

中庚小盘价值股票型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:中庚基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月24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2026年01月01日起至2026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	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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§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	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	74
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	74
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	74
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	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 投资组合报告附注	75
§8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 盈利投资者数量占比	76

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
8.4 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	76
§9 开放式基金份额变动	76
§10 重大事件揭示	77
10.1 基金份额持有人大会决议	77
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	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	77
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	78
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	81
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	81
12.3 查阅方式	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中庚小盘价值股票型证券投资基金
基金简称	中庚小盘价值股票
基金主代码	007130
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年04月03日
基金管理人	中庚基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	342,743,333.13份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，以价值投资策略为基础，通过发掘全市场中小盘价值型上市公司投资机遇，选择具备高性价比投资标的构建组合，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金是股票型基金，大类资产配置不作为本基金的核心策略，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考量市场系统性风险、各类资产风险溢价、股票资产估值、流动性要求等因素后，在有效控制投资组合风险的前提下，进行大类资产配置战术调整。 本基金股票投资主要依据管理人搭建的"估值-盈利"模型，采用定量分析与定性分析结合的方式，重点投资于市场中在细分行业内具备一定的竞争优势、业绩良好且稳定、价值相对低估的小盘价值股票。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中庚基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔远洪	罗琦
	联系电话	021-20639999	020-66338888
	电子邮箱	cuiyuanhong@zgffunds.com.cn	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		021-53549999	95575
传真		021-20639747	020-87553363-6847
注册地址		上海市虹口区欧阳路218弄1号420室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦703-704	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200120	510627
法定代表人		孟辉	林传辉

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zgffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中庚基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦703-704

§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
---------------	-----

	(2026年01月01日 - 2026年06月30日)
本期已实现收益	162,663,753.82
本期利润	165,261,583.17
加权平均基金份额本期利润	0.4322
本期加权平均净值利润率	14.22%
本期基金份额净值增长率	15.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)
期末可供分配利润	621,430,364.65
期末可供分配基金份额利润	1.8131
期末基金资产净值	1,084,839,519.70
期末基金份额净值	3.1652
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)
基金份额累计净值增长率	216.52%

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，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.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。

3.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）。

3.2 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

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
过去三个月	9.97%	1.37%	14.14%	1.45%	-4.17%	-0.08%
过去六个月	15.57%	1.36%	14.63%	1.46%	0.94%	-0.10%
过去一年	32.49%	1.16%	34.59%	1.24%	-2.10%	-0.08%
过去三年	34.32%	1.52%	32.40%	1.49%	1.92%	0.03%

过去五年	75.51%	1.44%	25.80%	1.39%	49.71%	0.05%
过去七年	241.30%	1.42%	64.77%	1.37%	176.53%	0.05%
自基金合同生效起至今	216.52%	1.42%	44.37%	1.38%	172.15%	0.04%

注：本基金的业绩比较基准为中证1000指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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

本基金管理人为中庚基金管理有限公司（以下简称"公司"），于2018年6月经中国证监会核准设立。公司是一家以自然人持股发起设立的公募基金管理公司，注册资本为人民币21050万元，公司注册地为上海。截至报告期末，公司股东及其出资比例为：孟辉先生33.25%，中庚置业集团有限公司23.75%，闫炘先生18.05%，丘栋荣先生9.73%，上海睦菁投资管理合伙企业（有限合伙）4.74%，福建海龙威投资发展有限公司3.80%，曹庆先生2.39%，张京女士2.39%，福建瑞闽投资有限公司1.90%。

截至报告期末，公司共管理6只公募基金产品，分别为中庚价值领航混合型证券投资基金、中庚小盘价值股票型证券投资基金、中庚价值灵动灵活配置混合型证券投资基金、中庚价值品质一年持有期混合型证券投资基金、中庚价值先锋股票型证券投资基金、中庚港股通价值股票型证券投资基金，管理资产规模98.03亿元。

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		
韩逸平	本基金的基金经理；公司投资部量化投资部基金经理	2026-01-23	-	6年	韩逸平先生，经济学硕士，2019年7月起先后从事证券研究、投资管理相关工作。2019年7月加入中庚基金管理有限公司，现任公司投资部量化投资部基金经理。
陈涛	本基金的基金经理；中庚价值先锋股票基金基金经理；公司投资部投资总监兼基金经理	2024-07-19	2026-01-23	13年	陈涛先生，工程硕士，2013年7月起从事证券研究、投资管理相关工作，历任泰康资产研究员、华创证券高级分析师、浙商基金高级研究员、汇丰晋信基金投资经理等。2018年7月加入中庚基金管理有限公司，现任公司投资部投资总监兼基金经理。
殷乐	本基金的基金经理；公司投资部量化投资部总监兼基金经理	2025-04-08	2026-04-17	10年	殷乐先生，理学硕士，2015年7月起先后从事证券研究、投资管理相关工作，历任摩根基金管理（中国）有限公司研究员、中庚基金管理有限公司投资部量化投资部总监兼基金经理。

注：1.职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2.基金经理任职日期为根据公司决定确定的聘任日期；离任日期为根据公司决定确定的解聘日期。

3.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《中庚小盘价值股票型证券投资基金基金合同》《中庚小盘价值股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司继续贯彻落实《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《中庚基金管理有限公司公平交易制度》等相关监管法规及内部制度，严格规范境内上市证券的一级市场申购和二级市场交易相关的研究分析、投资决策、交易执行、日常监控和报告分析等投资管理环节，实行事前控制、事中监控、事后评估及反馈的流程化管理体系。在制度和实际操作层面确保各组合享有同等交易机会，并保持各组合的独立投资决策权。

事前控制主要包括：1、一级市场，通过恒生系统的线上流程和标准化的线下审批流程，对关联方审核、价格公允性判断及证券公平分配等相关环节进行控制；2、二级市场，通过交易系统的授权管理，对投资标的、交易对手和操作权限进行自动化控制。

事中控制主要包括组合间相同证券的交易方向控制。首先，将主动投资组合的同日反向交易列为禁止行为。其次，对于同日同向交易，通过交易系统对组合间的交易公平性进行自动化处理。

事后评估及反馈主要包括组合间不同时间窗口下（1日、3日、5日）的季度公平性交易分析评估。通过公平交易的事后分析评估系统，对当季度涉及公平性交易的投资行为进行统计分析。若发现异常交易行为，视情况要求相关当事人做出合理性解释，并按法规要求上报监管机构。

本报告期内，公司旗下各基金产品严格遵守公司的公平交易制度，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金与本公司管理的其他投资组合之间有导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，未出现本公司管理的投资组合参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的交易。

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

2026年上半年，国内宏观经济延续弱复苏态势，呈现结构分化特征，科技产业趋势和出口动能强劲，且价格中枢上移带动企业盈利高增，在此背景下，虽然政策基调仍然偏宽，但财政力度有所回收，内生增长较弱，信用扩张受阻，传统行业压力显著增加。一季度权益市场呈现出流动性宽裕下行业和风格轮动较快的特征，在经历了年初的快速上涨后，由于对地缘冲突和对高油价的担心，市场整体走弱。二季度则在地缘扰动缓和后修复风险偏好、结合季报期业绩验证，确定科技主线后快速反弹并创下新高。随后受美联储会议释放鹰派信号、推升利率与加息预期影响下市场震荡调整。

至2季度末，中证800股权风险溢价4.10%，至0.09倍标准差，10年期国债利率仅为1.73%，息债比处于93%分位。目前权益资产估值水平处于中性位置，在流动性宽松环境下，隐含回报与债券类资产比较具备相对优势，且权益估值和盈利分化极致，仍有机会挖掘市场结构性机会，构建高预期回报的组合。中证1000指数股权风险溢价至0.55倍标准差，息债比分位数81%。中小盘市场风险溢价随市场上涨过去一年持续回落，但仍处于0.5倍标准差附近，我们认为其依然具备配置价值。

AI大模型领域在2026年快速迭代，模型厂商的智能体系统与原生多模态成为新一轮主线，头部与国产厂商均围绕智能体、长上下文与视频、语音生成加快模型更新。词元调用量与订阅收入显著上行，头部公司盈利与收入高速增长，持续拉动算力基础设施投资，催生光通信、存储等全产业链需求，并进一步扩散到上游原材料和设备。在此基础上，市场二季度结构高度分化，科技成长风格显著占优，双创指数领涨，且产业供给瓶颈主导股价弹性；而传统红利、消费、微盘股等均阶段性承压，价格风格大幅跑输成长风格。展望后市，需要高度关注后续市场风格修复的可能性以及相应的结构性风险和机会。

基于产品的定位和投资目标，结合市场情况，本基金报告期内维持较高的权益仓位，二季度小幅跑输业绩比较基准。本基金在投资运作中坚持产品三高（高阿尔法、高贝塔、高smart beta）的定位不漂移，严格控制和比较基准的相对暴露和跟踪误差，以期获得相对稳定的超额收益和更高的信息比率，优化投资人的持有体验。实际投资管理上，本基金实行以低估值价值投资的主动权益策略为主，辅以量化模型进行组合管理和风险控制的模式，希望主动权益和量化模型低相关的alpha可以产生1+1>2的效果。

本报告期内，基金的投资运作中有以下几点需要重点说明：

1、持仓更加均衡、通过分散持股实现公司研究团队成果的转化。

本基金主要采取自下而上、精选个股的股票投资策略。在组合构建上坚持分散化、均衡化的组合构建思路，其出发点主要在于最大化研究团队的研究成果向投资回报的转化效率。通过对比多个细分赛道与产业链环节，挖掘更多的价值被明显低估的小盘价值股票，分散化配置可以避免因过度集中而导致的研究冗余，使组合整体呈现出研究精选后的小盘价值型特征，即阿尔法来源不再依赖少数几只个股的极端表现，而是通过大量小盘价值型持仓共同累积超额收益，从而提升组合收益的稳健性。

2、科技板块配置向中大市值龙头倾斜，主要基于估值性价比与业绩确定性两方面原因。

二季度市场呈现显著的结构分化，各主流宽基指数中科技行业权重普遍抬升至30%以上，其中中证1000内泛科技（含上游材料、设备）占比更超40%。尽管科技板块估值均处于历史极值区间，综合考虑业绩基准和组合管理，我们对科技板块的整体配置比例维持中性偏低。其中我们更多的选择了中大市值的科技龙头公司，主要基于以下判断：当前泛科技行业中，大市值龙头公司估值相对更低，且业绩增速不逊于小市值公司，呈现出更好的性价比。其一，AI硬件需求普遍是技术要求最高的尖端品类，有一定的技术和客户关系壁垒；其二，AI算力需求拉动较多的环节容易出现系统性的供需紧张，龙头公司往往对上游物料更有把控力；其三，大市值公司的基本面相对更加稳健、可跟踪性和业绩能见度相对更强。而二季度科技行情长鞭效应凸显，大量中小市值的硅基通胀品种、相关设备及上游材料估值均处于历史高位，其定价中隐含了非常乐观的远期叙事假设，可跟踪性和确定性很低，安全边际相对薄弱。因此在严格履行小盘价值风格库不低于80%的配置要求，并精选了一批基本面扎实、估值合理的小盘科技股后，我们适度放宽了剩余仓位的市值属性，重点配置了一部分相对估值更低、预期风险收益比更合适的中大市值科技龙头公司，以平衡组合的估值属性和成长稳健性。

3、增加量化辅助的方法进行组合管理和风险管理的参与度。

增加量化辅助的参与度主要基于以下考量：一是量化辅助选股的方法论在小盘股票领域具有显著优势，小盘股定价有效性低、标的数量多、股价波动高，天然适合使用量化辅助的方法获取超额收益，采用的量化辅助模型包括传统的多因子模型和机器学习模型，形式包括且不限于定量构建小盘价值股票池、比较基准成分股优选等；二是采用量化辅助的方法进行组合管理和风险管理，通过量化风险模型控制对投资组合的行业、风格敞口；三是响应《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》，强化业绩比较基准的约束作用，控制投资组合的基准覆盖度和跟踪误差等，注重过程管理和超额收益的稳定性，降低超额收益波动，优化投资人持有体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中庚小盘价值股票基金份额净值为3.1652元，本报告期内，基金份额净值增长率为15.57%，同期业绩比较基准收益率为14.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金坚持低估值价值投资策略，通过精选基本面良好或风险释放充分、盈利增长积极或反转概率大、竞争优势凸显、价值被低估的中小市值个股，构建高预期回报的中小盘组合，同时保持较小的行业和风格敞口，力争获得可持续的超额收益。后市中重点关注的投资方向包括：

1、科技行业中，未来最重要的驱动因素是硅基智能成本飞速降低、性能仍在持续提升，整体AI产业收入和利润会根据产业链各环节议价力的动态对比来分配。在产业利润池快速扩张的趋势下，看好稀缺或间接受益稀缺，能截留利润的环节。

2、需求反转型的行业，过去几年许多内需消费和地产链的公司都经历了估值业绩双杀的阶段，目前的估值定价无论是时点上还是和自身历史上都比较便宜。同时我们观察到今年以来房价加速下行结束，进入缓和期，利于预期企稳，内需下行风险收敛、向上弹性较大。

3、出口型的部分公司，其中我们重点关注在海外本地化部署得非常优秀的企业、或者是在全球具备高度竞争优势的公司，一方面存在中国制造的成本优势，另一方面也具备全球本地化的运营能力的公司壁垒。部分公司估值依然比较便宜，值得下注，包括但不限于医疗器械、摩托车、电力设备等。

4、防御型的稳定资产，其往往呈现出低估值、低波动、主业和分红都比较稳定的特点，是小盘价值型股票的典型代表，包括部分公用事业、城商行，以及制造业中的长期现金流和分红率都比较稳定的公司。

5、部分细分行业公司，主要体现在供给端刚性、需求端有韧性，甚至有一定成长性的价值股，主要包括以基本金属、贵金属、锂电材料等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

为合理、公允地对基金所投资品种进行估值，保护基金份额持有人利益，本公司设立估值委员会，专门负责基金估值工作，直接向公司管理层负责，在确定公司旗下基金的估值方法、估值模型选择、估值模型假设及估值政策和程序的建立等方面为公司管理层提供参考意见，为业务部门的操作提供指导意见并对执行情况进行监督。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、投资部负责人、研究总监、监察稽核部专人组成，当发现可能需要对某只证券重新估值的情形，估值委员会成员或基金经理可提请召开估值委员会，讨论估值方法的调整。估值委员会成员均具有多年专业工作经验，具备良好的专业知识和专业技能，充分理解各种估值方法和估值技术。估值委员会的职责主要包括有：

（一）负责建立、健全、落实公司的估值政策、估值程序和金融资产分类及预期信用损失减值的制度；

（二）负责参照估值模型和行业惯例，选定与市场环境相适应的估值方法；

（三）负责在经济环境发生重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件等情形下，确定合理的估值方法，组织估值调整；

（四）负责研究中国证券投资基金业协会估值核算工作小组发布的各类估值指引，评估指引实施后对估值的影响及估值系统改造的可行性；

（五）对直接选取第三方估值基准服务机构提供的证券估值价格的，负责评估第三方估值基准服务机构的估值质量，对估值价格进行校验，确定更能体现公允价值的估值价格；

（六）当本公司所管理的证券投资基金出现信用风险或流动性缺失时，召开估值委员会会议讨论确定公允价值或预期信用损失计量结果；

（七）当发生估值调整时，负责发布相关公告，充分披露确定公允价值的依据、方法、估值价格等信息；

（八）当本公司所管理的证券投资基金前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，负责决定是否暂停基金估值；

（九）当本公司所管理的证券投资基金发生大额申购或赎回情形时，负责决定是否启用摆动定价机制，摆动定价机制的处理原则与操作规范由中国证券投资基金业协会另行制定；

（十）当本公司所管理的证券投资基金持有存在风险的特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，按照《中庚基金管理有限公司运营业务流动性风险管理办法》的操作流程，负责执行侧袋机制。

参与估值流程的各方还包括托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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，但符合基金合同规定。

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

本报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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，本基金托管人在对中庚小盘价值股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，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

本报告期内，中庚基金管理有限公司在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人依法对中庚基金管理有限公司编制和披露的中庚小盘价值股票型证券投资基金2026年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§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：中庚小盘价值股票型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	63,373,884.95	14,037,262.47
结算备付金		1,393.11	1,386.14

存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,021,813,353.53	1,081,097,167.89
其中：股票投资		991,077,563.18	1,014,978,690.73
基金投资		-	-
债券投资		30,735,790.35	66,118,477.16
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	-	18,995,999.32
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		6,308,934.12	1,041,904.53
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,091,497,565.71	1,115,173,720.35
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025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		5,311,323.72	11,378,419.37
应付管理人报酬		1,059,862.89	1,139,043.45
应付托管费		176,643.78	189,840.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,819.50	613.40

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	108,396.12	90,851.41
负债合计		6,658,046.01	12,798,768.24
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	342,743,333.13	402,521,964.95
未分配利润	6.4.7.8	742,096,186.57	699,852,987.16
净资产合计		1,084,839,519.70	1,102,374,952.11
负债和净资产总计		1,091,497,565.71	1,115,173,720.35

注：1.报告截止日2026年6月30日，基金份额净值3.1652元，基金份额总额342,743,333.13份。

2.货币资金中包含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。

6.2 利润表

会计主体：中庚小盘价值股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		173,438,347.10	88,299,217.62
1.利息收入		234,072.08	84,234.38
其中：存款利息收入	6.4.7.9	49,740.04	53,139.82
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		184,332.04	31,094.56
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		169,898,903.38	134,255,495.46
其中：股票投资收益	6.4.7.10	163,611,804.10	115,927,570.29

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	389,298.28	427,477.65
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
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	5,897,801.00	17,900,447.52
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	2,597,829.35	-46,191,814.99
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.16	707,542.29	151,302.77
减：二、营业总支出		8,176,763.93	11,221,973.17
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	6,917,963.43	9,521,762.51
2.托管费	6.4.10.2.2	1,152,993.91	1,586,960.35
3.销售服务费		-	-
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		-	-
7.税金及附加		1,668.24	111.96
8.其他费用	6.4.7.17	104,138.35	113,138.35
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		165,261,583.17	77,077,244.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		165,261,583.17	77,077,244.45
五、其他综合收益的税后 净额		-	-

六、综合收益总额		165,261,583.17	77,077,244.45
----------	--	----------------	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：中庚小盘价值股票型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026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	402,521,964.95	699,852,987.16	1,102,374,952.11
二、本期期初净资产	402,521,964.95	699,852,987.16	1,102,374,952.11
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-59,778,631.82	42,243,199.41	-17,535,432.41
（一）、综合收益总额	-	165,261,583.17	165,261,583.17
（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）	-59,778,631.82	-123,018,383.76	-182,797,015.58
其中：1.基金申购款	92,254,667.78	188,516,073.92	280,770,741.70
2.基金赎回款	-152,033,299.60	-311,534,457.68	-463,567,757.28
（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	342,743,333.13	742,096,186.57	1,084,839,519.70

项 目	上年度可比期间		
	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	792,240,237.58	1,007,802,302.30	1,800,042,539.88
二、本期期初净资产	792,240,237.58	1,007,802,302.30	1,800,042,539.88
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-179,360,835.46	-156,516,923.71	-335,877,759.17
（一）、综合收益总额	-	77,077,244.45	77,077,244.45
（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）	-179,360,835.46	-233,594,168.16	-412,955,003.62
其中：1.基金申购款	19,733,610.61	25,667,090.84	45,400,701.45
2.基金赎回款	-199,094,446.07	-259,261,259.00	-458,355,705.07
（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	612,879,402.12	851,285,378.59	1,464,164,780.71

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:

孟辉

孟辉

欧晔

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

中庚小盘价值股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]342号《关于准予中庚小盘价值股票型证券投资基金注册的批复》核准，由中庚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《中庚小盘价值股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,266,540,389.66元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0216号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中庚小盘价值股票型证券投资基金基金合同》于2019年4月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,267,113,946.25份基金份额，其中认购资金利息折合573,556.59份基金份额。本基金的基金管理人为中庚基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中庚小盘价值股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金股票、存托凭证投资占基金资产的比例范围为85%-95%。其中投资于基金界定的小盘价值型股票、存托凭证资产占非现金基金资产的比例不低于80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证1000指数收益率×90%+上证国债指数收益率×10%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、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“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《中庚小盘价值股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[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》、财税[2016]140号《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《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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行

的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。对基金从上市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。

(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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2026年06月30日
活期存款	3,514,766.48
等于：本金	3,512,318.63
加：应计利息	2,447.85
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	59,859,118.47
等于：本金	59,858,330.02

加：应计利息	788.45
合计	63,373,884.95

注：其他存款本期末余额为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 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		968,489,585.98	-	991,077,563.18	22,587,977.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	30,434,024.96	293,790.35	30,735,790.35	7,975.04
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	30,434,024.96	293,790.35	30,735,790.35	7,975.04
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		998,923,610.94	293,790.35	1,021,813,353.53	22,595,952.24

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

本基金本报告期末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 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,433.52
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	-
预提费用-审计费	44,630.98
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	1,824.25
合计	108,396.12

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	402,521,964.95	402,521,964.95
本期申购	92,254,667.78	92,254,667.78
本期赎回（以“-”号填列）	-152,033,299.60	-152,033,299.60
本期末	342,743,333.13	342,743,333.13

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	560,446,477.66	139,406,509.50	699,852,987.16

本期期初	560,446,477.66	139,406,509.50	699,852,987.16
本期利润	162,663,753.82	2,597,829.35	165,261,583.17
本期基金份额交易产生的变动数	-101,679,866.83	-21,338,516.93	-123,018,383.76
其中：基金申购款	146,935,925.07	41,580,148.85	188,516,073.92
基金赎回款	-248,615,791.90	-62,918,665.78	-311,534,457.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	621,430,364.65	120,665,821.92	742,096,186.57

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	41,870.42
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	7,424.15
结算备付金利息收入	6.97
其他	438.50
合计	49,740.04

注：1.其他存款利息收入为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产生的利息收入。
2.其他为直销申购款利息收入。

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 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	4,021,622,048.81
减：卖出股票成本总额	3,852,077,291.86
减：交易费用	5,932,952.85
买卖股票差价收入	163,611,804.10

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	290,492.12
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	98,806.16
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	389,298.28

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	101,701,889.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,646,007.11
减：应计利息总额	940,352.70
减：交易费用	16,723.73
买卖债券差价收入	98,806.16

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无股指期货投资收益等其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	5,897,801.00
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	5,897,801.00

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	2,597,829.35
——股票投资	2,680,743.24
——债券投资	-82,913.89
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,597,829.35

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	704,005.42
转换费收入	3,536.87
合计	707,542.29

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的25%归入基金资产。
2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	104,138.35

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，本基金无须披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中庚基金管理有限公司("中庚基金")	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构

广发证券股份有限公司("广发证券")	基金托管人、基金销售机构、基金证券经纪商
自然人股东	基金管理人的股东

注：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 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025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
广发证券	7,844,698,678.61	100.00%	2,829,880,325.11	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
广发证券	167,237,312.55	100.00%	90,477,078.49	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	3,769,207,000.00	100.00%	516,730,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026年01月01日至2026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
广发证券	3,473,346.67	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	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
广发证券	1,247,758.89	100.00%	-	-

注：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，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

2.该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号），自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；针对其他类型基金，不再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 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,917,963.43	9,521,762.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,208,451.27	4,254,248.17
应支付基金管理人的净管理费	3,709,512.16	5,267,514.34

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,152,993.91	1,586,960.35

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人于次月前5个工作日内向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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

本基金本报告期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

本基金本报告期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

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,802,317.40	5,802,317.40
报告期间申购/买入总份额	3,365,646.77	-
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	9,167,964.17	5,802,317.40
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.67%	0.95%

注：1.如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务。
2.如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。
3.上述申购交易为2026年3月17日通过直销柜台申请，按照申请金额匹配费率，对应的申购费率为每笔1000元。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	937,120.33	0.27%	937,120.33	0.23%

注：上述关联方投资本基金适用的认购、申购、赎回费率按照本基金招募说明书的费率执行。

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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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
广发证券-托管户	3,514,766.48	41,870.42	2,771,216.32	49,978.72
广发证券-证券资金户	59,859,118.47	7,424.15	5,060,078.89	3,040.07

注：1.本基金托管户的银行存款由基金托管人广发证券股份有限公司存放在交通银行股份有限公司广东省分行营业部，按银行同业活期存款协议约定利率计息。
2.本基金证券资金户的存款为本基金存放于广发证券股份有限公司基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2026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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	9个月	科创板打新限售	114.28	676.94	4,676	534,373.28	3,165,371.44	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	科创板打新限售	104.66	768.89	3,362	351,866.92	2,585,008.18	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	创业板打新限售	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
001248	华润新能	2026-06-24	6个交易日	新股未上市	10.11	10.11	50,462	510,170.82	510,170.82	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	科创板打新限售	19.68	141.49	1,855	36,506.40	262,463.95	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6个月	新股锁定	10.12	27.73	6,020	60,922.40	166,934.60	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	科创板打新限售	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
3016	宏明	2026-	6个	创业	69.66	160.0	714	49,73	114,2	-

82	电子	03-18	月	板打 新限售		6		7.24	82.84	
6887 12	北芯 生命	2026- 01-28	6个 月	科创 板打 新限售	17.52	35.92	1,500	26,28 0.00	53,88 0.00	-
6887 85	恒运 昌	2026- 01-20	6个 月	科创 板打 新限售	92.18	463.1 5	116	10,69 2.88	53,72 5.40	-
6888 13	泰金 新能	2026- 03-24	6个 月	科创 板打 新限售	26.28	172.0 9	234	6,14 9.52	40,26 9.06	-
6886 35	长进 光子	2026- 05-20	6个 月	科创 板打 新限售	40.98	308.1 9	128	5,24 5.44	39,44 8.32	-
0012 57	盛龙 股份	2026- 03-24	6个 月	新股 锁定	7.82	20.74	1,743	13,63 0.26	36,14 9.82	-
0012 37	惠康 科技	2026- 05-15	6个 月	新股 锁定	53.26	58.74	285	15,17 9.10	16,74 0.90	-
3016 87	新广 益	2025- 12-24	6个 月	创业 板打 新限售	21.93	77.78	195	4,27 6.35	15,16 7.10	-
0013 93	维通 利	2026- 05-08	6个 月	新股 锁定	30.38	38.99	387	11,75 7.06	15,08 9.13	-
3015 31	春光 集团	2026- 04-28	6个 月	创业 板打 新限售	13.30	51.56	290	3,85 7.00	14,95 2.40	-

301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股锁定	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	创业板打新限售	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	科创板打新限售	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股锁定	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	创业板打新限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股锁定	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股锁定	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位: 张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-10	18个交易日	新债未上市	100.00	100.00	3,200	320,000.00	320,014.73	-

118070	南芯转债	2026-06-18	15个交易日	新债未上市	100.00	100.01	1,010	101,000.00	101,005.76	-
--------	------	------------	--------	-------	--------	--------	-------	------------	------------	---

注: 1.基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让；基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让。

2.基金作为特定投资者认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

3.基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

4.基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

5.基金通过询价转让受让的上市公司股东首次公开发行前已发行股份，在受让后6个月内不得转让。

6.基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688121	*ST卓然	2026-05-06	重大事项停牌	6.48	2026-07-07	5.18	49,500	536,610.69	320,760.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末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

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人持续推进全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责评价公司整体合规管理和内控风险管理等；在公司层面设立合规与风控委员会，负责管理和控制日常经营风险、基金投资风险和其他业务风险。督察长独立行使督察权利，直接对董事会负责，向风险控制委员会提交独立的风险管理报告和风险管理建议；监察稽核部负责建立和完善公司投资风险管理制度与流程，组织实施公司投资风险管理及绩效分析工作，确保公司各类投资风险得到良好监督与控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理主要是通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具的特征，通过特定的风险量化指标、模型及日常报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，及时对各种风险进行监控、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期存款和协议存款全部存放在本基金的托管人广发证券股份有限公司指定的交通银行或其他具有基金托管资格的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以基金证券经纪商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。

于2026年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券占基金净资产的比例为0.04%（2025年12月31日：本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券）。

6.4.13.3 流动性风险

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

为应对投资者赎回可能带来的流动性风险，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2026年6月30日，本基金所承担的全部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（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

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

通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2026年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.79%（2025年12月31日：3.46%）。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2026年6月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年 06月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	63,373,884.95	-	-	-	-	-	63,373,884.95
结算备	1,393.11	-	-	-	-	-	1,393.11

付金							
交易性金融资产	-	-	30,735,790.35	-	-	991,077,563.18	1,021,813,353.53
应收申购款	-	-	-	-	-	6,308,934.12	6,308,934.12
资产总计	63,375,278.06	-	30,735,790.35	-	-	997,386,497.30	1,091,497,565.71
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	5,311,323.72	5,311,323.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,059,862.89	1,059,862.89
应付托管费	-	-	-	-	-	176,643.78	176,643.78
应交税费	-	-	-	-	-	1,819.50	1,819.50
其他负债	-	-	-	-	-	108,396.12	108,396.12
负债总计	-	-	-	-	-	6,658,046.01	6,658,046.01
利率敏感度缺口	63,375,278.06	-	30,735,790.35	-	-	990,728,451.29	1,084,839,519.70
上年度末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	14,037,262.47	-	-	-	-	-	14,037,262.47
结算备付金	1,386.14	-	-	-	-	-	1,386.14
交易性金融资产	65,209,390.37	-	909,086.79	-	-	1,014,978,690.73	1,081,097,167.89
买入返售金融资产	18,995,999.32	-	-	-	-	-	18,995,999.32
应收申	-	-	-	-	-	1,041,904.53	1,041,904.53

购款							
资产总计	98,244,038.30	-	909,086.79	-	-	1,016,020,595.26	1,115,173,720.35
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	11,378,419.37	11,378,419.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,139,043.45	1,139,043.45
应付托管费	-	-	-	-	-	189,840.61	189,840.61
应交税费	-	-	-	-	-	613.40	613.40
其他负债	-	-	-	-	-	90,851.41	90,851.41
负债总计	-	-	-	-	-	12,798,768.24	12,798,768.24
利率敏感度缺口	98,244,038.30	-	909,086.79	-	-	1,003,221,827.02	1,102,374,952.11

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为2.83%（2025年12月31日：6.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出大类资产配置的决定；通过投资组合的分散化降

低其他价格风险，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%，且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%；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025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	991,077,563.18	91.36	1,014,978,690.73	92.07
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	991,077,563.18	91.36	1,014,978,690.73	92.07

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2、以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。	
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	上年度末
		2026年06月30日	2025年12月31日
	1.业绩比较基准上升5%	71,601,637.33	57,594,187.15
	2.业绩比较基准下降5%	-71,601,637.33	-57,594,187.15

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	982,905,888.84	976,858,898.47
第二层次	31,566,721.17	70,319,050.16
第三层次	7,340,743.52	33,919,219.26
合计	1,021,813,353.53	1,081,097,167.89

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年6月30日，本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2025年12月31日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	991,077,563.18	90.80
	其中：股票	991,077,563.18	90.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	30,735,790.35	2.82
	其中：债券	30,735,790.35	2.82
	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	63,375,278.06	5.81
8	其他各项资产	6,308,934.12	0.58
9	合计	1,091,497,565.71	100.00

注：银行存款中包含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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	6,089,267.10	0.56
B	采矿业	56,002,167.82	5.16
C	制造业	762,382,154.29	70.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,555,749.82	0.42
E	建筑业	855,180.00	0.08
F	批发和零售业	10,629,374.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	9,519,142.00	0.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,161,114.45	5.45
J	金融业	13,317,214.00	1.23
K	房地产业	12,091,921.00	1.11
L	租赁和商务服务业	3,256,445.52	0.30
M	科学研究和技术服务业	12,786,006.50	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	29,285,036.00	2.70
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,908,179.68	0.82
R	文化、体育和娱乐业	2,238,611.00	0.21
S	综合	-	-
	合计	991,077,563.18	91.36

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	600323	瀚蓝环境	934,200	25,653,132.00	2.36
2	300502	新易盛	37,660	22,859,620.00	2.11
3	300308	中际旭创	17,900	22,733,000.00	2.10

4	001301	尚太科技	241,900	22,620,069.00	2.09
5	688029	南微医学	245,987	17,661,866.60	1.63
6	000975	山金国际	1,002,300	17,039,100.00	1.57
7	002541	鸿路钢构	926,200	16,041,784.00	1.48
8	000695	滨海能源	1,187,100	14,838,750.00	1.37
9	300855	图南股份	448,962	14,034,552.12	1.29
10	603345	安井食品	166,190	13,326,776.10	1.23
11	688617	惠泰医疗	60,500	10,984,380.00	1.01
12	601155	新城控股	1,026,100	10,527,786.00	0.97
13	002028	思源电气	58,500	10,120,500.00	0.93
14	603083	剑桥科技	39,700	10,118,339.00	0.93
15	601899	紫金矿业	366,100	9,203,754.00	0.85
16	002463	沪电股份	57,900	8,847,120.00	0.82
17	002475	立讯精密	120,800	8,504,320.00	0.78
18	605305	中际联合	190,000	7,964,800.00	0.73
19	603993	洛阳钼业	425,600	7,469,280.00	0.69
20	300750	宁德时代	19,000	7,467,190.00	0.69
21	603766	隆鑫通用	581,200	6,933,716.00	0.64
22	301039	中集车辆	963,900	6,795,495.00	0.63
23	603129	春风动力	25,600	6,548,480.00	0.60
24	300738	奥飞数据	319,000	6,450,180.00	0.59
25	688627	精智达	8,400	6,006,000.00	0.55
26	301035	润丰股份	127,400	5,911,360.00	0.54
27	688235	百济神州	22,591	5,751,894.51	0.53
28	001339	智微智能	55,350	5,661,198.00	0.52
29	688388	嘉元科技	127,355	5,603,620.00	0.52
30	601528	瑞丰银行	1,259,500	5,566,990.00	0.51
31	300274	阳光电源	34,700	5,517,994.00	0.51
32	603871	嘉友国际	535,600	5,468,476.00	0.50
33	600908	无锡银行	1,037,100	5,268,468.00	0.49
34	002384	东山精密	19,900	5,220,765.00	0.48

35	603659	璞泰来	180,000	5,207,400.00	0.48
36	002851	麦格米特	31,000	5,182,580.00	0.48
37	300015	爱尔眼科	626,818	5,177,516.68	0.48
38	000811	冰轮环境	88,200	4,958,604.00	0.46
39	301031	中熔电气	40,988	4,896,016.60	0.45
40	300373	扬杰科技	30,900	4,858,407.00	0.45
41	002484	江海股份	45,400	4,767,000.00	0.44
42	002078	太阳纸业	381,200	4,761,188.00	0.44
43	300814	中富电路	23,000	4,703,500.00	0.43
44	688167	炬光科技	12,690	4,494,924.90	0.41
45	002624	完美世界	360,700	4,479,894.00	0.41
46	002182	宝武镁业	281,600	4,384,512.00	0.40
47	688630	芯碁微装	7,700	4,230,303.00	0.39
48	301018	申菱环境	35,940	4,155,023.40	0.38
49	605376	博迁新材	15,000	4,069,500.00	0.38
50	002938	鹏鼎控股	38,400	4,046,592.00	0.37
51	000506	招金黄金	343,500	4,025,820.00	0.37
52	688183	生益电子	30,000	3,972,000.00	0.37
53	002364	中恒电气	73,200	3,938,160.00	0.36
54	603915	国茂股份	276,500	3,923,535.00	0.36
55	688668	鼎通科技	10,500	3,919,650.00	0.36
56	600801	华新建材	245,600	3,831,360.00	0.35
57	600841	动力新科	619,692	3,780,121.20	0.35
58	688372	伟测科技	20,200	3,757,200.00	0.35
59	301267	华夏眼科	255,700	3,730,663.00	0.34
60	688141	杰华特	24,200	3,714,700.00	0.34
61	300726	宏达电子	43,300	3,661,881.00	0.34
62	688368	晶丰明源	16,900	3,659,188.00	0.34
63	300438	鹏辉能源	42,200	3,496,270.00	0.32
64	688981	中芯国际	22,000	3,494,040.00	0.32
65	600869	远东股份	104,300	3,490,921.00	0.32

66	002156	通富微电	45,100	3,421,737.00	0.32
67	001267	汇绿生态	62,900	3,365,150.00	0.31
68	000680	山推股份	330,000	3,316,500.00	0.31
69	300602	飞荣达	64,500	3,302,400.00	0.30
70	688062	迈威生物	116,500	3,291,125.00	0.30
71	600888	新疆众和	207,100	3,290,819.00	0.30
72	300593	新雷能	109,200	3,282,552.00	0.30
73	300843	胜蓝股份	20,900	3,265,625.00	0.30
74	605020	永和股份	79,100	3,220,952.00	0.30
75	688486	龙迅股份	50,640	3,219,691.20	0.30
76	688795	摩尔线程	4,676	3,165,371.44	0.29
77	301263	泰恩康	154,100	3,157,509.00	0.29
78	688008	澜起科技	10,100	3,129,990.00	0.29
79	300316	晶盛机电	49,800	3,007,920.00	0.28
80	000603	盛达资源	129,600	2,993,760.00	0.28
81	002001	新 和 成	105,000	2,984,100.00	0.28
82	002271	东方雨虹	250,300	2,971,061.00	0.27
83	688195	腾景科技	15,300	2,946,474.00	0.27
84	688099	晶晨股份	28,300	2,912,070.00	0.27
85	601020	华钰矿业	121,300	2,909,987.00	0.27
86	301550	斯菱智驱	31,400	2,870,902.00	0.26
87	600176	中国巨石	38,700	2,820,456.00	0.26
88	300863	卡倍亿	36,680	2,810,788.40	0.26
89	301191	菲菱科思	24,100	2,736,555.00	0.25
90	688400	凌云光	41,100	2,720,820.00	0.25
91	603268	松发股份	19,200	2,674,176.00	0.25
92	688403	汇成股份	66,200	2,628,140.00	0.24
93	002714	牧原股份	74,700	2,613,753.00	0.24
94	002518	科士达	48,500	2,599,115.00	0.24
95	688802	沐曦股份	3,362	2,585,008.18	0.24
96	300672	国科微	8,500	2,507,500.00	0.23

97	002738	中矿资源	41,700	2,459,883.00	0.23
98	603986	兆易创新	3,000	2,445,000.00	0.23
99	300031	宝通科技	82,800	2,365,596.00	0.22
100	688800	瑞可达	24,560	2,357,023.20	0.22
101	000510	新金路	93,100	2,312,604.00	0.21
102	600113	浙江东日	68,200	2,262,876.00	0.21
103	601952	苏垦农发	300,000	2,247,000.00	0.21
104	300568	星源材质	119,700	2,240,784.00	0.21
105	002756	永兴材料	39,300	2,225,952.00	0.21
106	600356	恒丰纸业	300,000	2,223,000.00	0.20
107	300820	英杰电气	24,500	2,210,635.00	0.20
108	002965	祥鑫科技	43,100	2,195,945.00	0.20
109	688498	源杰科技	1,150	2,168,900.00	0.20
110	688025	杰普特	4,600	2,162,000.00	0.20
111	300762	上海瀚讯	46,800	2,136,420.00	0.20
112	600388	龙净环保	146,200	2,127,210.00	0.20
113	000408	藏格矿业	30,600	2,121,192.00	0.20
114	001337	四川黄金	57,300	2,100,618.00	0.19
115	601126	四方股份	33,200	2,098,240.00	0.19
116	605196	华通线缆	79,900	2,085,390.00	0.19
117	002046	国机精工	28,300	2,084,295.00	0.19
118	603556	海兴电力	93,900	2,065,800.00	0.19
119	002317	众生药业	82,700	2,031,939.00	0.19
120	002916	深南电路	4,400	2,014,760.00	0.19
121	688150	莱特光电	28,800	1,976,256.00	0.18
122	002080	中材科技	21,800	1,962,000.00	0.18
123	301489	思泉新材	11,820	1,945,335.60	0.18
124	600301	华锡有色	31,500	1,931,580.00	0.18
125	688717	艾罗能源	23,200	1,915,624.00	0.18
126	600426	华鲁恒升	79,929	1,911,901.68	0.18
127	600233	圆通速递	120,800	1,902,600.00	0.18

128	300811	铂科新材	19,980	1,895,902.20	0.17
129	688359	三孚新科	9,400	1,865,336.00	0.17
130	002266	浙富控股	366,600	1,854,996.00	0.17
131	688041	海光信息	5,000	1,851,500.00	0.17
132	600522	中天科技	30,400	1,844,672.00	0.17
133	601208	东材科技	26,000	1,840,540.00	0.17
134	603799	华友钴业	37,500	1,809,750.00	0.17
135	603663	DR三祥新	18,700	1,800,810.00	0.17
136	002937	兴瑞科技	40,400	1,774,772.00	0.16
137	002458	益生股份	225,530	1,752,368.10	0.16
138	002796	世嘉科技	42,000	1,712,760.00	0.16
139	688484	南芯科技	30,000	1,694,700.00	0.16
140	000039	中集集团	206,800	1,677,148.00	0.15
141	002545	东方铁塔	103,100	1,672,282.00	0.15
142	300938	信测标准	33,400	1,665,992.00	0.15
143	600236	桂冠电力	189,300	1,662,054.00	0.15
144	603005	晶方科技	30,800	1,659,196.00	0.15
145	600487	亨通光电	14,900	1,629,166.00	0.15
146	688599	天合光能	115,200	1,626,624.00	0.15
147	301511	德福科技	11,300	1,625,505.00	0.15
148	001332	锡装股份	41,380	1,624,992.60	0.15
149	300073	当升科技	33,800	1,623,752.00	0.15
150	603306	华懋科技	15,600	1,617,564.00	0.15
151	688343	云天励飞	19,800	1,616,868.00	0.15
152	688396	华润微	16,400	1,599,820.00	0.15
153	688281	华秦科技	31,600	1,587,268.00	0.15
154	002151	北斗星通	49,500	1,571,625.00	0.14
155	300545	联得装备	34,000	1,570,800.00	0.14
156	688319	欧林生物	35,700	1,570,086.00	0.14
157	300842	帝科股份	17,600	1,569,392.00	0.14
158	300034	钢研高纳	91,500	1,568,310.00	0.14

159	002497	雅化集团	74,000	1,507,380.00	0.14
160	688063	派能科技	28,200	1,502,214.00	0.14
161	688046	药康生物	61,900	1,497,980.00	0.14
162	002831	裕同科技	42,057	1,495,546.92	0.14
163	688733	壹石通	36,100	1,492,735.00	0.14
164	002245	蔚蓝锂芯	79,000	1,478,090.00	0.14
165	603256	宏和科技	5,500	1,459,315.00	0.13
166	002434	万里扬	240,700	1,456,235.00	0.13
167	301177	迪阿股份	52,800	1,455,696.00	0.13
168	301345	涛涛车业	6,300	1,455,300.00	0.13
169	300870	欧陆通	4,200	1,451,898.00	0.13
170	000810	创维数字	109,500	1,450,875.00	0.13
171	688772	珠海冠宇	73,900	1,450,657.00	0.13
172	603179	新泉股份	29,200	1,449,780.00	0.13
173	688519	南亚新材	3,801	1,444,532.04	0.13
174	301607	富特科技	27,620	1,443,145.00	0.13
175	600855	航天长峰	103,600	1,441,076.00	0.13
176	688553	汇宇制药	135,324	1,438,494.12	0.13
177	600399	抚顺特钢	349,600	1,436,856.00	0.13
178	301205	联特科技	4,300	1,436,630.00	0.13
179	002913	奥士康	22,200	1,419,468.00	0.13
180	002488	金固股份	159,200	1,418,472.00	0.13
181	600100	同方股份	206,200	1,412,470.00	0.13
182	600309	万华化学	20,000	1,368,200.00	0.13
183	002895	川恒股份	46,600	1,360,720.00	0.13
184	688625	呈和科技	16,000	1,350,560.00	0.12
185	300304	云意电气	75,100	1,340,535.00	0.12
186	002906	华阳集团	53,600	1,337,856.00	0.12
187	688087	英科再生	40,000	1,336,800.00	0.12
188	002558	巨人网络	48,500	1,336,660.00	0.12
189	688472	阿特斯	122,000	1,320,040.00	0.12

190	300661	圣邦股份	9,200	1,320,016.00	0.12
191	300573	兴齐眼药	31,810	1,296,575.60	0.12
192	300806	斯迪克	11,500	1,288,000.00	0.12
193	301622	英思特	27,300	1,285,830.00	0.12
194	300761	立华股份	77,800	1,276,698.00	0.12
195	600037	歌华有线	202,800	1,271,556.00	0.12
196	001330	博纳影业	225,800	1,268,996.00	0.12
197	688127	蓝特光学	13,000	1,268,800.00	0.12
198	300613	富瀚微	15,800	1,265,264.00	0.12
199	001389	广合科技	5,300	1,257,425.00	0.12
200	688697	纽威数控	92,000	1,250,280.00	0.12
201	002517	恺英网络	76,100	1,236,625.00	0.11
202	000901	航天科技	69,100	1,229,289.00	0.11
203	301396	宏景科技	3,700	1,226,920.00	0.11
204	688200	华峰测控	2,336	1,226,633.60	0.11
205	601677	明泰铝业	73,755	1,224,333.00	0.11
206	688220	翱捷科技	9,800	1,218,336.00	0.11
207	002557	洽洽食品	67,600	1,214,096.00	0.11
208	300972	万辰集团	7,000	1,213,870.00	0.11
209	600330	天通股份	39,300	1,212,012.00	0.11
210	603969	银龙股份	165,700	1,204,639.00	0.11
211	002594	比亚迪	15,000	1,195,500.00	0.11
212	600623	华谊集团	147,400	1,189,518.00	0.11
213	688777	中控技术	10,100	1,186,750.00	0.11
214	688110	东芯股份	5,800	1,181,460.00	0.11
215	688502	茂莱光学	1,700	1,179,120.00	0.11
216	002859	洁美科技	10,700	1,171,757.00	0.11
217	688536	思瑞浦	3,200	1,165,088.00	0.11
218	301160	翔楼新材	24,900	1,161,585.00	0.11
219	600546	山煤国际	106,000	1,158,580.00	0.11
220	601033	永兴股份	86,200	1,155,080.00	0.11

221	001376	百通能源	110,400	1,148,160.00	0.11
222	688279	峰昭科技	5,100	1,144,644.00	0.11
223	002155	湖南黄金	47,900	1,143,373.00	0.11
224	688489	三未信安	50,328	1,142,445.60	0.11
225	688428	诺诚健华	40,000	1,138,800.00	0.10
226	600595	中孚实业	202,100	1,135,802.00	0.10
227	002283	天润工业	116,800	1,127,120.00	0.10
228	688123	聚辰股份	5,300	1,126,780.00	0.10
229	600366	宁波韵升	76,700	1,125,956.00	0.10
230	000651	格力电器	30,000	1,125,000.00	0.10
231	688349	三一重能	73,320	1,112,997.60	0.10
232	300768	迪普科技	80,200	1,104,354.00	0.10
233	688556	高测股份	83,100	1,103,568.00	0.10
234	600389	江山股份	56,300	1,098,976.00	0.10
235	688231	隆达股份	29,864	1,096,904.72	0.10
236	301526	国际复材	23,500	1,096,745.00	0.10
237	301087	可孚医疗	23,000	1,095,950.00	0.10
238	688686	奥普特	6,500	1,094,535.00	0.10
239	601211	国泰海通	60,000	1,092,000.00	0.10
240	002990	盛视科技	13,800	1,090,200.00	0.10
241	600877	电科芯片	63,100	1,080,903.00	0.10
242	688239	航宇科技	17,800	1,064,974.00	0.10
243	301376	致欧科技	60,000	1,063,200.00	0.10
244	002056	横店东磁	34,800	1,060,704.00	0.10
245	600114	东睦股份	27,700	1,045,952.00	0.10
246	301200	大族数控	2,900	1,045,885.00	0.10
247	001309	德明利	1,100	1,037,190.00	0.10
248	600499	科达制造	75,000	1,035,000.00	0.10
249	300401	花园生物	47,200	1,033,208.00	0.10
250	603112	华翔股份	61,700	1,032,241.00	0.10
251	002170	芭田股份	94,700	1,028,442.00	0.09

252	002174	游族网络	81,500	1,027,715.00	0.09
253	688798	艾为电子	14,000	1,026,480.00	0.09
254	688333	铂力特	10,000	1,024,000.00	0.09
255	000893	亚钾国际	25,000	1,022,250.00	0.09
256	002204	大连重工	193,200	1,020,096.00	0.09
257	603638	艾迪精密	43,500	1,020,075.00	0.09
258	000657	中钨高新	10,500	1,005,060.00	0.09
259	301391	卡莱特	17,500	999,250.00	0.09
260	688223	晶科能源	209,900	997,025.00	0.09
261	603260	合盛硅业	20,500	989,330.00	0.09
262	300012	华测检测	70,500	977,130.00	0.09
263	603009	北特科技	20,300	973,791.00	0.09
264	603198	迎驾贡酒	32,700	967,920.00	0.09
265	603698	航天工程	25,100	967,856.00	0.09
266	300676	华大基因	27,600	967,656.00	0.09
267	301367	瑞迈特	24,960	964,953.60	0.09
268	000949	新乡化纤	152,200	964,948.00	0.09
269	688561	奇安信	40,100	961,598.00	0.09
270	002318	久立特材	40,000	956,000.00	0.09
271	603995	甬金股份	40,900	949,289.00	0.09
272	688680	海优新材	22,500	945,000.00	0.09
273	002011	盾安环境	89,000	944,290.00	0.09
274	688578	艾力斯	8,640	943,488.00	0.09
275	688166	博瑞医药	26,700	934,767.00	0.09
276	300576	容大感光	18,200	932,204.00	0.09
277	600988	赤峰黄金	35,300	929,096.00	0.09
278	688318	财富趋势	13,000	927,030.00	0.09
279	688376	美埃科技	7,900	918,770.00	0.08
280	688059	DR华锐精	4,600	918,666.00	0.08
281	301398	星源卓镁	25,960	911,455.60	0.08
282	603225	新凤鸣	46,300	909,795.00	0.08

283	688300	联瑞新材	3,700	904,280.00	0.08
284	000059	华锦股份	239,500	898,125.00	0.08
285	603150	万朗磁塑	12,400	877,920.00	0.08
286	300857	协创数据	2,560	870,144.00	0.08
287	688377	迪威尔	36,743	866,399.94	0.08
288	301510	固高科技	27,100	865,303.00	0.08
289	300951	博硕科技	17,100	863,550.00	0.08
290	601601	中国太保	30,000	855,600.00	0.08
291	600397	江钨装备	31,200	849,576.00	0.08
292	688766	普冉股份	1,100	843,260.00	0.08
293	688088	虹软科技	23,400	831,870.00	0.08
294	300957	贝泰妮	26,300	828,713.00	0.08
295	001314	亿道信息	13,400	828,120.00	0.08
296	601168	西部矿业	30,500	827,770.00	0.08
297	000683	博源化工	142,300	819,648.00	0.08
298	300953	震裕科技	6,100	815,570.00	0.08
299	300133	华策影视	113,000	800,040.00	0.07
300	603444	吉比特	2,200	788,524.00	0.07
301	688639	华恒生物	48,300	779,562.00	0.07
302	300861	美畅股份	30,520	768,798.80	0.07
303	301358	湖南裕能	9,900	751,113.00	0.07
304	300409	道氏技术	37,200	741,396.00	0.07
305	002222	福晶科技	8,000	738,240.00	0.07
306	300127	银河磁体	26,200	732,290.00	0.07
307	301095	广立微	6,100	720,105.00	0.07
308	002969	嘉美包装	51,100	719,488.00	0.07
309	688503	聚和材料	5,400	716,580.00	0.07
310	300919	中伟新材	16,300	713,125.00	0.07
311	603185	弘元绿能	42,700	712,663.00	0.07
312	002273	水晶光电	19,800	702,504.00	0.06
313	600489	中金黄金	38,600	696,730.00	0.06

314	300236	上海新阳	5,200	683,800.00	0.06
315	000519	中兵红箭	32,400	682,668.00	0.06
316	300118	东方日升	54,700	681,015.00	0.06
317	002468	申通快递	46,300	674,128.00	0.06
318	300277	汽轮科技	44,600	670,784.00	0.06
319	000534	万泽股份	24,300	664,848.00	0.06
320	002459	晶澳科技	82,000	664,200.00	0.06
321	002824	和胜股份	19,200	663,936.00	0.06
322	300618	寒锐钴业	18,300	653,310.00	0.06
323	603486	科沃斯	12,700	644,525.00	0.06
324	300620	光库科技	1,700	642,940.00	0.06
325	688256	寒武纪	400	638,220.00	0.06
326	002979	雷赛智能	11,400	635,892.00	0.06
327	000034	神州数码	22,900	635,475.00	0.06
328	688676	金盘科技	7,500	634,800.00	0.06
329	603713	密尔克卫	8,900	633,413.00	0.06
330	002299	圣农发展	41,700	632,172.00	0.06
331	301548	崇德科技	7,100	630,267.00	0.06
332	600773	西藏城投	48,900	629,343.00	0.06
333	688020	方邦股份	2,500	624,000.00	0.06
334	688702	盛科通信	1,600	623,984.00	0.06
335	603507	振江股份	18,700	615,043.00	0.06
336	688628	优利德	6,200	613,428.00	0.06
337	600380	健康元	65,100	613,242.00	0.06
338	603013	亚普股份	38,200	603,178.00	0.06
339	002674	兴业科技	21,100	601,983.00	0.06
340	601869	长飞光纤	1,100	600,490.00	0.06
341	300835	龙磁科技	2,600	596,674.00	0.06
342	301153	中科江南	36,600	596,214.00	0.05
343	002111	威海广泰	66,200	595,800.00	0.05
344	600601	方正科技	42,200	584,048.00	0.05

345	301486	致尚科技	2,800	583,296.00	0.05
346	603979	金诚信	9,800	578,494.00	0.05
347	688103	国力电子	7,742	576,082.22	0.05
348	301297	富乐德	9,400	575,656.00	0.05
349	605117	德业股份	5,360	569,124.80	0.05
350	002850	科达利	3,000	567,900.00	0.05
351	002281	光迅科技	2,200	565,268.00	0.05
352	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.05
353	688012	中微公司	1,200	562,200.00	0.05
354	603901	永创智能	51,700	561,979.00	0.05
355	301235	华康洁净	7,400	555,074.00	0.05
356	603530	神马电力	10,800	549,720.00	0.05
357	688197	首药控股	16,300	544,583.00	0.05
358	300759	康龙化成	18,800	543,884.00	0.05
359	688105	诺唯赞	31,190	541,146.50	0.05
360	600338	西藏珠峰	35,400	539,496.00	0.05
361	603379	三美股份	7,100	538,819.00	0.05
362	600765	中航重机	41,700	538,764.00	0.05
363	002532	天山铝业	49,900	535,427.00	0.05
364	605016	百龙创园	20,600	532,510.00	0.05
365	688257	新锐股份	5,220	531,918.00	0.05
366	688568	中科星图	12,800	530,816.00	0.05
367	000426	兴业银锡	16,000	527,360.00	0.05
368	603733	仙鹤股份	19,400	523,994.00	0.05
369	301080	百普赛斯	10,900	523,200.00	0.05
369	300347	泰格医药	10,900	523,200.00	0.05
371	603588	高能环境	27,100	520,320.00	0.05
372	603757	大元泵业	6,800	515,168.00	0.05
373	002268	电科网安	39,800	513,420.00	0.05
374	688100	威胜信息	16,700	510,853.00	0.05
375	603259	药明康德	4,100	510,491.00	0.05

376	001248	华润新能	50,462	510,170.82	0.05
377	688458	美芯晟	12,100	505,296.00	0.05
378	688398	赛特新材	19,500	505,245.00	0.05
379	603025	大豪科技	37,000	504,680.00	0.05
380	688584	上海合晶	14,000	503,300.00	0.05
381	605168	三人行	9,918	502,247.52	0.05
382	000636	风华高科	6,900	498,456.00	0.05
383	300415	伊之密	25,000	497,750.00	0.05
384	300765	石药创新	18,200	495,586.00	0.05
385	002832	比音勒芬	24,000	495,360.00	0.05
386	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.05
387	603712	七一二	38,400	494,976.00	0.05
388	600276	恒瑞医药	9,500	494,380.00	0.05
389	603728	鸣志电器	8,100	493,452.00	0.05
390	600732	爱旭股份	35,600	493,060.00	0.05
391	601975	招商南油	131,700	491,241.00	0.05
392	002324	普利特	40,600	490,042.00	0.05
393	688326	经纬恒润	6,899	489,001.12	0.05
394	301517	陕西华达	9,800	486,374.00	0.04
395	002745	木林森	38,700	485,685.00	0.04
396	688153	唯捷创芯	15,100	485,012.00	0.04
397	688185	康希诺	9,500	484,405.00	0.04
398	688558	国盛智科	14,700	483,042.00	0.04
399	688700	东威科技	5,400	482,760.00	0.04
400	000688	国城矿业	14,100	482,643.00	0.04
401	603057	紫燕食品	21,600	481,680.00	0.04
402	688210	统联精密	11,800	478,018.00	0.04
403	000552	甘肃能化	213,400	478,016.00	0.04
404	002212	天融信	79,800	477,204.00	0.04
405	000792	盐湖股份	15,800	477,002.00	0.04
406	300677	英科医疗	12,100	473,957.00	0.04

407	300587	天铁科技	122,900	473,165.00	0.04
408	000568	泸州老窖	6,100	472,872.00	0.04
409	688098	申联生物	55,000	472,450.00	0.04
410	000729	燕京啤酒	46,600	472,058.00	0.04
411	688311	盟升电子	18,000	471,420.00	0.04
412	600809	山西汾酒	4,300	470,291.00	0.04
413	003025	思进智能	33,400	470,272.00	0.04
414	002073	软控股份	90,700	466,198.00	0.04
415	300394	天孚通信	1,540	466,127.20	0.04
416	688267	中触媒	23,600	464,920.00	0.04
417	603353	和顺石油	12,100	464,882.00	0.04
418	603988	中电电机	28,600	463,892.00	0.04
419	001311	多利科技	28,700	462,931.00	0.04
420	601100	恒立液压	4,300	462,508.00	0.04
421	002045	国光电器	58,900	462,365.00	0.04
422	002615	哈尔斯	67,000	462,300.00	0.04
423	600104	上汽集团	47,300	461,648.00	0.04
424	300624	万兴科技	8,900	461,643.00	0.04
425	301529	福赛科技	4,780	460,600.80	0.04
426	300170	汉得信息	30,200	460,248.00	0.04
427	600552	凯盛科技	14,100	459,378.00	0.04
428	300487	蓝晓科技	7,800	459,030.00	0.04
429	300224	正海磁材	34,400	458,552.00	0.04
430	600785	新华百货	46,760	458,248.00	0.04
431	300663	科蓝软件	68,800	458,208.00	0.04
432	001979	招商蛇口	71,200	457,816.00	0.04
433	600416	湘电股份	46,600	456,680.00	0.04
434	600150	中国船舶	13,500	456,165.00	0.04
435	688039	当虹科技	12,200	455,304.00	0.04
436	601137	博威合金	20,300	453,299.00	0.04
437	688221	前沿生物	20,200	452,480.00	0.04

438	300798	锦鸡股份	69,200	451,876.00	0.04
439	603307	扬州金泉	19,325	451,238.75	0.04
440	688246	嘉和美康	21,900	450,045.00	0.04
441	300920	润阳科技	13,020	449,841.00	0.04
442	601702	华峰铝业	31,900	449,790.00	0.04
443	301227	森鹰窗业	17,800	448,738.00	0.04
444	000338	潍柴动力	16,400	446,900.00	0.04
445	002772	众兴菌业	39,300	446,448.00	0.04
446	002487	大金重工	7,700	446,369.00	0.04
447	002379	宏桥控股	30,200	446,054.00	0.04
448	300407	凯发电气	41,100	443,880.00	0.04
449	300904	威力传动	10,900	442,431.00	0.04
450	301377	鼎泰高科	800	440,720.00	0.04
451	000415	渤海租赁	108,200	440,374.00	0.04
452	603678	火炬电子	5,300	439,900.00	0.04
453	002493	荣盛石化	40,700	437,525.00	0.04
454	600737	中粮糖业	35,300	435,249.00	0.04
455	000801	四川九洲	33,600	434,784.00	0.04
456	688408	中信博	13,500	434,025.00	0.04
457	300679	电连技术	7,100	425,929.00	0.04
458	603816	顾家家居	19,000	424,840.00	0.04
459	300779	惠城环保	8,400	421,680.00	0.04
460	002368	太极股份	30,100	421,099.00	0.04
461	300818	耐普矿机	22,170	419,013.00	0.04
462	000703	恒逸石化	30,700	416,599.00	0.04
463	688018	乐鑫科技	3,180	406,785.60	0.04
464	002833	弘亚数控	20,900	403,161.00	0.04
465	603527	众源新材	33,600	400,512.00	0.04
466	000049	德赛电池	17,100	399,627.00	0.04
467	300769	德方纳米	6,000	399,000.00	0.04
468	688409	富创精密	1,300	398,125.00	0.04

469	688208	道通科技	15,700	395,483.00	0.04
470	603516	淳中科技	2,900	390,369.00	0.04
471	300475	香农芯创	1,300	390,000.00	0.04
472	688146	中船特气	1,100	384,989.00	0.04
473	688690	纳微科技	8,700	383,670.00	0.04
474	000690	宝新能源	80,900	380,230.00	0.04
475	300357	我武生物	16,300	380,116.00	0.04
476	603867	新化股份	11,000	368,390.00	0.03
477	002947	恒铭达	4,700	357,435.00	0.03
478	688048	长光华芯	700	351,400.00	0.03
479	002410	广联达	42,900	350,064.00	0.03
480	600966	博汇纸业	72,500	346,550.00	0.03
481	688615	合合信息	3,040	343,824.00	0.03
482	002716	湖南白银	42,100	340,589.00	0.03
483	300747	锐科激光	6,400	339,776.00	0.03
484	301101	明月镜片	12,400	337,776.00	0.03
485	002335	科华数据	7,900	335,355.00	0.03
486	603236	移远通信	6,500	332,605.00	0.03
487	300684	中石科技	5,400	329,400.00	0.03
488	300131	英唐智控	17,200	327,316.00	0.03
489	300428	立中集团	17,880	325,058.40	0.03
490	002258	利尔化学	25,400	322,834.00	0.03
491	002946	新乳业	22,900	322,432.00	0.03
492	603355	莱克电气	12,200	321,836.00	0.03
493	601619	嘉泽新能	74,600	320,780.00	0.03
494	688121	*ST卓然	49,500	320,760.00	0.03
495	000766	通化金马	16,500	320,100.00	0.03
496	600556	天下秀	71,000	313,820.00	0.03
497	002636	金安国纪	2,600	311,922.00	0.03
498	300685	艾德生物	18,500	311,540.00	0.03
499	300910	瑞丰新材	11,100	311,244.00	0.03

500	688213	思特威	2,900	310,503.00	0.03
501	002345	潮宏基	33,100	303,527.00	0.03
502	002075	沙钢股份	88,300	300,220.00	0.03
503	001914	招商积余	36,100	294,576.00	0.03
504	600353	旭光电子	6,400	291,840.00	0.03
505	688205	德科立	1,400	291,466.00	0.03
506	688158	优刻得	7,900	290,404.00	0.03
507	002922	伊戈尔	8,700	285,360.00	0.03
508	688095	福昕软件	4,800	285,264.00	0.03
509	300671	富满微	3,300	284,328.00	0.03
510	000950	重药控股	56,700	284,067.00	0.03
511	600536	中国软件	10,000	281,200.00	0.03
512	688678	福立旺	11,500	277,955.00	0.03
513	600115	中国东航	72,500	276,225.00	0.03
514	688390	固德威	2,500	271,275.00	0.03
515	688653	康希通信	15,500	269,390.00	0.02
516	002867	周大生	24,100	268,715.00	0.02
517	002929	润建股份	4,000	267,520.00	0.02
518	600339	中油工程	87,100	267,397.00	0.02
519	000156	华数传媒	42,000	265,020.00	0.02
520	688820	盛合晶微	1,855	262,463.95	0.02
521	600038	中直股份	10,200	257,958.00	0.02
522	603599	广信股份	26,900	257,702.00	0.02
523	603093	南华期货	14,000	254,100.00	0.02
524	688543	国科军工	6,437	253,939.65	0.02
525	600741	华域汽车	16,300	252,976.00	0.02
526	605123	派克新材	2,600	252,226.00	0.02
527	600452	涪陵电力	26,700	249,111.00	0.02
528	300693	盛弘股份	5,100	248,625.00	0.02
529	301216	万凯新材	10,700	245,993.00	0.02
530	300363	博腾股份	14,900	241,976.00	0.02

531	300398	飞凯材料	3,900	240,825.00	0.02
532	603127	昭衍新药	6,300	240,786.00	0.02
533	002428	云南锗业	2,000	240,360.00	0.02
534	601865	福莱特	22,700	238,577.00	0.02
535	600486	扬农化工	4,500	228,150.00	0.02
536	300790	宇瞳光学	8,700	227,157.00	0.02
537	600320	振华重工	53,000	218,890.00	0.02
538	002810	山东赫达	8,800	217,360.00	0.02
539	002108	沧州明珠	52,300	216,522.00	0.02
540	688612	威迈斯	7,300	216,007.00	0.02
541	605222	起帆电缆	9,100	212,212.00	0.02
542	300687	赛意信息	6,800	210,800.00	0.02
543	001203	大中矿业	7,000	209,650.00	0.02
544	000969	安泰科技	8,500	208,590.00	0.02
545	688306	均普智能	20,300	205,030.00	0.02
546	600577	精达股份	20,800	203,424.00	0.02
547	002039	黔源电力	10,500	197,610.00	0.02
548	688531	日联科技	1,100	195,624.00	0.02
549	603283	赛腾股份	2,400	194,352.00	0.02
550	002531	天顺风能	22,700	191,361.00	0.02
551	300682	朗新科技	19,000	188,100.00	0.02
552	688416	恒烁股份	1,310	183,400.00	0.02
553	603977	国泰集团	11,100	183,261.00	0.02
554	600246	万通发展	9,600	182,400.00	0.02
555	002158	汉钟精机	4,900	181,692.00	0.02
556	000422	湖北宜化	12,700	178,435.00	0.02
557	688202	美迪西	2,200	177,562.00	0.02
558	688293	奥浦迈	4,100	170,929.00	0.02
559	300182	捷成股份	35,700	169,575.00	0.02
560	001399	惠科股份	6,020	166,934.60	0.02
561	688548	广钢气体	3,200	166,720.00	0.02

562	300852	四会富仕	2,400	166,176.00	0.02
563	002706	良信股份	15,200	165,832.00	0.02
564	301217	铜冠铜箔	1,000	165,070.00	0.02
565	300803	指南针	1,800	165,006.00	0.02
566	002126	银轮股份	3,300	164,340.00	0.02
567	002128	电投能源	7,100	164,152.00	0.02
568	301631	壹连科技	2,200	158,092.00	0.01
569	688155	先惠技术	1,954	158,059.06	0.01
570	000681	视觉中国	7,900	157,526.00	0.01
571	603612	索通发展	8,600	155,918.00	0.01
572	601117	中国化学	20,900	153,615.00	0.01
573	600711	盛屯矿业	14,000	153,580.00	0.01
574	688313	仕佳光子	800	147,720.00	0.01
575	603305	旭升集团	12,100	146,652.00	0.01
576	600316	洪都航空	5,200	145,288.00	0.01
577	002270	华明装备	7,700	145,145.00	0.01
578	000553	安道麦A	26,900	143,915.00	0.01
579	603063	禾望电气	2,700	142,803.00	0.01
580	000589	贵州轮胎	34,700	140,882.00	0.01
581	002701	奥瑞金	31,800	135,468.00	0.01
582	603115	海星股份	1,100	134,717.00	0.01
583	002378	章源钨业	4,000	133,920.00	0.01
584	300702	天宇股份	6,600	133,056.00	0.01
585	300552	万集科技	5,800	132,530.00	0.01
586	000973	佛塑科技	9,200	132,020.00	0.01
587	600746	江苏索普	24,700	129,181.00	0.01
588	000738	航发控制	6,700	122,543.00	0.01
589	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
590	603489	八方股份	4,200	117,432.00	0.01
591	603194	中力股份	3,200	116,992.00	0.01
592	000795	英洛华	13,400	115,910.00	0.01

593	000783	长江证券	11,800	115,050.00	0.01
594	688516	奥特维	2,000	114,780.00	0.01
595	301238	瑞泰新材	4,700	114,680.00	0.01
596	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
597	603890	春秋电子	4,100	113,242.00	0.01
598	603031	安孚科技	2,100	111,825.00	0.01
599	600686	金龙汽车	9,800	110,642.00	0.01
600	002552	宝鼎科技	1,800	109,800.00	0.01
601	600216	浙江医药	9,600	109,440.00	0.01
602	688308	欧科亿	600	109,086.00	0.01
603	688097	博众精工	1,700	107,185.00	0.01
604	688258	卓易信息	900	106,686.00	0.01
605	603876	鼎胜新材	4,100	106,641.00	0.01
606	688699	明微电子	1,300	106,535.00	0.01
607	605499	东鹏饮料	860	106,149.80	0.01
608	300772	运达股份	8,400	103,320.00	0.01
609	300174	元力股份	3,500	102,270.00	0.01
610	300315	掌趣科技	26,200	102,180.00	0.01
611	603738	泰晶科技	1,700	102,085.00	0.01
612	603568	伟明环保	6,600	101,508.00	0.01
613	603416	信捷电气	1,900	100,453.00	0.01
614	300850	新强联	3,700	99,160.00	0.01
615	000880	潍柴重机	4,200	96,642.00	0.01
616	688479	友车科技	2,500	94,925.00	0.01
617	300017	网宿科技	7,200	93,672.00	0.01
618	600391	航发科技	2,800	93,660.00	0.01
619	605167	利柏特	5,800	93,380.00	0.01
620	603806	福斯特	5,500	92,345.00	0.01
621	002006	精工科技	6,100	89,731.00	0.01
622	601339	百隆东方	13,200	89,364.00	0.01
623	002049	紫光国微	1,000	88,750.00	0.01

624	600459	贵研铂业	3,050	88,084.00	0.01
625	600331	宏达股份	8,000	87,920.00	0.01
626	600483	福能股份	8,600	87,634.00	0.01
627	601231	环旭电子	2,700	87,480.00	0.01
628	603337	杰克科技	2,400	86,952.00	0.01
629	600063	皖维高新	11,400	86,640.00	0.01
630	002092	中泰化学	21,900	83,877.00	0.01
631	605133	嵘泰股份	2,100	82,677.00	0.01
632	002064	华峰化学	8,700	82,563.00	0.01
633	688507	索辰科技	300	80,904.00	0.01
634	603619	中曼石油	4,200	78,582.00	0.01
635	603125	常青科技	2,400	78,576.00	0.01
636	601038	一拖股份	7,400	78,366.00	0.01
637	002443	金洲管道	8,100	77,193.00	0.01
638	688321	微芯生物	2,900	76,357.00	0.01
639	002025	航天电器	1,000	76,220.00	0.01
640	003022	联泓新科	2,900	75,110.00	0.01
641	002008	大族激光	500	75,055.00	0.01
642	688301	奕瑞科技	600	74,400.00	0.01
643	603885	吉祥航空	7,100	73,059.00	0.01
644	300319	麦捷科技	2,400	71,112.00	0.01
645	603100	川仪股份	3,800	68,590.00	0.01
646	300454	深信服	700	67,340.00	0.01
647	000581	威孚高科	3,900	66,378.00	0.01
648	688253	英诺特	1,100	66,308.00	0.01
649	301338	凯格精机	400	65,156.00	0.01
650	002068	黑猫股份	4,300	64,629.00	0.01
651	002338	奥普光电	1,100	62,920.00	0.01
652	603533	掌阅科技	3,100	62,899.00	0.01
653	002843	泰嘉股份	2,900	62,263.00	0.01
654	000612	焦作万方	5,800	61,422.00	0.01

655	300740	水羊股份	3,300	60,753.00	0.01
656	603308	应流股份	1,000	60,400.00	0.01
657	300674	宇信科技	4,000	60,200.00	0.01
658	600456	宝钛股份	2,200	60,170.00	0.01
659	600206	有研新材	900	59,940.00	0.01
660	002602	世纪华通	4,100	57,810.00	0.01
661	601069	西部黄金	2,600	57,200.00	0.01
662	002402	和而泰	2,200	56,826.00	0.01
663	600166	福田汽车	19,000	55,290.00	0.01
664	002405	四维图新	8,400	54,348.00	0.01
665	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
666	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
667	300395	菲利华	400	53,492.00	0.00
668	300342	天银机电	1,100	51,700.00	0.00
669	300725	药石科技	1,400	51,240.00	0.00
670	600057	厦门象屿	9,400	50,948.00	0.00
671	688636	智明达	1,400	50,722.00	0.00
672	300378	鼎捷数智	1,400	50,540.00	0.00
673	600328	中盐化工	8,100	48,600.00	0.00
674	002643	万润股份	2,300	48,185.00	0.00
675	605599	菜百股份	3,500	47,950.00	0.00
676	603297	永新光学	300	44,085.00	0.00
677	600596	新安股份	2,700	43,092.00	0.00
678	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
679	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
680	300102	乾照光电	1,500	39,060.00	0.00
681	601886	江河集团	4,800	38,544.00	0.00
682	603936	博敏电子	1,400	37,394.00	0.00
683	300416	苏试试验	1,800	36,684.00	0.00
684	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
685	603919	金徽酒	2,400	36,120.00	0.00

686	688598	金博股份	700	34,615.00	0.00
687	000060	中金岭南	4,500	34,065.00	0.00
688	600933	爱柯迪	2,100	31,038.00	0.00
689	688227	品高股份	300	30,807.00	0.00
690	002043	兔宝宝	2,700	29,916.00	0.00
691	300723	一品红	800	29,824.00	0.00
692	601636	旗滨集团	2,900	29,667.00	0.00
693	688362	甬矽电子	300	28,920.00	0.00
694	688052	纳芯微	100	28,831.00	0.00
695	688658	悦康药业	2,200	28,292.00	0.00
696	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.00
697	301580	爱迪特	400	25,732.00	0.00
698	002967	广电计量	1,400	25,270.00	0.00
699	603039	泛微网络	700	25,249.00	0.00
700	301026	浩通科技	1,200	24,264.00	0.00
701	605358	立昂微	300	23,280.00	0.00
702	002563	森马服饰	4,400	22,176.00	0.00
703	688580	伟思医疗	400	21,308.00	0.00
704	300456	赛微电子	500	21,235.00	0.00
705	300596	利安隆	400	20,992.00	0.00
706	300558	贝达药业	300	19,521.00	0.00
707	301362	民爆光电	100	18,392.00	0.00
708	688633	星球石墨	600	17,838.00	0.00
709	002734	利民股份	1,000	17,170.00	0.00
710	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
711	002821	凯莱英	100	16,200.00	0.00
712	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
713	600110	诺德股份	1,000	15,090.00	0.00
714	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
715	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
716	301589	诺瓦星云	100	14,898.00	0.00

717	002585	双星新材	1,200	14,880.00	0.00
718	600498	烽火通信	200	14,720.00	0.00
719	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
720	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
721	301171	易点天下	400	13,584.00	0.00
722	688787	海天瑞声	100	13,445.00	0.00
723	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
724	603708	家家悦	1,500	12,870.00	0.00
725	688345	博力威	200	11,616.00	0.00
726	603989	艾华集团	200	10,500.00	0.00
727	002841	视源股份	300	10,359.00	0.00
728	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
729	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
730	600970	中材国际	1,400	9,982.00	0.00
731	603077	和邦生物	4,000	9,280.00	0.00
732	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
733	002140	东华科技	500	4,585.00	0.00
734	688182	灿勤科技	83	3,574.81	0.00
735	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
736	688520	神州细胞	83	2,839.43	0.00
737	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
738	688128	中国电研	95	2,255.30	0.00
739	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
740	002987	京北方	105	1,021.65	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	002180	奔图科技	67,018,507.00	6.08
2	002928	华夏航空	39,830,898.00	3.61
3	000975	山金国际	36,377,467.76	3.30
4	002991	甘源食品	31,727,995.00	2.88
5	688232	新点软件	29,815,199.37	2.70
6	002271	东方雨虹	29,127,205.00	2.64
7	001301	尚太科技	28,721,048.00	2.61
8	600323	瀚蓝环境	28,320,106.00	2.57
9	301358	湖南裕能	24,984,077.46	2.27
10	300308	中际旭创	23,730,434.00	2.15
11	601528	瑞丰银行	20,937,824.00	1.90
12	300855	图南股份	20,307,530.00	1.84
13	300373	扬杰科技	19,100,619.00	1.73
14	002419	天虹股份	19,019,440.00	1.73
15	301039	中集车辆	18,470,291.64	1.68
16	300738	奥飞数据	17,791,892.59	1.61
17	300502	新易盛	17,396,627.00	1.58
18	603345	安井食品	17,396,413.00	1.58
19	688484	南芯科技	16,986,704.97	1.54
20	000695	滨海能源	16,915,476.00	1.53

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002180	奔图科技	108,410,073.46	9.83
2	688232	新点软件	108,123,188.44	9.81
3	002541	鸿路钢构	85,205,402.35	7.73
4	301035	润丰股份	80,733,783.15	7.32

5	300855	图南股份	71,750,457.19	6.51
6	603658	安图生物	70,315,126.79	6.38
7	603345	安井食品	67,269,874.05	6.10
8	688029	南微医学	56,406,078.38	5.12
9	002991	甘源食品	46,420,811.50	4.21
10	002928	华夏航空	42,248,174.00	3.83
11	301358	湖南裕能	28,769,195.36	2.61
12	002271	东方雨虹	24,852,196.00	2.25
13	300373	扬杰科技	23,546,056.19	2.14
14	600487	亨通光电	20,091,918.00	1.82
15	688484	南芯科技	16,958,123.18	1.54
16	002419	天虹股份	16,564,194.00	1.50
17	301061	匠心家居	15,999,143.98	1.45
18	301239	普瑞眼科	15,746,691.00	1.43
19	300308	中际旭创	14,969,656.60	1.36
20	600522	中天科技	14,880,120.58	1.35

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,825,495,421.07
卖出股票收入（成交）总额	4,021,622,048.81

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,314,769.86	2.79
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	421,020.49	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	30,735,790.35	2.83

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019792	25国债19	300,000	30,314,769.86	2.79
2	113704	春风转债	3,200	320,014.73	0.03
3	118070	南芯转债	1,010	101,005.76	0.01

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

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

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的。通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，采用流动性好、交易活跃的合约品种，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，以达到降低投资组合整体风险的目的。

本基金还将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲市场系统性风险、大额申购赎回等特殊情形下的流动性风险。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有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	6,308,934.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,308,934.12

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项目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

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
29,364	11,672.23	12,471,363.82	3.64%	330,271,969.31	96.36%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	96.51%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,323,236.34	0.68%

8.4 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年04月03日)基金份额总额	3,267,113,946.25
本报告期期初基金份额总额	402,521,964.95
本报告期基金总申购份额	92,254,667.78
减：本报告期基金总赎回份额	152,033,299.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	342,743,333.13

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，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生涉及本基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	中庚基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年04月03日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚
受到的具体措施类型	责令改正、没收违法所得、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（投资顾问业务）
受到处罚的依据	《中华人民共和国证券投资基金法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改
其他	无

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

管理人相关从业人员受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	四名高级管理人员
受到调查或处罚等措施的时间	2026年04月03日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚
受到的具体措施类型	均警告和罚款
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（投资顾问业务）
受到处罚的依据	《中华人民共和国证券投资基金法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改
其他	无

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	3	7,844,698,678.61	100.00%	3,473,346.67	100.00%	-

注：1.根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）的有关规定，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。

2.本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务能力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

3.本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

4.报告期内，本基金通过广发证券的专用交易单元进行场内证券交易，无其他新增或停止使用的交易单元。

5.本基金选择的证券经纪商广发证券与本公司不存在关联关系。

6.本基金管理人将根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告[2024]3号）及证券业协会测算结果完成佣金动态调整工作。

10.7.2 基金租用或者通过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
广发证券	167,237,312.55	100.00%	3,769,207,000.00	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	中庚基金管理有限公司关于调整旗下基金风险等级的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2026-01-07
2	中庚基金管理有限公司关于调整旗下开放式基金首次最低申购金额、最低赎回份额和最低持有份额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2026-01-07
3	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2025年第四季度报	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-01-20

	告提示性公告		
4	中庚小盘价值股票型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-01-20
5	中庚小盘价值股票型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2026-01-23
6	中庚小盘价值股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-01-28
7	中庚小盘价值股票型证券投资基金更新招募说明书（2026年第1号）	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-01-28
8	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2025年年度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-03-25
9	中庚小盘价值股票型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-03-25
10	中庚基金管理有限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（2025年度）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、中国证监会基金信息披露规定网站	2026-03-27
11	中庚小盘价值股票型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、中国证监会基金信息披露规定网站	2026-04-17
12	中庚基金管理有限公司旗下全部基金2026年第一季度报告提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026-04-21
13	中庚小盘价值股票型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-04-21
14	中庚小盘价值股票型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-04-22
15	中庚小盘价值股票型证券投资基金更新招募说明书（2026年第2号）	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-04-22

16	2025年度中庚基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会基金信息披露规定网站	2026-04-27
----	---	-----------------	------------

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金管理人2026年1月7日发布的《中庚基金管理有限公司关于调整旗下基金风险等级的公告》，自2026年1月14日起，本基金的风险等级由R3调整为R4。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准设立中庚小盘价值股票型证券投资基金的文件
- 2.中庚小盘价值股票型证券投资基金基金合同
- 3.中庚小盘价值股票型证券投资基金招募说明书
- 4.中庚小盘价值股票型证券投资基金托管协议
- 5.中庚小盘价值股票型证券投资基金基金产品资料概要
- 6.中庚基金管理有限公司业务资格批复、营业执照和公司章程
- 7.报告期内中庚小盘价值股票型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告
- 8.中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦703-704

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。
投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人。
客服电话：021-53549999
公司网址：www.zgffunds.com.cn

中庚基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日