

中加量化研选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:中加基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年8月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	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	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	12
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
§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	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	72
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	72
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	72
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	72
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
7.12 投资组合报告附注	72
§8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74

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	74
§9 开放式基金份额变动	74
§10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加量化研选混合型证券投资基金	
基金简称	中加量化研选混合	
基金主代码	014691	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年04月11日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,563,859.98份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中加量化研选混合A	中加量化研选混合C
下属分级基金的交易代码	014691	014692
报告期末下属分级基金的份额总额	18,990,390.67份	10,573,469.31份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化投资模型，在严格控制风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济运行状况、国家财政和货币政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势的分析，预测宏观经济的发展趋势，并据此评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率，主动调整股票、债券类资产在给定时间区间内的动态配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。
业绩比较基准	中证500指数收益率*93%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*2%+同期银行活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，预期风险与收益高于债券型基金与货币市场基金，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		中加基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌	滕菲菲
	联系电话	400-00-95526	4006800000
	电子邮箱	service@bobbns.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		400-00-95526	95558
传真		010-83197627	010-85230024
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		北京市西城区南纬路35号	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		100050	100020
法定代表人		杨琳	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.bobbns.com
基金中期报告备置地点	北京市西城区南纬路35号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35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)
---------------	----------------------------------

	中加量化研选混合 A	中加量化研选混合 C
本期已实现收益	586,074.26	336,793.87
本期利润	1,317,978.31	314,956.48
加权平均基金份额本期利润	0.1212	0.0264
本期加权平均净值利润率	12.01%	2.66%
本期基金份额净值增长率	10.74%	10.57%
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	983,181.79	420,513.55
期末可供分配基金份额利润	0.0518	0.0398
期末基金资产净值	19,973,572.46	10,993,982.86
期末基金份额净值	1.0518	1.0398
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	5.18%	3.98%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

3、对期末可供分配利润，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，不是当期发生额）。

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

中加量化研选混合A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.89%	0.83%	4.07%	0.75%	0.82%	0.08%

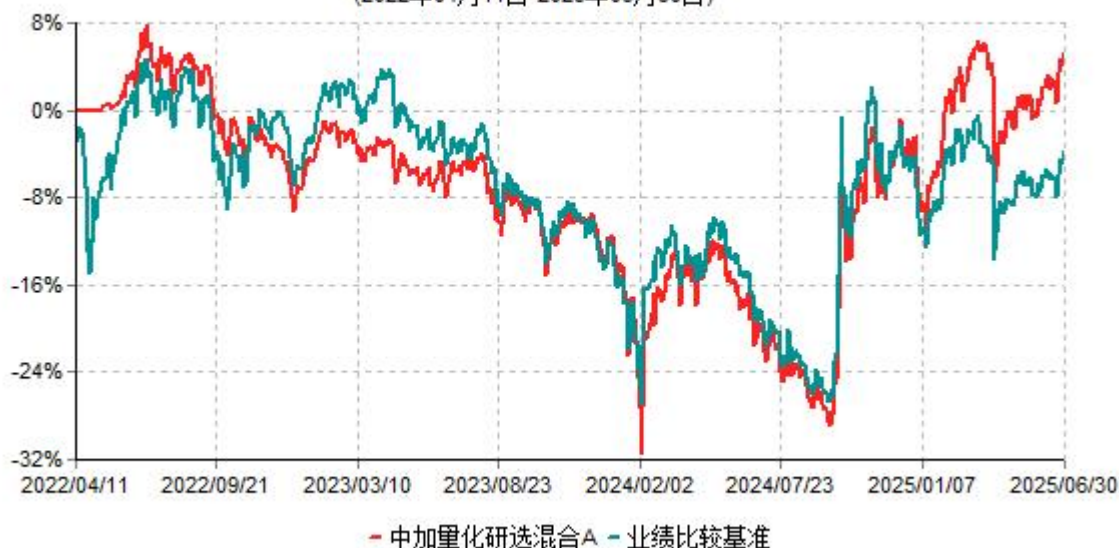
过去三个月	1.42%	1.61%	1.02%	1.43%	0.40%	0.18%
过去六个月	10.74%	1.38%	3.49%	1.29%	7.25%	0.09%
过去一年	31.95%	1.72%	19.10%	1.62%	12.85%	0.10%
过去三年	-0.80%	1.33%	-7.08%	1.28%	6.28%	0.05%
自基金合同生效起至今	5.18%	1.29%	-3.74%	1.31%	8.92%	-0.02%

中加量化研选混合C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.85%	0.84%	4.07%	0.75%	0.78%	0.09%
过去三个月	1.34%	1.61%	1.02%	1.43%	0.32%	0.18%
过去六个月	10.57%	1.38%	3.49%	1.29%	7.08%	0.09%
过去一年	31.55%	1.72%	19.10%	1.62%	12.45%	0.10%
过去三年	-1.69%	1.33%	-7.08%	1.28%	5.39%	0.05%
自基金合同生效起至今	3.98%	1.29%	-3.74%	1.31%	7.72%	-0.02%

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

中加量化研选混合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
(2022年04月11日-2025年06月30日)



中加量化研选混合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
(2022年04月11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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地

种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

截至报告期末，本基金管理人共管理75只基金，涵盖股票型基金、债券型基金、混合型基金、货币市场基金以及基金中基金等多种基金类型，为投资者提供丰富的选择。

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		
钟伟	本基金基金经理	2022-04-11	-	15	钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，曾任中加紫金灵活配置混合型证券投资基金（2022年4月22日至2023年6月30日）的基金经理，现任中加中证500指数增强型证券投资基金（2020年9月27日至今）、中加心享灵活配置混合型

					证券投资基金（2021年8月13日至今）、中加量化研选混合型证券投资基金（2022年4月11日至今）、中加科丰价值精选混合型证券投资基金（2023年2月15日至今）、中加聚享增盈债券型证券投资基金（2023年7月13日至今）的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《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》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

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，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送

金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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，A股市场震荡上行，小盘成长风格表现占优。

今年1月份，A股市场并未迎来开门红，而是震荡下行，春节以后，由于电影票房创春节档历史新高，以及deepseek概念持续发酵，在人工智能、科技和传媒板块的带动下，A股走出一波如火如荼的上涨行情。3月中旬以后，由于国内降准降息尚未落地，加上关税政策的担忧，市场转为震荡下行。

4月初，由于中美之间贸易摩擦升级，特朗普对华关税加征幅度超市场预期，全球股市大跌，市场避险情绪升温，A股市场短期快速下跌。之后，中央汇金借道ETF入市，保险资金也同步入市，稳定投资者信心，A股止跌反弹。5月初，央行、金融监管总局和证监会发布了包括降准降息等“一揽子稳市场稳预期”的政策支持，中美贸易代表团先后在日内瓦和伦敦进行贸易谈判，中美之间贸易摩擦逐步降温，中东地缘冲突也以停火的方式结束。二季度中央汇金通过ETF增持超1900亿元。在利好因素的影响下，A股在触底后逐渐走出震荡上行的走势。

本报告期，沪深300指数上涨0.03%，而中证500和中证1000分别上涨3.31%和6.69%。从市值风格来看，小市值风格占优。

本基金采用量化多因子模型选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股分散，股票仓位基本保持稳定。力争通过获取持续稳定的超额收益来平抑市场波动的影响，增加投资收益的确定性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加量化研选混合A基金份额净值为1.0518元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.74%，同期业绩比较基准收益率为3.49%；截至报告期末中加量化研选混合C基金份额净值为1.0398元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为10.57%，同期业绩比较基准收益率为3.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前A股市场情绪面运行良好，市场成交量持续放大，两融余额也不断创新高，小盘成长风格领涨。目前A股市场处于流动性宽裕叠加政策利好驱动的上涨行情。虽然今年上半年中国实际GDP增长为5.3%，但6月规模以上工业企业利润当月同比还是负增长，中国制造业PMI指数还处于荣枯线的下方，下半年经济增仍面临一定的压力，7月底的中央政治局会议也指出，下半年宏观政策要持续发力，适时加力。要落实更加积极的财政

政策和适度宽松的货币政策。下半年A股市场流动性料会继续保持宽松。目前市场投资情绪较为乐观，未来市场有望延续震荡上行的走势。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组，由分管基金运营的公司领导任估值小组负责人，成员由分管风险合规的公司领导、固定收益部、权益投资部、基金运营部、风险管理部、法律合规与内控部、集中交易部等部门负责人及业务骨干组成，若估值小组认为必要，可适当增减小组成员，业务骨干由估值小组认定和调整。基金经理可依据专业判断就估值政策标准等议题参与讨论并提出意见建议，但不能参与最终估值决策。估值小组主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响，以及对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

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历。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

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人的情形，发生连续六十个工作日基金资产净值低于人民币五千万元的情形，本基金管理人已将相关解决方案上报中国证监会。

本报告期内，本基金迷你期间的信息披露费、审计费等固定费用由基金管理人承担。

§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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中加量化研选混合型证券投资基金

2025年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中加基金管理有限公司在中加量化研选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，中加基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2025年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：中加量化研选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	2,752,674.78	614,259.90
结算备付金		17,441.74	17,312.40
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	29,247,277.67	9,751,562.60
其中：股票投资		29,247,277.67	9,751,562.60
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	1,300,000.00	299,996.47
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		21,847.24	1,700.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		33,339,241.43	10,684,831.37
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		-	-
应付赎回款		2,327,518.44	349.99
应付管理人报酬		32,047.90	11,650.64
应付托管费		5,341.29	1,941.78
应付销售服务费		3,199.41	2,373.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.15	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	3,578.92	17,404.66
负债合计		2,371,686.11	33,720.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	29,563,859.98	11,306,077.68

未分配利润	6.4.7.8	1,403,695.34	-654,967.16
净资产合计		30,967,555.32	10,651,110.52
负债和净资产总计		33,339,241.43	10,684,831.37

注：报告截止日2025年06月30日，A类基金份额净值为1.0518元，A类基金份额总额18,990,390.67份；C类基金份额净值为1.0398元，C类基金份额总额10,573,469.31份，总份额合计29,563,859.98份。

6.2 利润表

会计主体：中加量化研选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		1,807,966.29	-2,661,425.80
1.利息收入		7,351.92	11,818.50
其中：存款利息收入	6.4.7.9	3,285.85	4,121.07
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		4,066.07	7,697.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,024,661.48	-1,795,534.86
其中：股票投资收益	6.4.7.10	633,604.80	-2,115,481.86
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	6,736.83
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

股利收益	6.4.7.14	391,056.68	313,210.17
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	710,066.66	-882,226.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	65,886.23	4,516.92
减：二、营业总支出		175,031.50	282,336.71
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	134,285.67	174,280.99
2.托管费	6.4.10.2.2	22,380.83	29,046.84
3.销售服务费	6.4.10.2.3	17,425.31	35,646.97
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		0.07	0.02
8.其他费用	6.4.7.18	939.62	43,361.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,632,934.79	-2,943,762.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,632,934.79	-2,943,762.51
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,632,934.79	-2,943,762.51

6.3 净资产变动表

会计主体：中加量化研选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	11,306,077.68	-654,967.16	10,651,110.52
二、本期期初净资产	11,306,077.68	-654,967.16	10,651,110.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	18,257,782.30	2,058,662.50	20,316,444.80
（一）、综合收益总额	-	1,632,934.79	1,632,934.79
（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）	18,257,782.30	425,727.71	18,683,510.01
其中：1.基金申购款	42,049,405.79	503,393.35	42,552,799.14
2.基金赎回款	-23,791,623.49	-77,665.64	-23,869,289.13
（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	29,563,859.98	1,403,695.34	30,967,555.32
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	40,512,050.94	-4,942,145.83	35,569,905.11
二、本期期初净资产	40,512,050.94	-4,942,145.83	35,569,905.11

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,062,708.63	-1,411,236.23	-11,473,944.86
（一）、综合收益总额	-	-2,943,762.51	-2,943,762.51
（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）	-10,062,708.63	1,532,526.28	-8,530,182.35
其中：1.基金申购款	14,345,031.29	-2,348,593.17	11,996,438.12
2.基金赎回款	-24,407,739.92	3,881,119.45	-20,526,620.47
（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	30,449,342.31	-6,353,382.06	24,095,960.25

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：

杨琳

李娟

李娟

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

中加量化研选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2021年12月15日证监许可[2021]3962号《关于准予中加量化研选混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加量化研选混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）公开募集。本基金为契约

型开放式混合型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金，托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

本基金通过中加基金直销中心、渤海证券股份有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司及江苏汇林保大基金销售有限公司等其他销售机构公开发售，募集期为2022年1月10日起至2022年3月31日。本基金于2022年4月11日成立，成立之日基金实收份额为267,783,346.03份(含利息转份额64,172.20份)，发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中加量化研选混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购/申购费、销售服务费的收取方式不同，将基金份额分为不同的类别。认购/申购时收取认购/申购费，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；认购/申购时不收取认购/申购费，从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于两类份额的收费方式不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中加量化研选混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票、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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权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。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2025年06月30日的财务状况、2025年度中期的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2025年01月01日至2025年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持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。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金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；
- 该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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无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。

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) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

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

(2)金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(4)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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：

- 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；
- 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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。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，并于会计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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动(包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额)形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；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对应类别的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；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税〔2014〕81号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地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，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（"挂牌公司"）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	959,277.30
等于：本金	959,262.34
加：应计利息	14.96
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	1,793,397.48
等于：本金	1,793,293.90
加：应计利息	103.58
合计	2,752,674.78

注：其他存款为本基金存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		28,672,869.21	-	29,247,277.67	574,408.46
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		28,672,869.21	-	29,247,277.67	574,408.46

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,300,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,300,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	560.92
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付	3,018.00

合计	3,578.92
----	----------

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中加量化研选混合A

金额单位：人民币元

项目 (中加量化研选混合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	2,017,179.15	2,017,179.15
本期申购	21,105,533.48	21,105,533.48
本期赎回（以“-”号填列）	-4,132,321.96	-4,132,321.96
本期末	18,990,390.67	18,990,390.67

6.4.7.7.2 中加量化研选混合C

金额单位：人民币元

项目 (中加量化研选混合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	9,288,898.53	9,288,898.53
本期申购	20,943,872.31	20,943,872.31
本期赎回（以“-”号填列）	-19,659,301.53	-19,659,301.53
本期末	10,573,469.31	10,573,469.31

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中加量化研选混合A

单位：人民币元

项目 (中加量化研选混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	46,962.41	-148,280.84	-101,318.43
本期期初	46,962.41	-148,280.84	-101,318.43
本期利润	586,074.26	731,904.05	1,317,978.31

本期基金份额交易产生的变动数	1,013,262.77	-1,246,740.86	-233,478.09
其中：基金申购款	1,293,823.97	-1,519,337.77	-225,513.80
基金赎回款	-280,561.20	272,596.91	-7,964.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,646,299.44	-663,117.65	983,181.79

6.4.7.8.2 中加量化研选混合C

单位：人民币元

项目 (中加量化研选混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	124,813.51	-678,462.24	-553,648.73
本期期初	124,813.51	-678,462.24	-553,648.73
本期利润	336,793.87	-21,837.39	314,956.48
本期基金份额交易产生的变动数	327,571.78	331,634.02	659,205.80
其中：基金申购款	1,408,498.96	-679,591.81	728,907.15
基金赎回款	-1,080,927.18	1,011,225.83	-69,701.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	789,179.16	-368,665.61	420,513.55

6.4.7.9 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	296.07
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,638.57
结算备付金利息收入	129.34
其他	221.87
合计	3,285.85

6.4.7.10 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	115,569,728.64
减：卖出股票成本总额	114,766,219.74
减：交易费用	169,904.10
买卖股票差价收入	633,604.80

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金在本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金在本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.14 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	391,056.68
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	391,056.68

6.4.7.15 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	710,066.66
——股票投资	710,066.66
——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	710,066.66

6.4.7.16 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	65,836.44
转换费收入	49.79

合计	65,886.23
----	-----------

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.18 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	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	939.62
合计	939.62

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

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20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	134,285.67	174,280.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	39,279.62	43,596.44
应支付基金管理人的净管理费	95,006.05	130,684.55

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年01月01日至2025 年06月30日	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	22,380.83	29,046.84

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 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		
	中加量化研选混合A	中加量化研选混合C	合计
中加基金 管理有限 公司	0.00	15.82	15.82
中信银行 股份有限 公司	0.00	2,059.79	2,059.79
合计	0.00	2,075.61	2,075.61
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		
	中加量化研选混合A	中加量化研选混合C	合计
中加基金 管理有限 公司	0.00	9,774.43	9,774.43
中信银行 股份有限 公司	0.00	2,627.14	2,627.14
合计	0.00	12,401.57	12,401.57

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金份额销售服务费=前一日C类份额基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金在本报告期内及上年度可比期间未发生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。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间未发生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。

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

中加量化研选混合A

份额单位：份

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
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	15,433,015.94	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	15,433,015.94	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	81.27%	-

报告期内基金管理人未投资本基金C类份额。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中信银行股份有限公司	959,277.30	296.07	957,050.17	1,180.23

注：本基金的活期存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

于2025年06月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

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

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单	复牌日期	复牌开盘单	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	-------	------	-------	-----------	--------	--------	----

				价		价				
000627	天茂集团	2025-05-06	重大事项	2.74	2025-07-08	2.60	8,300	30,149.80	22,742.00	-

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2025年06月30日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年06月30日止，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

于2025年06月30日，本基金未持有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

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、法律合规与内控部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对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估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的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范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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。

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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；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。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需

求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（如有）计息但该利息金额不重大以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。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。

报告期内，本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率进行管理。

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	2,752,674.78	-	-	-	2,752,674.78

金					
结算备付金	17,441.74	-	-	-	17,441.74
交易性金融资产	-	-	-	29,247,277.67	29,247,277.67
买入返售金融资产	1,300,000.00	-	-	-	1,300,000.00
应收申购款	-	-	-	21,847.24	21,847.24
资产总计	4,070,116.52	-	-	29,269,124.91	33,339,241.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,327,518.44	2,327,518.44
应付管理人报酬	-	-	-	32,047.90	32,047.90
应付托管费	-	-	-	5,341.29	5,341.29
应付销售服务费	-	-	-	3,199.41	3,199.41
应交税费	-	-	-	0.15	0.15
其他负债	-	-	-	3,578.92	3,578.92
负债总计	-	-	-	2,371,686.11	2,371,686.11
利率敏感度缺口	4,070,116.52	-	-	26,897,438.80	30,967,555.32
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	614,259.90	-	-	-	614,259.90
结算备付金	17,312.40	-	-	-	17,312.40
交易性金融资产	-	-	-	9,751,562.60	9,751,562.60
买入返售金融资产	299,996.47	-	-	-	299,996.47
应收申购款	-	-	-	1,700.00	1,700.00
资产总计	931,568.77	-	-	9,753,262.60	10,684,831.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	349.99	349.99
应付管理人报酬	-	-	-	11,650.64	11,650.64
应付托管费	-	-	-	1,941.78	1,941.78
应付销售服务费	-	-	-	2,373.78	2,373.78
其他负债	-	-	-	17,404.66	17,404.66
负债总计	-	-	-	33,720.85	33,720.85
利率敏感度缺口	931,568.77	-	-	9,719,541.75	10,651,110.52

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

本基金于本报告期末及上期末均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本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	29,247,277.67	94.44	9,751,562.60	91.55
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	29,247,277.67	94.44	9,751,562.60	91.55

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,342,946.44	447,303.47
	业绩比较基准下降5%	-1,342,946.44	-447,303.47

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	29,224,535.67	9,751,562.60
第二层次	22,742.00	-
第三层次	-	-
合计	29,247,277.67	9,751,562.60

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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度期末：无）。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2025年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	29,247,277.67	87.73
	其中：股票	29,247,277.67	87.73
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	1,300,000.00	3.90
	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	2,770,116.52	8.31
8	其他各项资产	21,847.24	0.07
9	合计	33,339,241.43	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

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	215,888.00	0.70
B	采矿业	48,984.00	0.16
C	制造业	20,149,888.53	65.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	875,741.00	2.83
E	建筑业	541,282.00	1.75
F	批发和零售业	1,223,986.00	3.95
G	交通运输、仓储和邮政业	326,982.00	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,155,187.54	10.19
J	金融业	717,177.20	2.32
K	房地产业	416,841.00	1.35
L	租赁和商务服务业	647,845.00	2.09
M	科学研究和技术服务业	21,903.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	332,154.40	1.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,470.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	568,948.00	1.84
S	综合	-	-
	合计	29,247,277.67	94.44

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	300232	洲明科技	120,100	869,524.00	2.81
2	603876	鼎胜新材	95,300	866,277.00	2.80
3	600728	佳都科技	151,400	825,130.00	2.66
4	002249	大洋电机	122,300	804,734.00	2.60
5	600866	星湖科技	108,000	746,280.00	2.41
6	001339	智微智能	14,300	691,119.00	2.23
7	300088	长信科技	108,900	649,044.00	2.10
8	600335	国机汽车	95,300	614,685.00	1.98
9	002396	星网锐捷	26,300	590,435.00	1.91
10	601900	南方传媒	34,200	534,888.00	1.73
11	300777	中简科技	14,100	511,125.00	1.65
12	603583	捷昌驱动	12,700	463,804.00	1.50
13	002925	盈趣科技	23,800	427,924.00	1.38
14	000682	东方电子	40,400	413,696.00	1.34
15	000156	华数传媒	50,800	403,352.00	1.30
16	601126	四方股份	24,100	392,107.00	1.27
17	603039	泛微网络	6,300	350,910.00	1.13
18	002004	华邦健康	81,000	337,770.00	1.09
19	300685	艾德生物	15,100	325,103.00	1.05
20	603997	继峰股份	24,000	312,960.00	1.01
21	601677	明泰铝业	25,100	311,742.00	1.01
22	301031	中熔电气	3,864	307,767.60	0.99
23	600320	振华重工	69,000	301,530.00	0.97
24	600285	羚锐制药	13,300	301,511.00	0.97
25	601311	骆驼股份	33,000	297,990.00	0.96
26	600267	海正药业	31,200	288,600.00	0.93

27	600063	皖维高新	62,800	287,624.00	0.93
28	603698	航天工程	16,200	285,444.00	0.92
29	001308	康冠科技	12,200	275,964.00	0.89
30	600169	太原重工	109,800	265,716.00	0.86
31	000498	山东路桥	44,300	260,484.00	0.84
32	000935	四川双马	14,200	258,724.00	0.84
33	603588	高能环境	45,700	257,748.00	0.83
34	000600	建投能源	37,300	257,743.00	0.83
35	600073	光明肉业	34,600	255,348.00	0.82
36	301207	华兰疫苗	14,700	247,842.00	0.80
37	600420	国药现代	23,100	246,015.00	0.79
38	002010	传化智联	43,200	241,056.00	0.78
39	600305	恒顺醋业	30,100	232,673.00	0.75
40	688209	英集芯	12,485	230,597.95	0.74
41	688147	微导纳米	7,600	229,368.00	0.74
42	002314	南山控股	84,700	222,761.00	0.72
43	603766	隆鑫通用	17,300	220,748.00	0.71
44	300666	江丰电子	2,900	214,890.00	0.69
45	300102	乾照光电	18,400	212,888.00	0.69
46	600057	厦门象屿	30,200	212,306.00	0.69
47	603323	苏农银行	37,720	211,609.20	0.68
48	603444	吉比特	700	211,365.00	0.68
49	002036	联创电子	19,000	205,390.00	0.66
50	600987	航民股份	28,000	197,960.00	0.64
51	603236	移远通信	2,300	197,340.00	0.64
52	600997	开滦股份	32,300	190,247.00	0.61
53	000686	东北证券	24,500	186,935.00	0.60
54	600058	五矿发展	23,900	184,747.00	0.60
55	600782	新钢股份	52,000	184,080.00	0.59
56	002701	奥瑞金	30,700	182,665.00	0.59
57	002901	大博医疗	5,000	181,200.00	0.59

58	600587	新华医疗	11,700	177,138.00	0.57
59	000019	深粮控股	26,500	176,490.00	0.57
60	002243	力合科创	21,400	174,624.00	0.56
61	688088	虹软科技	3,600	173,700.00	0.56
62	002747	埃斯顿	8,500	172,040.00	0.56
63	603612	索通发展	8,700	159,906.00	0.52
64	002668	TCL智家	16,300	159,251.00	0.51
65	688523	航天环宇	7,400	159,174.00	0.51
66	600662	外服控股	30,100	153,811.00	0.50
67	600780	通宝能源	25,700	152,401.00	0.49
68	002405	四维图新	17,700	151,158.00	0.49
69	300363	博腾股份	8,800	150,304.00	0.49
70	600179	安通控股	53,300	147,108.00	0.48
71	301526	国际复材	40,100	145,964.00	0.47
72	601369	陕鼓动力	16,600	145,582.00	0.47
73	000059	华锦股份	26,600	143,374.00	0.46
74	603678	火炬电子	3,700	140,711.00	0.45
75	301327	华宝新能	2,700	138,672.00	0.45
76	002034	旺能环境	8,100	135,999.00	0.44
77	301339	通行宝	7,880	134,984.40	0.44
78	688208	道通科技	4,410	134,946.00	0.44
79	002705	新宝股份	9,000	132,300.00	0.43
80	002315	焦点科技	2,800	127,932.00	0.41
81	601860	紫金银行	41,800	125,400.00	0.40
82	000657	中钨高新	10,500	124,530.00	0.40
83	600572	康恩贝	26,000	113,880.00	0.37
84	600664	哈药股份	30,200	111,136.00	0.36
85	605296	神农集团	3,600	110,664.00	0.36
86	601778	晶科科技	36,500	108,405.00	0.35
87	600675	中华企业	37,400	107,712.00	0.35
88	300761	立华股份	5,600	105,224.00	0.34

89	002911	佛燃能源	9,900	101,574.00	0.33
90	300257	开山股份	9,900	99,693.00	0.32
91	601208	东材科技	10,500	99,540.00	0.32
92	600502	安徽建工	21,100	99,170.00	0.32
93	300456	赛微电子	5,700	97,983.00	0.32
94	002060	广东建工	27,900	97,092.00	0.31
95	600710	苏美达	10,100	97,061.00	0.31
96	688185	康希诺	1,616	96,362.08	0.31
97	300360	炬华科技	5,900	92,925.00	0.30
98	002807	江阴银行	19,400	92,150.00	0.30
99	601326	秦港股份	28,500	92,055.00	0.30
100	600458	时代新材	6,600	90,552.00	0.29
101	600961	株冶集团	7,400	82,732.00	0.27
102	600718	东软集团	8,100	78,975.00	0.26
103	002151	北斗星通	2,700	77,463.00	0.25
104	600597	光明乳业	8,600	72,326.00	0.23
105	601777	千里科技	8,500	72,165.00	0.23
106	000902	新洋丰	5,200	71,916.00	0.23
107	000685	中山公用	8,100	71,118.00	0.23
108	300253	卫宁健康	6,600	69,960.00	0.23
109	600649	城投控股	13,200	56,628.00	0.18
110	600552	凯盛科技	5,000	56,500.00	0.18
111	603456	九洲药业	3,700	56,277.00	0.18
112	605123	派克新材	700	54,530.00	0.18
113	002061	浙江交科	13,500	53,460.00	0.17
114	002091	江苏国泰	7,200	52,344.00	0.17
115	600055	万东医疗	2,900	50,112.00	0.16
116	002275	桂林三金	3,500	50,085.00	0.16
117	603118	共进股份	4,400	49,588.00	0.16
118	601200	上海环境	6,100	48,434.00	0.16
119	600966	博汇纸业	10,400	45,968.00	0.15

120	002534	西子洁能	4,000	44,960.00	0.15
121	603055	台华新材	4,900	44,737.00	0.14
122	002139	拓邦股份	3,200	44,192.00	0.14
123	002100	天康生物	7,000	43,330.00	0.14
124	688166	博瑞医药	800	42,968.00	0.14
125	300602	飞荣达	1,900	40,299.00	0.13
126	600216	浙江医药	2,700	39,933.00	0.13
127	600850	电科数字	1,600	38,704.00	0.12
128	600595	中孚实业	8,700	38,106.00	0.12
129	002204	大连重工	6,200	37,014.00	0.12
130	300762	上海瀚讯	1,600	36,208.00	0.12
131	600812	华北制药	5,600	34,608.00	0.11
132	600682	南京新百	5,100	34,272.00	0.11
133	300458	全志科技	840	33,339.60	0.11
134	601869	长飞光纤	800	32,576.00	0.11
135	002755	奥赛康	2,000	31,960.00	0.10
136	300009	安科生物	3,700	30,969.00	0.10
137	002408	齐翔腾达	6,900	30,912.00	0.10
138	603508	思维列控	1,100	29,128.00	0.09
139	600750	江中药业	1,300	28,379.00	0.09
140	002881	美格智能	600	27,840.00	0.09
141	600269	赣粤高速	5,500	27,830.00	0.09
142	688116	天奈科技	600	27,462.00	0.09
143	605116	奥锐特	1,300	27,170.00	0.09
144	600557	康缘药业	1,800	26,604.00	0.09
145	300130	新国都	700	24,871.00	0.08
146	002497	雅化集团	2,100	23,940.00	0.08
147	300811	铂科新材	500	23,205.00	0.07
148	000627	天茂集团	8,300	22,742.00	0.07
149	600633	浙数文化	1,600	22,144.00	0.07
150	600064	南京高科	2,800	21,588.00	0.07

151	603103	横店影视	1,300	20,865.00	0.07
152	002389	航天彩虹	800	20,480.00	0.07
153	301376	致欧科技	1,100	20,075.00	0.06
154	600037	歌华有线	2,600	19,864.00	0.06
155	603027	千禾味业	1,700	19,737.00	0.06
156	601187	厦门银行	2,900	19,691.00	0.06
157	688252	天德钰	800	19,504.00	0.06
158	300772	运达股份	1,500	19,320.00	0.06
159	300493	润欣科技	900	19,143.00	0.06
160	300972	万辰集团	100	18,024.00	0.06
161	002948	青岛银行	3,600	17,928.00	0.06
162	000030	富奥股份	3,000	17,670.00	0.06
163	600908	无锡银行	2,800	17,668.00	0.06
164	002400	省广集团	2,300	17,572.00	0.06
165	603306	华懋科技	400	17,400.00	0.06
166	600120	浙江东方	2,800	16,940.00	0.05
167	688400	凌云光	600	16,542.00	0.05
168	002487	大金重工	500	16,450.00	0.05
169	688522	纳睿雷达	320	16,390.40	0.05
170	002906	华阳集团	500	16,255.00	0.05
171	600020	中原高速	3,300	15,774.00	0.05
172	300026	红日药业	4,200	15,498.00	0.05
173	002245	蔚蓝锂芯	1,200	15,396.00	0.05
174	000968	蓝焰控股	2,100	15,225.00	0.05
175	002011	盾安环境	1,300	15,080.00	0.05
176	600559	老白干酒	900	15,075.00	0.05
177	300613	富瀚微	300	14,664.00	0.05
178	603083	剑桥科技	300	14,190.00	0.05
179	600963	岳阳林纸	3,200	14,176.00	0.05
180	688568	中科星图	392	14,115.92	0.05
181	600771	广誉远	700	14,112.00	0.05

182	300113	顺网科技	700	13,832.00	0.04
183	688596	正帆科技	400	13,568.00	0.04
184	600075	新疆天业	3,100	13,113.00	0.04
185	000089	深圳机场	1,900	13,110.00	0.04
186	600201	生物股份	1,600	12,832.00	0.04
187	601952	苏垦农发	1,300	12,831.00	0.04
188	300185	通裕重工	4,400	12,584.00	0.04
189	600667	太极实业	1,900	12,502.00	0.04
190	002698	博实股份	800	12,432.00	0.04
191	300580	贝斯特	500	12,285.00	0.04
192	600602	云赛智联	600	12,102.00	0.04
193	603005	晶方科技	400	11,356.00	0.04
194	000829	天音控股	1,100	11,231.00	0.04
195	601609	金田股份	1,600	11,216.00	0.04
196	600933	爱柯迪	700	11,207.00	0.04
197	600480	凌云股份	910	11,074.70	0.04
198	002048	宁波华翔	600	11,046.00	0.04
199	600452	涪陵电力	1,200	11,040.00	0.04
200	301377	鼎泰高科	300	10,788.00	0.03
201	600133	东湖高新	1,200	10,776.00	0.03
202	603220	中贝通信	500	10,735.00	0.03
203	600409	三友化工	2,200	10,692.00	0.03
204	002468	申通快递	1,000	10,690.00	0.03
205	000875	吉电股份	2,100	10,626.00	0.03
206	002226	江南化工	1,800	10,440.00	0.03
207	300857	协创数据	120	10,327.20	0.03
208	002626	金达威	500	10,230.00	0.03
209	600869	远东股份	2,000	10,160.00	0.03
210	603877	太平鸟	700	10,150.00	0.03
211	000758	中色股份	2,000	10,060.00	0.03
212	002541	鸿路钢构	600	10,044.00	0.03

213	600789	鲁抗医药	1,000	10,010.00	0.03
214	000028	国药一致	400	9,972.00	0.03
215	002428	云南锗业	500	9,950.00	0.03
216	603358	华达科技	300	9,933.00	0.03
217	002837	英维克	330	9,804.30	0.03
218	603699	纽威股份	300	9,351.00	0.03
219	000885	城发环境	700	9,324.00	0.03
220	601890	亚星锚链	900	9,171.00	0.03
221	300443	金雷股份	400	9,040.00	0.03
222	600509	天富能源	1,400	9,030.00	0.03
223	002895	川恒股份	400	9,024.00	0.03
224	688548	广钢气体	900	9,018.00	0.03
225	002073	软控股份	1,000	8,890.00	0.03
226	605168	三人行	300	8,829.00	0.03
227	688575	亚辉龙	600	8,754.00	0.03
228	002557	洽洽食品	400	8,648.00	0.03
229	300416	苏试试验	600	8,598.00	0.03
230	000927	中国铁物	3,300	8,481.00	0.03
231	688141	杰华特	259	8,438.22	0.03
232	603871	嘉友国际	780	8,385.00	0.03
233	000065	北方国际	700	8,260.00	0.03
234	301291	明阳电气	200	8,230.00	0.03
235	688556	高测股份	1,120	8,041.60	0.03
236	000672	上峰水泥	1,000	7,900.00	0.03
237	688351	微电生理	400	7,880.00	0.03
238	002351	漫步者	600	7,872.00	0.03
239	002941	新疆交建	700	7,798.00	0.03
240	000762	西藏矿业	400	7,672.00	0.02
241	603099	长白山	200	7,612.00	0.02
242	300428	立中集团	400	7,288.00	0.02
243	603516	淳中科技	200	7,180.00	0.02

244	300660	江苏雷利	160	7,078.40	0.02
245	688549	中巨芯-U	900	6,966.00	0.02
246	300181	佐力药业	400	6,932.00	0.02
247	000923	河钢资源	500	6,920.00	0.02
248	300579	数字认证	200	6,902.00	0.02
249	603328	依顿电子	700	6,867.00	0.02
250	300101	振芯科技	300	6,789.00	0.02
251	300492	华图山鼎	100	6,788.00	0.02
252	002892	科力尔	480	6,686.40	0.02
253	688432	有研硅	600	6,624.00	0.02
254	000719	中原传媒	500	6,205.00	0.02
255	600531	豫光金铅	800	6,192.00	0.02
256	603100	川仪股份	300	6,189.00	0.02
257	601801	皖新传媒	900	6,147.00	0.02
258	601519	大智慧	600	6,114.00	0.02
259	300827	上能电气	200	6,110.00	0.02
260	000950	重药控股	1,200	5,988.00	0.02
261	600729	重庆百货	200	5,966.00	0.02
262	600717	天津港	1,300	5,928.00	0.02
263	300079	数码视讯	1,000	5,850.00	0.02
264	002171	楚江新材	600	5,838.00	0.02
265	600861	北京人力	300	5,790.00	0.02
266	300638	广和通	200	5,726.00	0.02
267	000581	威孚高科	300	5,682.00	0.02
268	001203	大中矿业	600	5,670.00	0.02
269	002946	新乳业	300	5,631.00	0.02
270	002539	云图控股	600	5,628.00	0.02
271	688380	中微半导	200	5,420.00	0.02
272	002212	天融信	700	5,390.00	0.02
273	603599	广信股份	500	5,335.00	0.02
274	002967	广电计量	300	5,277.00	0.02

275	002075	沙钢股份	900	5,238.00	0.02
276	601038	一拖股份	400	5,228.00	0.02
277	000969	安泰科技	400	5,152.00	0.02
278	603881	数据港	200	5,110.00	0.02
279	300346	南大光电	160	5,062.40	0.02
280	002987	京北方	240	5,004.00	0.02
281	600323	瀚蓝环境	200	4,870.00	0.02
282	300432	富临精工	360	4,705.20	0.02
283	002368	太极股份	200	4,684.00	0.02
284	600556	天下秀	900	4,590.00	0.01
285	002267	陕天然气	600	4,542.00	0.01
286	300244	迪安诊断	300	4,470.00	0.01
287	600740	山西焦化	1,200	4,452.00	0.01
288	002434	万里扬	600	4,398.00	0.01
289	301109	军信股份	280	4,166.40	0.01
290	600604	市北高新	800	4,128.00	0.01
291	603283	赛腾股份	120	4,072.80	0.01
292	002302	西部建设	700	4,060.00	0.01
293	603693	江苏新能	300	4,044.00	0.01
294	600773	西藏城投	400	4,024.00	0.01
295	002745	木林森	500	3,940.00	0.01
296	603305	旭升集团	300	3,915.00	0.01
297	688006	杭可科技	200	3,900.00	0.01
298	603327	福蓉科技	420	3,885.00	0.01
299	000597	东北制药	700	3,612.00	0.01
300	688584	上海合晶	200	3,576.00	0.01
301	000811	冰轮环境	360	3,528.00	0.01
302	002006	精工科技	200	3,286.00	0.01
303	600548	深高速	300	3,141.00	0.01
304	600507	方大特钢	700	3,038.00	0.01
305	600197	伊力特	200	2,984.00	0.01

306	601022	宁波远洋	300	2,961.00	0.01
307	688567	孚能科技	200	2,900.00	0.01
308	600461	洪城环境	300	2,892.00	0.01
309	603299	苏盐井神	300	2,841.00	0.01
310	600586	金晶科技	500	2,415.00	0.01
311	301029	怡合达	100	2,286.00	0.01
312	002038	双鹭药业	300	2,127.00	0.01
313	301363	美好医疗	120	2,116.80	0.01
314	600301	华锡有色	100	1,997.00	0.01
315	605555	德昌股份	120	1,988.40	0.01
316	001311	多利科技	90	1,860.30	0.01
317	300856	科思股份	120	1,818.00	0.01
318	601619	嘉泽新能	500	1,790.00	0.01
319	002960	青鸟消防	180	1,758.60	0.01
320	603008	喜临门	100	1,748.00	0.01
321	603043	广州酒家	100	1,558.00	0.01
322	600163	中闽能源	300	1,536.00	0.00
323	300401	花园生物	100	1,521.00	0.00
324	002649	博彦科技	100	1,453.00	0.00
325	003039	顺控发展	100	1,356.00	0.00
326	301215	中汽股份	200	1,240.00	0.00
327	600395	盘江股份	200	946.00	0.00
328	000690	宝新能源	200	910.00	0.00
329	600158	中体产业	100	843.00	0.00
330	601678	滨化股份	200	828.00	0.00
331	001258	立新能源	100	735.00	0.00
332	603730	岱美股份	120	682.80	0.00
333	002498	汉缆股份	200	676.00	0.00
334	000650	仁和药业	100	542.00	0.00
335	000552	甘肃能化	200	494.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002212	天融信	1,633,387.00	15.34
2	601311	骆驼股份	1,476,032.00	13.86
3	603766	隆鑫通用	1,455,621.00	13.67
4	600458	时代新材	1,419,680.00	13.33
5	300232	洲明科技	1,391,573.00	13.07
6	300772	运达股份	1,302,875.00	12.23
7	601369	陕鼓动力	1,247,659.00	11.71
8	300088	长信科技	1,219,402.00	11.45
9	600216	浙江医药	1,193,043.00	11.20
10	002396	星网锐捷	1,150,932.00	10.81
11	300303	聚飞光电	1,150,929.00	10.81
12	600866	星湖科技	1,133,655.00	10.64
13	603236	移远通信	1,090,877.00	10.24
14	600063	皖维高新	1,052,529.00	9.88
15	001308	康冠科技	1,051,598.00	9.87
16	600728	佳都科技	1,047,279.00	9.83
17	002249	大洋电机	1,038,294.00	9.75
18	601126	四方股份	1,020,867.00	9.58
19	002498	汉缆股份	1,018,412.00	9.56
20	000657	中钨高新	998,741.00	9.38
21	600420	国药现代	993,676.00	9.33
22	603876	鼎胜新材	978,852.00	9.19
23	000156	华数传媒	978,467.00	9.19
24	600718	东软集团	968,546.00	9.09
25	600335	国机汽车	956,810.00	8.98

26	600633	浙数文化	935,221.00	8.78
27	600267	海正药业	920,095.00	8.64
28	603989	艾华集团	907,648.00	8.52
29	002405	四维图新	901,677.00	8.47
30	000682	东方电子	897,958.00	8.43
31	600075	新疆天业	881,618.00	8.28
32	600169	太原重工	870,190.00	8.17
33	300777	中简科技	861,318.00	8.09
34	603328	依顿电子	828,655.00	7.78
35	603218	日月股份	823,751.00	7.73
36	600552	凯盛科技	809,293.00	7.60
37	600572	康恩贝	805,877.00	7.57
38	000543	皖能电力	797,389.00	7.49
39	603301	振德医疗	767,668.00	7.21
40	301339	通行宝	761,396.00	7.15
41	603678	火炬电子	757,174.00	7.11
42	001339	智微智能	722,969.00	6.79
43	301031	中熔电气	715,086.00	6.71
44	300672	国科微	713,026.00	6.69
45	688088	虹软科技	695,623.91	6.53
46	300409	道氏技术	692,344.00	6.50
47	603039	泛微网络	688,750.00	6.47
48	605123	派克新材	686,087.00	6.44
49	603466	风语筑	684,001.00	6.42
50	600850	电科数字	682,804.00	6.41
51	603583	捷昌驱动	664,565.00	6.24
52	600757	长江传媒	662,846.00	6.22
53	600269	赣粤高速	651,269.00	6.11
54	600710	苏美达	649,275.00	6.10
55	000685	中山公用	648,576.00	6.09
56	000600	建投能源	643,175.00	6.04

57	002204	大连重工	638,998.00	6.00
58	600320	振华重工	630,512.00	5.92
59	300685	艾德生物	617,105.00	5.79
60	600587	新华医疗	600,034.00	5.63
61	000528	柳工	592,444.00	5.56
62	600305	恒顺醋业	586,907.00	5.51
63	603997	继峰股份	586,404.00	5.51
64	600073	光明肉业	585,442.00	5.50
65	000811	冰轮环境	575,564.00	5.40
66	603920	世运电路	571,508.00	5.37
67	300623	捷捷微电	566,602.00	5.32
68	002139	拓邦股份	560,938.00	5.27
69	601677	明泰铝业	558,581.00	5.24
70	002061	浙江交科	557,610.00	5.24
71	300253	卫宁健康	552,928.00	5.19
72	601900	南方传媒	550,672.00	5.17
73	000913	钱江摩托	550,570.00	5.17
74	603118	共进股份	535,971.00	5.03
75	000821	京山轻机	535,637.00	5.03
76	002275	桂林三金	534,406.00	5.02
77	600017	日照港	529,911.00	4.98
78	000498	山东路桥	528,627.00	4.96
79	002100	天康生物	525,655.00	4.94
80	600595	中孚实业	524,249.00	4.92
81	002010	传化智联	521,861.00	4.90
82	300315	掌趣科技	515,047.00	4.84
83	600388	龙净环保	507,843.00	4.77
84	600869	远东股份	498,422.00	4.68
85	300579	数字认证	495,729.00	4.65
86	300171	东富龙	494,525.00	4.64
87	600987	航民股份	487,012.00	4.57

88	002004	华邦健康	486,239.00	4.57
89	000090	天健集团	484,239.00	4.55
90	002389	航天彩虹	478,946.00	4.50
91	002925	盈趣科技	477,468.00	4.48
92	000719	中原传媒	473,827.00	4.45
93	002705	新宝股份	472,252.00	4.43
94	603299	苏盐井神	456,909.00	4.29
95	300236	上海新阳	451,904.00	4.24
96	002258	利尔化学	450,540.00	4.23
97	600459	贵研铂业	448,540.00	4.21
98	300115	长盈精密	445,982.00	4.19
99	600100	同方股份	441,239.00	4.14
100	600248	陕建股份	440,083.00	4.13
101	002314	南山控股	436,380.00	4.10
102	600675	中华企业	433,643.00	4.07
103	600064	南京高科	426,975.00	4.01
104	601609	金田股份	423,969.00	3.98
105	002245	蔚蓝锂芯	423,631.00	3.98
106	002747	埃斯顿	423,062.00	3.97
107	301207	华兰疫苗	421,448.00	3.96
108	300666	江丰电子	417,527.00	3.92
109	300182	捷成股份	416,183.00	3.91
110	688208	道通科技	412,734.00	3.88
111	603588	高能环境	411,103.00	3.86
112	600120	浙江东方	407,565.00	3.83
113	600597	光明乳业	406,237.00	3.81
114	601778	晶科科技	400,625.00	3.76
115	600285	羚锐制药	397,610.00	3.73
116	000935	四川双马	391,638.00	3.68
117	603612	索通发展	386,634.00	3.63
118	688209	英集芯	379,230.55	3.56

119	300613	富瀚微	378,390.00	3.55
120	603533	掌阅科技	377,205.00	3.54
121	000030	富奥股份	373,270.00	3.50
122	688322	奥比中光-UW	371,601.53	3.49
123	603323	苏农银行	370,372.00	3.48
124	002539	云图控股	362,386.00	3.40
125	000885	城发环境	357,058.00	3.35
126	600428	中远海特	354,774.00	3.33
127	603005	晶方科技	353,851.00	3.32
128	603698	航天工程	352,765.00	3.31
129	300458	全志科技	346,583.00	3.25
130	600997	开滦股份	346,444.00	3.25
131	603508	思维列控	343,866.00	3.23
132	000686	东北证券	342,840.00	3.22
133	300682	朗新集团	335,599.00	3.15
134	600812	华北制药	332,716.00	3.12
135	300363	博腾股份	330,398.00	3.10
136	600502	安徽建工	327,990.00	3.08
137	600210	紫江企业	327,258.00	3.07
138	300762	上海瀚讯	326,731.00	3.07
139	600057	厦门象屿	324,515.00	3.05
140	002649	博彦科技	323,207.00	3.03
141	000680	山推股份	322,665.00	3.03
142	301559	中集环科	322,562.00	3.03
143	300327	中颖电子	320,101.00	3.01
144	600662	外服控股	317,791.00	2.98
145	002668	TCL智家	317,194.00	2.98
146	600782	新钢股份	314,484.00	2.95
147	300761	立华股份	314,183.00	2.95
148	600531	豫光金铅	313,194.00	2.94
149	603063	禾望电气	312,182.00	2.93

150	300398	飞凯材料	311,753.00	2.93
151	002060	广东建工	311,499.00	2.92
152	603444	吉比特	308,700.00	2.90
153	002911	佛燃能源	297,298.00	2.79
154	001389	广合科技	293,596.00	2.76
155	603699	纽威股份	293,366.00	2.75
156	002701	奥瑞金	293,130.00	2.75
157	600058	五矿发展	292,351.00	2.74
158	600179	安通控股	291,205.00	2.73
159	601860	紫金银行	287,441.00	2.70
160	002948	青岛银行	281,401.00	2.64
161	688185	康希诺	279,594.48	2.63
162	600963	岳阳林纸	278,373.00	2.61
163	601777	千里科技	277,849.00	2.61
164	601326	秦港股份	277,310.00	2.60
165	300770	新媒股份	272,441.00	2.56
166	300627	华测导航	271,840.00	2.55
167	688183	生益电子	269,745.51	2.53
168	601200	上海环境	267,831.00	2.51
169	002315	焦点科技	267,793.00	2.51
170	002745	木林森	267,668.00	2.51
171	002588	史丹利	267,207.00	2.51
172	002215	诺普信	264,955.00	2.49
173	601222	林洋能源	264,946.00	2.49
174	300869	康泰医学	264,297.00	2.48
175	002458	益生股份	263,976.00	2.48
176	600366	宁波韵升	263,515.00	2.47
177	002468	申通快递	261,913.00	2.46
178	688523	航天环宇	260,184.71	2.44
179	300102	乾照光电	260,156.00	2.44
180	002034	旺能环境	254,760.00	2.39

181	300456	赛微电子	250,529.00	2.35
182	002985	北摩高科	249,593.00	2.34
183	605296	神农集团	249,381.00	2.34
184	600395	盘江股份	248,437.00	2.33
185	688007	光峰科技	244,435.84	2.29
186	600211	西藏药业	243,152.00	2.28
187	002036	联创电子	242,482.00	2.28
188	688147	微导纳米	239,728.00	2.25
189	301327	华宝新能	238,884.00	2.24
190	301087	可孚医疗	235,843.00	2.21
191	603355	莱克电气	235,514.00	2.21
192	601886	江河集团	234,399.00	2.20
193	300101	振芯科技	231,322.00	2.17
194	688403	汇成股份	230,995.90	2.17
195	002901	大博医疗	230,515.00	2.16
196	688206	概伦电子	226,395.69	2.13
197	600750	江中药业	225,447.00	2.12
198	603055	台华新材	224,976.00	2.11
199	002171	楚江新材	224,690.00	2.11
200	000672	上峰水泥	224,336.00	2.11
201	600114	东睦股份	223,965.00	2.10
202	300674	宇信科技	223,717.00	2.10
203	002243	力合科创	222,794.00	2.09
204	600908	无锡银行	222,325.00	2.09
205	300360	炬华科技	222,124.00	2.09
206	000415	渤海租赁	219,312.00	2.06
207	601208	东材科技	219,000.00	2.06
208	000968	蓝焰控股	218,714.00	2.05
209	301050	雷电微力	218,257.00	2.05
210	600729	重庆百货	215,946.00	2.03
211	300737	科顺股份	215,631.00	2.02

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	002212	天融信	1,863,635.00	17.50
2	600216	浙江医药	1,460,986.00	13.72
3	603766	隆鑫通用	1,444,362.50	13.56
4	601311	骆驼股份	1,413,829.00	13.27
5	600633	浙数文化	1,389,671.00	13.05
6	300772	运达股份	1,373,679.00	12.90
7	600458	时代新材	1,268,603.00	11.91
8	601369	陕鼓动力	1,151,588.00	10.81
9	300303	聚飞光电	1,079,941.00	10.14
10	002498	汉缆股份	1,049,305.00	9.85
11	600552	凯盛科技	986,782.00	9.26
12	603236	移远通信	986,093.00	9.26
13	600075	新疆天业	976,921.00	9.17
14	600718	东软集团	912,314.00	8.57
15	603989	艾华集团	897,845.54	8.43
16	000657	中钨高新	892,349.00	8.38
17	600063	皖维高新	868,288.00	8.15
18	603218	日月股份	864,348.00	8.12
19	603301	振德医疗	815,266.00	7.65
20	002204	大连重工	805,660.00	7.56
21	000543	皖能电力	800,807.00	7.52
22	603328	依顿电子	799,971.00	7.51
23	600572	康恩贝	798,399.00	7.50
24	001308	康冠科技	782,880.00	7.35
25	600757	长江传媒	758,923.00	7.13

26	300672	国科微	732,606.00	6.88
27	600420	国药现代	726,538.00	6.82
28	600850	电科数字	711,445.00	6.68
29	002405	四维图新	710,544.00	6.67
30	603466	风语筑	687,913.00	6.46
31	300232	洲明科技	683,171.00	6.41
32	600267	海正药业	679,360.00	6.38
33	600269	赣粤高速	674,987.00	6.34
34	002396	星网锐捷	673,400.00	6.32
35	605123	派克新材	667,092.00	6.26
36	000528	柳工	663,032.00	6.23
37	600169	太原重工	662,259.00	6.22
38	600320	振华重工	658,496.00	6.18
39	600710	苏美达	646,833.00	6.07
40	300409	道氏技术	646,218.00	6.07
41	301339	通行宝	645,966.00	6.06
42	002100	天康生物	621,556.00	5.84
43	603678	火炬电子	615,876.00	5.78
44	300088	长信科技	615,400.00	5.78
45	000811	冰轮环境	604,932.00	5.68
46	601126	四方股份	604,054.00	5.67
47	002139	拓邦股份	597,892.00	5.61
48	000156	华数传媒	592,729.00	5.56
49	000685	中山公用	580,678.00	5.45
50	600017	日照港	580,142.00	5.45
51	000090	天健集团	579,222.00	5.44
52	600100	同方股份	577,504.00	5.42
53	603118	共进股份	575,973.00	5.41
54	603299	苏盐井神	572,559.00	5.38
55	603920	世运电路	564,880.00	5.30
56	002275	桂林三金	548,234.00	5.15

57	000821	京山轻机	542,348.00	5.09
58	300623	捷捷微电	538,689.00	5.06
59	002061	浙江交科	537,104.00	5.04
60	300315	掌趣科技	528,343.00	4.96
61	600248	陕建股份	527,951.00	4.96
62	600595	中孚实业	516,515.00	4.85
63	300236	上海新阳	514,369.00	4.83
64	600869	远东股份	500,038.00	4.69
65	600073	光明肉业	495,486.00	4.65
66	000682	东方电子	492,827.00	4.63
67	600531	豫光金铅	491,680.00	4.62
68	000913	钱江摩托	490,785.00	4.61
69	300579	数字认证	489,283.00	4.59
70	002389	航天彩虹	487,392.00	4.58
71	600388	龙净环保	482,718.00	4.53
72	600428	中远海特	482,318.00	4.53
73	600459	贵研铂业	480,799.00	4.51
74	300171	东富龙	480,675.00	4.51
75	300253	卫宁健康	475,729.00	4.47
76	002258	利尔化学	473,372.00	4.44
77	000719	中原传媒	472,156.00	4.43
78	688088	虹软科技	469,903.23	4.41
79	600120	浙江东方	465,988.80	4.38
80	300398	飞凯材料	461,761.00	4.34
81	300674	宇信科技	452,784.00	4.25
82	301031	中熔电气	447,963.00	4.21
83	000030	富奥股份	447,230.00	4.20
84	000885	城发环境	436,987.00	4.10
85	600305	恒顺醋业	431,381.00	4.05
86	601609	金田股份	427,550.00	4.01
87	002534	西子洁能	426,866.00	4.01

88	300115	长盈精密	426,152.00	4.00
89	002539	云图控股	423,476.00	3.98
90	300682	朗新集团	423,186.00	3.97
91	600064	南京高科	418,000.00	3.92
92	300777	中简科技	413,882.00	3.89
93	600587	新华医疗	413,573.00	3.88
94	300182	捷成股份	409,059.00	3.84
95	000600	建投能源	407,757.00	3.83
96	600210	紫江企业	394,816.00	3.71
97	002245	蔚蓝锂芯	390,679.00	3.67
98	002468	申通快递	385,126.00	3.62
99	603533	掌阅科技	367,504.00	3.45
100	688322	奥比中光-UW	366,638.30	3.44
101	002249	大洋电机	363,828.00	3.42
102	600987	航民股份	358,519.00	3.37
103	002705	新宝股份	356,455.00	3.35
104	301050	雷电微力	355,961.00	3.34
105	600866	星湖科技	353,568.00	3.32
106	300613	富瀚微	349,781.00	3.28
107	600335	国机汽车	348,742.50	3.27
108	603005	晶方科技	348,126.00	3.27
109	600728	佳都科技	347,765.00	3.27
110	301559	中集环科	345,502.00	3.24
111	300685	艾德生物	339,415.00	3.19
112	002948	青岛银行	336,128.00	3.16
113	600597	光明乳业	335,759.00	3.15
114	600675	中华企业	332,439.00	3.12
115	603169	兰石重装	327,408.00	3.07
116	688208	道通科技	324,664.24	3.05
117	002649	博彦科技	324,614.00	3.05
118	603039	泛微网络	319,100.00	3.00

119	001389	广合科技	318,891.00	2.99
120	002745	木林森	317,257.00	2.98
121	601222	林洋能源	315,023.00	2.96
122	300458	全志科技	313,875.00	2.95
123	300327	中颖电子	313,229.00	2.94
124	601778	晶科科技	313,153.00	2.94
125	600366	宁波韵升	310,276.00	2.91
126	688183	生益电子	306,993.00	2.88
127	603508	思维列控	300,380.00	2.82
128	603997	继峰股份	298,211.00	2.80
129	600812	华北制药	297,661.00	2.79
130	300627	华测导航	297,505.00	2.79
131	002010	传化智联	297,473.00	2.79
132	002215	诺普信	297,102.00	2.79
133	000498	山东路桥	295,249.00	2.77
134	603699	纽威股份	293,767.00	2.76
135	000680	山推股份	290,184.00	2.72
136	603063	禾望电气	281,874.00	2.65
137	000672	上峰水泥	277,328.00	2.60
138	002588	史丹利	274,979.00	2.58
139	603355	莱克电气	271,672.00	2.55
140	300869	康泰医学	270,705.00	2.54
141	300762	上海瀚讯	270,470.00	2.54
142	000968	蓝焰控股	266,823.00	2.51
143	002985	北摩高科	265,549.20	2.49
144	300770	新媒股份	264,950.00	2.49
145	600908	无锡银行	260,299.00	2.44
146	600963	岳阳林纸	259,254.00	2.43
147	601886	江河集团	256,909.00	2.41
148	601677	明泰铝业	251,241.00	2.36
149	688007	光峰科技	249,296.12	2.34

150	002747	埃斯顿	248,805.00	2.34
151	688206	概伦电子	246,624.33	2.32
152	601200	上海环境	242,082.37	2.27
153	301087	可孚医疗	241,986.00	2.27
154	600395	盘江股份	238,828.00	2.24
155	002458	益生股份	237,138.00	2.23
156	600211	西藏药业	237,044.00	2.23
157	603612	索通发展	233,710.00	2.19
158	300527	中船应急	232,198.00	2.18
159	600037	歌华有线	231,478.00	2.17
160	000550	江铃汽车	230,702.00	2.17
161	600502	安徽建工	229,229.00	2.15
162	300737	科顺股份	229,027.00	2.15
163	600114	东睦股份	226,218.00	2.12
164	300101	振芯科技	224,194.00	2.10
165	002060	广东建工	224,011.00	2.10
166	603995	甬金股份	221,839.00	2.08
167	688403	汇成股份	221,677.95	2.08
168	301327	华宝新能	220,220.20	2.07
169	002314	南山控股	219,961.00	2.07
170	000686	东北证券	219,876.00	2.06
171	000415	渤海租赁	216,058.00	2.03

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	133,551,868.15
卖出股票收入（成交）总额	115,569,728.64

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照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投资。

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

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	21,847.24
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,847.24

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的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§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
中加 量化 研选 混合A	142	133,735.15	15,433,015.94	81.2 7%	3,557,374.73	18.73%
中加 量化 研选 混合C	198	53,401.36	2,297,829.28	21.7 3%	8,275,640.03	78.27%
合计	340	86,952.53	17,730,845.22	59.9 7%	11,833,014.76	40.03%

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	中加量化研选混合A	148,835.86	0.78%
	中加量化研选混合C	102,832.55	0.97%
	合计	251,668.41	0.85%

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	中加量化研选混合A	0~10
	中加量化研选混合C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中加量化研选混合A	-
	中加量化研选混合C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中加量化研选混合A	中加量化研选混合C
基金合同生效日(2022年04月11日)基金份额总额	10,512,212.82	257,271,133.21
本报告期期初基金份额总额	2,017,179.15	9,288,898.53
本报告期基金总申购份额	21,105,533.48	20,943,872.31
减：本报告期基金总赎回份额	4,132,321.96	19,659,301.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期期末基金份额总额	18,990,390.67	10,573,469.31
--------------	---------------	---------------

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§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，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

基金管理人本报告期内重大人事变动情况：无。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况：无。

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

自本基金成立之日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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，基金管理人及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	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	佣金	占当期佣金总	

	元 数 量		交总额 的比例		量的比 例	
渤海 证券	2	249,121,596.79	100.0 0%	96,143.56	100.0 0%	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- （1）基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- （2）公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- （3）研究服务实力。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

- （1）权益投资部根据日常券商研究服务情况提议开立（含首次开立和新增开立）或关闭相关席位，挑选时应考虑在证券交易所都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；
- （2）总经理办公会负责审批、确定券商席位的首次开立事宜，投资决策委员会负责审批券商除首次开立以外新增及关闭席位事宜；
- （3）券商名单及相应的席位租用安排确定后,权益投资部负责协调办理咨询服务协议或研究服务协议签署等相关事宜，集中交易部负责协调办理正式租用席位协议签署等相关事宜。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	-	-	63,735,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	中加量化研选混合型证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-01-21
2	中加量化研选混合型证券投资基金2024年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-03-28

3	中加量化研选混合型证券投资基金2025年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2025-04-22
---	----------------------------	--------------	------------

§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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250127-20250630	0.00	15,433,015.94	0.00	15,433,015.94	52.20%
	2	20250101-20250126	4,297,829.28	0.00	2,000,000.00	2,297,829.28	7.77%
个人	1	20250313-20250319	0.00	4,803,535.40	4,803,535.40	0.00	0.00%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

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、中国证监会批准中加量化研选混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加量化研选混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加量化研选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、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

基金管理人处

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼
投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日