06
734	601996	丰林集团	4,500	9,765.00	0.06
734	600802	福建水泥	2,100	9,765.00	0.06
734	600168	武汉控股	2,100	9,765.00	0.06
738	605162	新中港	1,300	9,763.00	0.06
739	603810	丰山集团	600	9,762.00	0.06
740	688335	复洁环保	800	9,760.00	0.06
740	688057	金达莱	800	9,760.00	0.06
740	300074	华平股份	2,000	9,760.00	0.06
740	002591	恒大高新	1,600	9,760.00	0.06

744	688101	三达膜	700	9,758.00	0.06
744	600076	康欣新材	4,100	9,758.00	0.06
746	000635	英力特	1,100	9,757.00	0.06
747	600099	林海股份	900	9,756.00	0.06
748	603183	建研院	2,300	9,752.00	0.06
749	300247	融捷健康	2,500	9,750.00	0.06
749	003016	欣贺股份	1,300	9,750.00	0.06
751	603778	国晟科技	2,900	9,744.00	0.06
751	300388	节能国祯	1,400	9,744.00	0.06
751	300176	鸿特科技	1,400	9,744.00	0.06
751	002687	乔治白	2,100	9,744.00	0.06
751	001360	南矿集团	700	9,744.00	0.06
756	603909	建发合诚	1,000	9,740.00	0.06
757	688148	芳源股份	1,800	9,738.00	0.06
758	002107	沃华医药	1,700	9,724.00	0.06
759	300500	启迪设计	800	9,720.00	0.06
760	600665	天地源	2,900	9,715.00	0.06
760	002578	闽发铝业	2,900	9,715.00	0.06
762	002696	百洋股份	1,600	9,712.00	0.06
763	002282	博深股份	1,300	9,711.00	0.06
764	600838	上海九百	1,200	9,708.00	0.06
765	300658	延江股份	1,500	9,705.00	0.06
766	300279	和晶科技	1,400	9,702.00	0.06
767	601368	绿城水务	2,000	9,700.00	0.06
768	603378	亚士创能	1,600	9,696.00	0.06
769	300877	金春股份	600	9,684.00	0.05
769	300626	华瑞股份	900	9,684.00	0.05
769	300062	中能电气	1,800	9,684.00	0.05
772	688189	南新制药	1,300	9,672.00	0.05
773	300422	博世科	1,900	9,671.00	0.05
774	002774	快意电梯	1,100	9,669.00	0.05

775	002360	同德化工	1,800	9,666.00	0.05
776	002193	如意集团	1,600	9,664.00	0.05
776	000619	海螺新材	1,600	9,664.00	0.05
778	601366	利群股份	2,100	9,660.00	0.05
778	600356	恒丰纸业	1,200	9,660.00	0.05
778	002763	汇洁股份	1,400	9,660.00	0.05
778	002671	龙泉股份	2,100	9,660.00	0.05
778	002083	孚日股份	2,000	9,660.00	0.05
783	300780	德恩精工	600	9,654.00	0.05
784	300564	筑博设计	700	9,653.00	0.05
785	301081	严牌股份	1,000	9,650.00	0.05
785	301060	兰卫医学	1,000	9,650.00	0.05
787	000798	中水渔业	1,300	9,646.00	0.05
788	603682	锦和商管	1,700	9,639.00	0.05
789	000593	德龙汇能	1,600	9,632.00	0.05
790	300774	倍杰特	1,100	9,625.00	0.05
790	002877	智能自控	1,100	9,625.00	0.05
792	688329	艾隆科技	500	9,620.00	0.05
792	600716	凤凰股份	2,600	9,620.00	0.05
794	301519	舜禹股份	700	9,618.00	0.05
794	300334	津膜科技	1,400	9,618.00	0.05
794	002330	得利斯	2,100	9,618.00	0.05
794	001387	雪祺电气	700	9,618.00	0.05
798	000548	湖南投资	1,800	9,612.00	0.05
799	605500	森林包装	1,300	9,607.00	0.05
799	603168	莎普爱思	1,300	9,607.00	0.05
801	002622	皓宸医疗	3,300	9,603.00	0.05
802	603339	四方科技	800	9,600.00	0.05
803	688030	山石网科	600	9,594.00	0.05
804	600661	昂立教育	900	9,585.00	0.05
805	603700	宁水集团	800	9,584.00	0.05

806	300539	横河精密	700	9,583.00	0.05
806	001210	金房能源	700	9,583.00	0.05
808	605155	西大门	800	9,576.00	0.05
808	301167	建研设计	600	9,576.00	0.05
810	600778	友好集团	1,500	9,570.00	0.05
811	688350	富淼科技	600	9,564.00	0.05
812	603172	万丰股份	600	9,558.00	0.05
813	688370	丛麟科技	500	9,555.00	0.05
814	002679	福建金森	1,000	9,550.00	0.05
815	688420	美腾科技	400	9,536.00	0.05
816	300736	百邦科技	900	9,531.00	0.05
816	002856	美芝股份	900	9,531.00	0.05
818	688038	中科通达	600	9,522.00	0.05
819	603289	泰瑞机器	1,000	9,520.00	0.05
820	300407	凯发电气	900	9,513.00	0.05
821	300625	三雄极光	800	9,512.00	0.05
822	300929	华骐环保	900	9,504.00	0.05
822	002718	友邦吊顶	600	9,504.00	0.05
824	603041	美思德	800	9,488.00	0.05
825	301111	粤万年青	600	9,486.00	0.05
826	688479	友车科技	500	9,450.00	0.05
827	301395	仁信新材	700	9,443.00	0.05
828	600097	开创国际	900	9,396.00	0.05
829	605122	四方新材	800	9,392.00	0.05
830	688607	康众医疗	500	9,375.00	0.05
831	300615	欣天科技	700	9,359.00	0.05
832	002144	宏达高科	800	9,352.00	0.05
833	603182	嘉华股份	700	9,310.00	0.05
834	002890	弘宇股份	700	9,233.00	0.05
835	301429	森泰股份	500	9,190.00	0.05
836	003011	海象新材	500	9,185.00	0.05

837	300966	共同药业	500	9,165.00	0.05
838	001218	丽臣实业	500	9,125.00	0.05
839	301372	科净源	400	9,120.00	0.05
840	300594	朗进科技	500	9,100.00	0.05
841	002888	惠威科技	500	9,070.00	0.05
842	300717	华信新材	500	9,065.00	0.05
843	688285	高铁电气	1,100	9,020.00	0.05
844	300837	浙矿股份	400	9,016.00	0.05
845	001378	德冠新材	400	8,868.00	0.05
846	300280	*ST紫天	1,000	8,740.00	0.05

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	601998	中信银行	689,935.00	3.44
2	601019	山东出版	633,252.00	3.15
3	601857	中国石油	624,752.00	3.11
4	601838	成都银行	609,896.00	3.04
5	600373	中文传媒	575,491.00	2.87
6	601825	沪农商行	571,920.00	2.85
7	002932	明德生物	528,087.51	2.63
8	601000	唐山港	526,670.00	2.62
9	600985	淮北矿业	520,312.00	2.59
10	000983	山西焦煤	516,846.00	2.57
11	002867	周大生	514,353.00	2.56
12	601006	大秦铁路	513,569.00	2.56
13	600741	华域汽车	496,912.00	2.48
14	600782	新钢股份	493,340.00	2.46

15	601928	凤凰传媒	469,009.00	2.34
16	600016	民生银行	463,795.00	2.31
17	600039	四川路桥	461,024.00	2.30
18	000830	鲁西化工	456,603.00	2.27
19	600377	宁沪高速	451,894.00	2.25
20	600256	广汇能源	449,868.00	2.24
21	601166	兴业银行	447,361.00	2.23
22	000157	中联重科	441,872.00	2.20
23	600919	江苏银行	430,114.00	2.14
24	601229	上海银行	429,123.00	2.14
25	600019	宝钢股份	422,693.00	2.11
26	601098	中南传媒	422,018.00	2.10
27	601988	中国银行	415,620.00	2.07
28	600325	华发股份	412,933.00	2.06
29	601009	南京银行	402,795.00	2.01
30	600012	皖通高速	402,126.00	2.00

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	601998	中信银行	643,409.08	3.20
2	601838	成都银行	620,783.00	3.09
3	601019	山东出版	572,981.00	2.85
4	601857	中国石油	571,991.00	2.85
5	601825	沪农商行	526,039.00	2.62
6	601000	唐山港	525,050.00	2.62
7	600373	中文传媒	523,037.00	2.61
8	002867	周大生	521,499.00	2.60
9	601166	兴业银行	516,678.00	2.57

10	601006	大秦铁路	511,676.00	2.55
11	600256	广汇能源	509,491.00	2.54
12	600985	淮北矿业	506,252.00	2.52
13	000830	鲁西化工	500,982.00	2.50
14	600741	华域汽车	489,865.00	2.44
15	002932	明德生物	482,366.00	2.40
16	600019	宝钢股份	481,745.00	2.40
17	600039	四川路桥	477,501.00	2.38
18	601229	上海银行	474,396.00	2.36
19	601168	西部矿业	460,126.00	2.29
20	600377	宁沪高速	456,720.00	2.27
21	000983	山西焦煤	450,361.00	2.24
22	600782	新钢股份	444,395.00	2.21
23	600350	山东高速	438,185.00	2.18
24	600016	民生银行	417,912.00	2.08
25	601928	凤凰传媒	412,710.00	2.06
26	601009	南京银行	410,814.00	2.05
27	600325	华发股份	410,229.00	2.04
28	002563	森马服饰	407,484.00	2.03
29	600012	皖通高速	406,079.00	2.02
30	600000	浦发银行	401,924.00	2.00

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	154,443,719.94
卖出股票收入（成交）总额	158,702,255.63

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，除以下证券外，本基金投资的前十名其他证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金持有的江苏金租（代码：600901.SH）的发行主体江苏金融租赁股份有限公司，2025年01月17日国家金融监督管理总局江苏监管局对其采取罚款50万元（苏金罚决字(2025)2号）。

本基金持有的成都银行（代码：601838.SH）的发行主体成都银行股份有限公司，2024年12月17日中国证券监督管理委员会四川监管局对其采取出具警示函的行政监督管理措施（川证监措施(2024)86号）。

7.12.2 本基金本报告期末不存在投资于超过基金合同规定备选股票库之外的情况。

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	11,437.51
2	应收清算款	387,401.98
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	38,759.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	437,598.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
江信 同福A	1,8 62	3,182.74	0.00	0.00%	5,926,261.94	100.00%
江信 同福C	1,2 63	3,895.84	0.00	0.00%	4,920,440.04	100.00%
合计	3,1 25	3,470.94	0.00	0.00%	10,846,701.98	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	江信同福A	142,667.88	2.41%
	江信同福C	57,013.87	1.16%
	合计	199,681.75	1.84%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	江信同福A	0
	江信同福C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	江信同福A	0
	江信同福C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	江信同福A	江信同福C
基金合同生效日(2015年08月28 日)基金份额总额	127,341,981.30	113,006,174.27
本报告期期初基金份额总额	6,824,415.31	6,976,761.38
本报告期基金总申购份额	476,060.60	554,466.50
减：本报告期基金总赎回份额	1,374,213.97	2,610,787.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	5,926,261.94	4,920,440.04

§10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

在本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2025年4月29日原董事长孙桢礪先生、原总经理原亮先生离任，孙剑先生任董事长并代任总经理职务。

(2) 2025年5月29日原财务负责人、首席信息官（代任）、上海分公司负责人原亮先生离任，陈锦先生任副总经理、财务负责人并代任首席信息官。

(3) 2025年6月26日，上海分公司负责人完成工商变更，由原亮先生变更为陈锦先生。

2、本报告期内，基金托管人重大人事变动如下：

2025年1月，中国光大银行股份有限公司聘任贾光华先生担任资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

在本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

在本报告期内，本基金未改聘会计事务所，为本基金提供审计服务的会计师事务所为中汇会计师事务所（特殊普通合伙）。

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，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备

名称	易单元数量	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	注
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	108,935,385.15	34.79%	21,342.19	18.50%	-
国盛证券	2	90,830,032.50	29.01%	42,319.69	36.68%	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	110,173,659.72	35.18%	50,229.30	43.54%	-
中信建投证券	2	1,919,424.20	0.61%	874.61	0.76%	-
中邮证券	2	1,287,474.00	0.41%	600.33	0.52%	-

1、证券公司选择标准

公司通过开展尽职调查，选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究能力较强、佣金率优惠的证券公司作为公司旗下公募基金的证券经纪商。

2、证券公司选择程序

公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定，并与选定的证券公司签订委托协议，明确双方权利义务、佣金率、服务内容、委托代理期限、违约责任等内容。

3、租用证券公司交易单元的变更情况

本基金本报告期交易单元无变更。

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	江信同福灵活配置混合型证券投资基金2024年第四季度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2025-01-21
2	江信基金2024年第四季度报告提示性公告	证券日报	2025-01-21
3	江信同福灵活配置混合型证券投资基金2024年年度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2025-03-28
4	江信基金2024年年度报告提示性公告	证券日报	2025-03-28
5	江信基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度下半年）	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2025-03-31
6	江信同福灵活配置混合型证券投资基金2025年第一季度报告	公司网站、证监会信息披露平台	2025-04-22
7	江信基金2025年第一季度报告提示性公告	证券日报	2025-04-22
8	江信基金管理有限公司高级管理人员变更公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2025-04-30
9	江信同福灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（2025年第1号）	公司网站、证监会信息披露平台	2025-05-19
10	江信同福灵活配置混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新（2025年第1次）	公司网站、证监会信息披露平台	2025-05-19
11	江信同福灵活配置混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新（2025年第1次）	公司网站、证监会信息披露平台	2025-05-19
12	江信基金管理有限公司高级	公司网站、证监会信息披露	2025-05-30

	管理人员及分支机构负责人变更公告	平台、证券日报	
13	江信基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	公司网站、证监会信息披露平台、证券日报	2025-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况
无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《江信同福灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《江信同福灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《江信同福灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.jxfund.cn>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

江信基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日