

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券
投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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	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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60

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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 盈利投资者数量占比	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	64
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	64
10.8 其他重大事件	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
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	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金	
基金简称	中航量化阿尔法六个月持有	
基金主代码	011934	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 8 月 25 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	50,815,215.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
下属分级基金的交易代码	011934	011935
报告期末下属分级基金的份额总额	16,576,877.36 份	34,238,337.87 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以数量化分析为基础，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。
投资策略	（一）资产配置策略 （二）股票投资策略：（1）多因子模型（2）事件驱动模型 （三）债券投资策略 （四）股指期货投资策略 （五）国债期货投资策略 （六）资产支持证券投资策略 （七）存托凭证投资策略 （八）可转换债券及可交换债券投资策略
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中航基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	宋鑫	张姗
	联系电话	010-56716167	400-61-95555
	电子邮箱	songxin@avicfund.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-666-2186	400-61-95555
传真		010-56716198	0755-83195201

注册地址	北京市石景山区五一剧场南路 2 号院 1 号楼 7 层 702E	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	杨彦伟	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中航基金管理有限公司	北京市朝阳区天辰东路 1 号院 亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
据和指标	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
本期已实现收益	2,821,185.89	6,706,460.58
本期利润	5,606,354.62	12,380,864.33
加权平均基金份额本期利润	0.3166	0.2900
本期加权平均净值利润率	26.19%	24.69%
本期基金份额净值增长率	28.44%	28.06%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
据和指标		
期末可供分配利润	5,178,174.77	9,414,276.56
期末可供分配基金份额利润	0.3124	0.2750

期末基金资产净值	23,729,625.27	47,604,463.77
期末基金份额净值	1.4315	1.3904
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	43.15%	39.04%

注：①本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

②期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

③本基金所述业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中航量化阿尔法六个月持有 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	24.13%	1.77%	15.90%	1.40%	8.23%	0.37%
过去六个月	28.44%	1.62%	18.16%	1.41%	10.28%	0.21%
过去一年	61.59%	1.34%	44.10%	1.21%	17.49%	0.13%
过去三年	66.92%	1.41%	45.76%	1.26%	21.16%	0.15%
自基金合同生效起至今	43.15%	1.29%	28.35%	1.16%	14.80%	0.13%

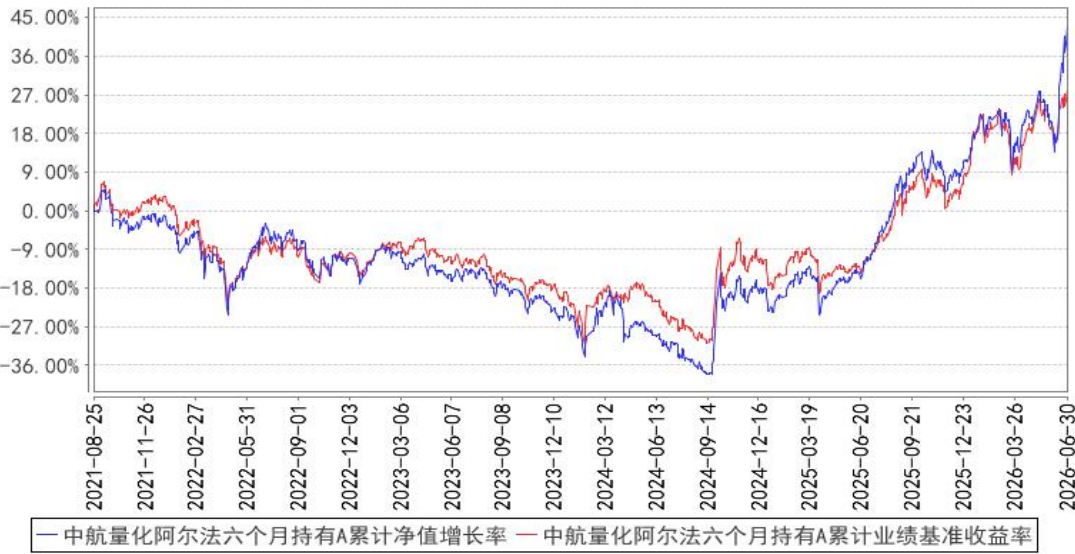
中航量化阿尔法六个月持有 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	23.94%	1.77%	15.90%	1.40%	8.04%	0.37%
过去六个月	28.06%	1.62%	18.16%	1.41%	9.90%	0.21%
过去一年	60.61%	1.34%	44.10%	1.21%	16.51%	0.13%

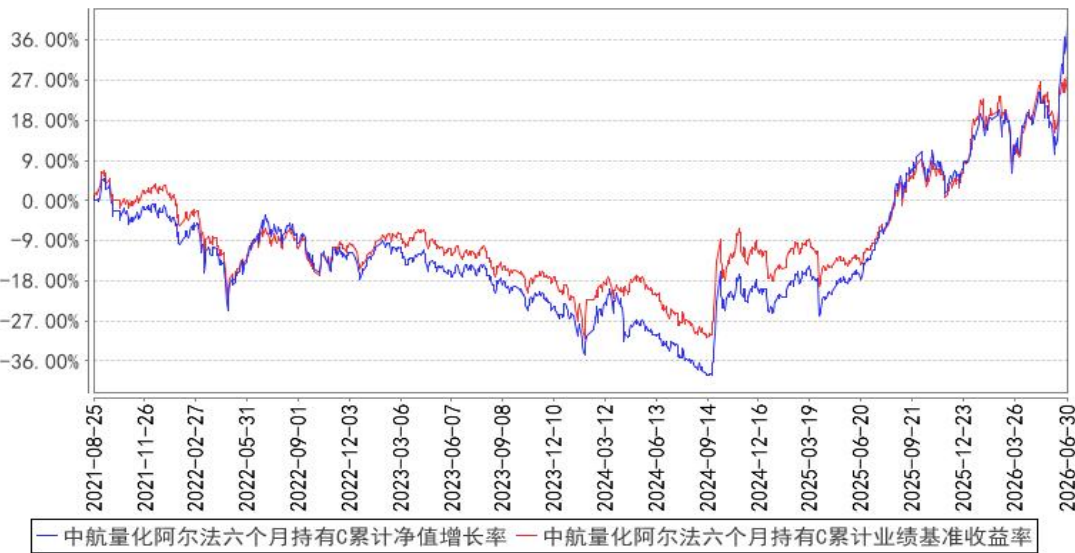
过去三年	63.94%	1.41%	45.76%	1.26%	18.18%	0.15%
自基金合同生效起 至今	39.04%	1.29%	28.35%	1.16%	10.69%	0.13%

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

中航量化阿尔法六个月持有A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中航量化阿尔法六个月持有C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中航基金管理有限公司成立于 2016 年 6 月 16 日，是经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]1249 号文许可批准设立、为客户提供专业基金管理服务的全中国基金管理人公司。公司总部设在北京，注册本金为 30,000 万元人民币，经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	本基金的基金经理	2021 年 8 月 25 日	-	16 年	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部总经理，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。
杨扬	本基金的基金经理	2021 年 9 月 16 日	-	15 年	硕士研究生，具有 10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于上海东方证券资产管理有限公司担任研究员、投资助理、安信基金管理有限责任公司先后担任投资经理助理、投资经理、基金经理助理、基金经理。2020 年 2 月加入中航基金管理有限公司，现担任量化投资部基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度。在统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控，公平对待旗下管理的所有投资组合。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，A 股呈现“指数震荡上行、结构极致分化”格局：上证指数涨 3.16%，深证成指涨 19.82%，创业板指涨 35.58%，科创 50 大涨 64.25%。全市场资金高度向 AI 算力、半导体、通信设备、PCB 等硬科技产业链集中，电子、通信行业表现居前，消费、地产、金融及传统蓝筹相对偏弱，市场呈典型“K 型分化”。

本基金主要通过量化多因子选股模型进行组合构建，在因子筛选上侧重行业景气度与盈利边际改善，在高端制造和科技成长方向适度超配。运作中充分发挥量化研究在标的覆盖广度与市场信息反应时效性上的优势，动态跟踪因子有效性变化，及时捕捉定价偏差与个股 alpha 机会，力求在控制跟踪误差的前提下获取超越业绩比较基准的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值为 1.4315 元,本报告期基金份额净值增长率为 28.44%;截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值为 1.3904 元,本报告期基金份额净值增长率为 28.06%;同期业绩比较基准收益率为 18.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年, A 股有望延续结构性行情, 科技成长仍是市场关注的主线, 景气度具备产业趋势支撑。不过经历上半年显著上涨, 部分细分板块估值与交易拥挤度明显抬升, 行情将从单纯的主题驱动逐步转向业绩兑现与验证, “去伪存真”成为关键。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定, 日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行, 基金份额净值由基金管理人完成估值后, 经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会, 委员由投资研究、交易、基金事务、风险管理、合规等部门负责人组成, 负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经历。报告期内, 投资研究部门负责人同时兼任基金经理、估值委员, 基金经理参加估值专业委员会会议, 但不介入基金日常估值业务; 参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突; 与估值相关的机构包括但不限于上海、深圳证券交易所, 中国证券登记结算有限责任公司, 中央国债登记结算公司, 中证指数有限公司以及中国证券投资基金业协会等。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定, 结合本基金实际运作情况, 本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度, 我行在履行托管职责中, 严格遵守有关法律法规、托管协议的规定, 尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款, 对托管产品的投资行为进行监督,

并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	5,215,695.19	8,734,530.65
结算备付金		820,139.73	715,638.24
存出保证金		23,034.98	37,699.44
交易性金融资产	6.4.7.2	66,783,832.38	80,792,396.90
其中：股票投资		66,783,832.38	80,792,396.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		2,173,554.03	4,873,775.78
应收股利		-	-
应收申购款		18,988.95	3,165.62
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		75,035,245.26	95,157,206.63
负债和净资产	附注号	本期末 2026年6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		3,168,616.86	1,204,673.63
应付赎回款		134,992.89	3,908,154.51
应付管理人报酬		63,006.58	97,798.57
应付托管费		10,501.09	16,299.76
应付销售服务费		21,212.76	33,090.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	302,826.04	220,890.53
负债合计		3,701,156.22	5,480,907.31
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	50,815,215.23	81,939,769.53
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	20,518,873.81	7,736,529.79
净资产合计		71,334,089.04	89,676,299.32
负债和净资产总计		75,035,245.26	95,157,206.63

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.4315 元，C 类基金份额净值 1.3904 元；基金份额总额 50,815,215.23 份， 下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 16,576,877.36 份，C 类基金份额总额 34,238,337.87 份。

6.2 利润表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		18,706,079.21	16,330,463.46
1. 利息收入		11,140.56	26,036.24
其中：存款利息收入	6.4.7.13	11,140.56	26,036.24
债券利息收入		-	-
资产支持证券利		-	-

息收入			
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,235,366.17	9,818,065.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,950,582.02	8,574,600.98
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	284,784.15	1,243,464.60
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	8,459,572.48	6,486,361.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		718,860.26	1,438,353.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	427,804.28	902,038.09
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	71,300.64	150,339.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	149,993.05	320,462.76
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	69,762.29	65,512.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,987,218.95	14,892,110.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,987,218.95	14,892,110.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		17,987,218.95	14,892,110.37

6.3 净资产变动表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	81,939,769.53	-	7,736,529.79	89,676,299.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	81,939,769.53	-	7,736,529.79	89,676,299.32
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-31,124,554.30	-	12,782,344.02	-18,342,210.28
（一）、综合收益总额	-	-	17,987,218.95	17,987,218.95
（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）	-31,124,554.30	-	-5,204,874.93	-36,329,429.23
其中：1. 基金申购款	4,931,680.31	-	1,022,223.68	5,953,903.99
2. 基金赎回款	-36,056,234.61	-	-6,227,098.61	-42,283,333.22
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	50,815,215.23	-	20,518,873.81	71,334,089.04
项目	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	194,091,611.01	-	-40,751,016.61	153,340,594.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	194,091,611.01	-	-40,751,016.61	153,340,594.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-19,587,290.05	-	18,278,125.12	-1,309,164.93
（一）、综合收益总额	-	-	14,892,110.37	14,892,110.37
（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）	-19,587,290.05	-	3,386,014.75	-16,201,275.30
其中：1. 基金申购款	2,877,392.08	-	-499,061.70	2,378,330.38
2. 基金赎回款	-22,464,682.13	-	3,885,076.45	-18,579,605.68
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	174,504,320.96	-	-22,472,891.49	152,031,429.47

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：

裴荣荣

裴荣荣

韩丹

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]857 号文《关于准予中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金注册的批复》，由中航基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）等规定公开募集。经向中国证监会备案，于 2021 年 8 月 25 日募集成立。本基金的基金管理人为中航基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。基金合同生效日总计认购户数 2,779 户，确认的有效认购金额为 329,106,493.46 元，实收基金份额为 329,173,593.39 份（含利息转份额 67,099.93 份）。其中：A 类份额认购户数 985 户，确认的有效认购金额为 74,890,736.46 元，实收基金份额为 74,904,100.76 份（含利息转份额 13,364.30 份）；C 类份额认购户数 1,794 户，确认的有效认购金额为 254,215,757.00 元，实收基金份额为 254,269,492.63 份（含利息转份额 53,735.63 份）；本基金募集资金经天职会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《公开募集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>》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基

金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

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

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期本基金所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本报告期本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、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【2004】78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税明电【2008】2 号《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》、财税【2008】1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 09 月 18 日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85 号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【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》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 2027 年 12 月 31 日前，契约制基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税；
2. 基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；

3. 2027 年 12 月 31 日前，对基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的差价收入免征增值税；
4. 2027 年 12 月 31 日前，存款利息收入不征收增值税，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。
5. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；
6. 基金取得的股票股息、红利收入，自 2015 年 9 月 8 日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；
7. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；
8. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	5,215,695.19
等于：本金	5,215,230.28
加：应计利息	464.91
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	5,215,695.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		58,043,405.25	-	66,783,832.38	8,740,427.13
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		58,043,405.25	-	66,783,832.38	8,740,427.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期本基金未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	235,879.57
其中：交易所市场	235,879.57
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	66,946.47
合计	302,826.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,738,160.42	24,738,160.42
本期申购	4,245,743.52	4,245,743.52
本期赎回（以“-”号填列）	-12,407,026.58	-12,407,026.58
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	16,576,877.36	16,576,877.36
-----	---------------	---------------

中航量化阿尔法六个月持有 C

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,201,609.11	57,201,609.11
本期申购	685,936.79	685,936.79
本期赎回（以“-”号填列）	-23,649,208.03	-23,649,208.03
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	34,238,337.87	34,238,337.87

注：本期申购包含基金红利再投、转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,902,584.95	-1,070,115.33	2,832,469.62
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,902,584.95	-1,070,115.33	2,832,469.62
本期利润	2,821,185.89	2,785,168.73	5,606,354.62
本期基金份额交易产生的变动数	-1,545,596.07	259,519.74	-1,286,076.33
其中：基金申购款	1,067,936.83	-181,346.28	886,590.55
基金赎回款	-2,613,532.90	440,866.02	-2,172,666.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,178,174.77	1,974,573.14	7,152,747.91

中航量化阿尔法六个月持有 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,323,013.29	-2,418,953.12	4,904,060.17
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	7,323,013.29	-2,418,953.12	4,904,060.17
本期利润	6,706,460.58	5,674,403.75	12,380,864.33
本期基金份额交易产	-4,615,197.31	696,398.71	-3,918,798.60

生的变动数			
其中：基金申购款	149,377.17	-13,744.04	135,633.13
基金赎回款	-4,764,574.48	710,142.75	-4,054,431.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,414,276.56	3,951,849.34	13,366,125.90

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	9,970.89
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,116.95
其他	52.72
合计	11,140.56

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,950,582.02
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	9,950,582.02

6.4.7.14.2 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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	550,389,316.31
减：卖出股票成本总额	539,622,152.22
减：交易费用	816,582.07
买卖股票差价收入	9,950,582.02

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	284,784.15
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	284,784.15

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	8,459,572.48
股票投资	8,459,572.48
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	8,459,572.48

6.4.7.21 其他收入

本报告期本基金无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
其他	0.15
银行划款费	2,815.67
合计	69,762.29

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中航基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
中航证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生与关联方的佣金费用，期末无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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	427,804.28	902,038.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	210,942.53	443,427.62
应支付基金管理人的净管理费	216,861.75	458,610.47

注：①计提标准：本基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计算。

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

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	71,300.64	150,339.66

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%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

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	合计
招商银行股份有限公司	-	146,272.41	146,272.41
中航基金管理有限公司	-	34.85	34.85
中航证券有限公司	-	1,662.92	1,662.92
合计	-	147,970.18	147,970.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C	合计
招商银行股份有限公司	-	313,189.28	313,189.28
中航基金管理有限公司	-	24.12	24.12
中航证券有限公司	-	6,498.71	6,498.71
合计	-	319,712.11	319,712.11

注：①计提标准：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.60%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划款指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金均无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	5,670,455.46	11,140.56	13,292,976.34	26,036.24

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本报告期本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

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
601369	陕鼓动力	2026 年 06 月 29	重大事项停牌	9.05	2026 年 07 月 13	9.96	1,000	8,996.00	9,050.00	-

		日			日					
688072	拓荆科技	2026 年 06 月 29 日	重大 事项 停牌	879.53	2026 年 07 月 13 日	890.99	2,089	1,359,283.55	1,837,338.17	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目的是在严格控制风险的前提下，力求实现基金资产的长期稳定增长的投资目标。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去评估各种风险发生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

董事会对公司风险管理负有最终责任，董事会下设合规及风险管理委员会与督察长。合规及风险管理委员会主要负责审核和指导公司的风险管理政策，对公司的整体风险水平、风险控制措施的实施情况进行评价。督察长负责组织指导公司监察稽核工作，监督检查受托资产和公司运作的合法合规情况及公司内部风险控制情况。

经营管理层负责风险管理政策、风险控制措施的制定和落实，经营管理层下设风险控制委员会。风险控制委员会主要负责审议风险管理制度和流程，处置重大风险事件，促进风险管理文化的形成。

监察稽核部和风险管理部是公司内部控制的职能部门。各职能部门负责从经营管理的各环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风

险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的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。基金的货币资金存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该货币资金相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险事件发生的可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额(若有)将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,215,695.19	-	-	-	5,215,695.19
结算备付金	820,139.73	-	-	-	820,139.73
存出保证金	23,034.98	-	-	-	23,034.98
交易性金融资产	-	-	-	66,783,832.38	66,783,832.38
应收申购款	-	-	-	18,988.95	18,988.95
应收清算款	-	-	-	2,173,554.03	2,173,554.03
资产总计	6,058,869.90	-	-	68,976,375.36	75,035,245.26
负债					
应付赎回款	-	-	-	134,992.89	134,992.89
应付管理人报酬	-	-	-	63,006.58	63,006.58
应付托管费	-	-	-	10,501.09	10,501.09
应付清算款	-	-	-	3,168,616.86	3,168,616.86
应付销售服务费	-	-	-	21,212.76	21,212.76
其他负债	-	-	-	302,826.04	302,826.04
负债总计	-	-	-	3,701,156.22	3,701,156.22

利率敏感度缺口	6,058,869.90	-	-	65,275,219.14	71,334,089.04
上年度末 2025 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	8,734,530.65	-	-	-	8,734,530.65
结算备付金	715,638.24	-	-	-	715,638.24
存出保证金	37,699.44	-	-	-	37,699.44
交易性金融资产	-	-	-	80,792,396.90	80,792,396.90
应收申购款	-	-	-	3,165.62	3,165.62
应收清算款	-	-	-	4,873,775.78	4,873,775.78
资产总计	9,487,868.33	-	-	85,669,338.30	95,157,206.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,908,154.51	3,908,154.51
应付管理人报酬	-	-	-	97,798.57	97,798.57
应付托管费	-	-	-	16,299.76	16,299.76
应付清算款	-	-	-	1,204,673.63	1,204,673.63
应付销售服务费	-	-	-	33,090.31	33,090.31
其他负债	-	-	-	220,890.53	220,890.53
负债总计	-	-	-	5,480,907.31	5,480,907.31
利率敏感度缺口	9,487,868.33	-	-	80,188,430.99	89,676,299.32

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或资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.00%（2025 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（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。

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 6 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	66,783,832.38	93.62	80,792,396.90	90.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	66,783,832.38	93.62	80,792,396.90	90.09

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（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	3,717,348.99	4,521,251.22
	业绩比较基准下降5%	-3,717,348.99	-4,521,251.22

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	64,937,444.21	80,105,435.00
第二层次	1,846,388.17	582,434.12
第三层次	-	104,527.78
合计	66,783,832.38	80,792,396.90

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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。
--

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	66,783,832.38	89.00
	其中：股票	66,783,832.38	89.00
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,035,834.92	8.04
8	其他各项资产	2,215,577.96	2.95
9	合计	75,035,245.26	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	18,643.00	0.03
B	采矿业	565,485.00	0.79
C	制造业	60,442,192.37	84.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	234,451.00	0.33
E	建筑业	125,916.00	0.18
F	批发和零售业	1,699,443.30	2.38
G	交通运输、仓储和邮政业	138,381.00	0.19
H	住宿和餐饮业	10,857.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,340,872.11	3.28
J	金融业	733,379.60	1.03
K	房地产业	33,847.00	0.05
L	租赁和商务服务业	102,413.00	0.14
M	科学研究和技术服务业	190,342.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	72,705.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	10,455.00	0.01
Q	卫生和社会工作	19,500.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	37,924.00	0.05
S	综合	7,026.00	0.01
	合计	66,783,832.38	93.62

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	1,600	2,032,000.00	2.85

2	688525	佰维存储	3,850	1,904,710.50	2.67
3	688072	拓荆科技	2,089	1,837,338.17	2.58
4	600601	方正科技	123,900	1,714,776.00	2.40
5	688012	中微公司	3,456	1,619,136.00	2.27
6	603986	兆易创新	1,900	1,548,500.00	2.17
7	001309	德明利	1,600	1,508,640.00	2.11
8	301308	江波龙	2,100	1,477,980.00	2.07
9	688110	东芯股份	7,190	1,464,603.00	2.05
10	688498	源杰科技	751	1,416,386.00	1.99
11	300223	北京君正	5,500	1,368,950.00	1.92
12	688266	泽璟制药-U	11,439	1,334,473.74	1.87
13	300723	一品红	34,900	1,301,072.00	1.82
14	300475	香农芯创	4,300	1,290,000.00	1.81
15	688766	普冉股份	1,666	1,277,155.60	1.79
16	000988	华工科技	6,900	1,273,809.00	1.79
17	688620	安凯微	78,021	1,263,940.20	1.77
18	300438	鹏辉能源	15,000	1,242,750.00	1.74
19	300014	亿纬锂能	18,100	1,177,043.00	1.65
20	002384	东山精密	4,200	1,101,870.00	1.54
21	300613	富瀚微	13,700	1,097,096.00	1.54
22	300042	朗科科技	14,300	1,089,231.00	1.53
23	300953	震裕科技	8,000	1,069,600.00	1.50
24	301536	星辰科技	7,900	1,016,809.00	1.43
25	601138	工业富联	13,800	995,670.00	1.40
26	002463	沪电股份	6,500	993,200.00	1.39
27	300458	全志科技	25,000	986,500.00	1.38
28	301238	瑞泰新材	40,300	983,320.00	1.38
29	688416	恒烁股份	6,424	899,360.00	1.26
30	603026	石大胜华	9,800	875,826.00	1.23
31	688778	厦钨新能	15,026	817,414.40	1.15
32	600183	生益科技	4,700	814,980.00	1.14
33	301662	宏工科技	8,035	814,106.20	1.14
34	301261	恒工精密	9,600	749,760.00	1.05
35	300073	当升科技	15,100	725,404.00	1.02
36	300750	宁德时代	1,800	707,418.00	0.99
37	301150	中一科技	10,300	650,033.00	0.91
38	688008	澜起科技	2,097	649,860.30	0.91
39	688155	先惠技术	7,720	624,470.80	0.88
40	301191	菲菱科思	5,200	590,460.00	0.83
41	603083	剑桥科技	1,900	484,253.00	0.68
42	688559	海目星	5,061	424,719.12	0.60
43	002281	光迅科技	1,300	334,022.00	0.47
44	688102	斯瑞新材	6,970	328,844.60	0.46

45	301511	德福科技	2,100	302,085.00	0.42
46	300620	光库科技	700	264,740.00	0.37
47	300718	长盛轴承	4,300	262,171.00	0.37
48	688320	禾川科技	6,217	257,694.65	0.36
49	605100	华丰股份	6,100	246,562.00	0.35
50	002156	通富微电	3,200	242,784.00	0.34
51	603663	三祥新材	2,500	240,750.00	0.34
52	603906	龙蟠科技	9,000	238,770.00	0.33
53	601777	千里科技	28,000	228,480.00	0.32
54	603728	鸣志电器	3,600	219,312.00	0.31
55	300488	恒锋工具	4,600	215,418.00	0.30
56	688197	首药控股-U	6,358	212,420.78	0.30
57	688205	德科立	999	207,981.81	0.29
58	688220	翱捷科技-U	1,667	207,241.44	0.29
59	688385	复旦微电	2,862	204,031.98	0.29
60	688449	联芸科技	2,311	199,462.41	0.28
61	688629	华丰科技	1,030	193,135.30	0.27
62	301263	泰恩康	9,300	190,557.00	0.27
63	002465	海格通信	14,900	190,273.00	0.27
64	301617	博苑股份	3,200	188,320.00	0.26
65	688553	汇宇制药-W	17,696	188,108.48	0.26
66	688331	荣昌生物	1,390	181,061.40	0.25
67	688192	迪哲医药-U	4,489	179,245.77	0.25
68	688256	寒武纪	112	178,701.60	0.25
69	300672	国科微	600	177,000.00	0.25
70	603659	璞泰来	6,100	176,473.00	0.25
71	688321	微芯生物	6,640	174,831.20	0.25
72	688037	芯源微	395	173,424.75	0.24
73	688578	艾力斯	1,583	172,863.60	0.24
74	688183	生益电子	1,289	170,663.60	0.24
75	002294	信立泰	5,300	169,017.00	0.24
76	300455	航天智装	7,800	168,012.00	0.24
77	688017	绿的谐波	402	167,979.72	0.24
78	688392	骄成超声	735	166,977.30	0.23
79	600206	有研新材	2,400	159,840.00	0.22
80	688235	百济神州	597	152,002.17	0.21
81	688333	铂力特	1,444	147,865.60	0.21
82	300457	赢合科技	7,000	147,560.00	0.21
83	600487	亨通光电	1,300	142,142.00	0.20
84	688062	迈威生物-U	4,833	136,532.25	0.19
85	600879	航天电子	6,300	134,127.00	0.19
86	002335	科华数据	3,000	127,350.00	0.18
87	688116	天奈科技	3,290	125,678.00	0.18

88	688702	盛科通信-U	322	125,576.78	0.18
89	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.17
90	600699	均胜电子	5,700	123,177.00	0.17
91	300969	恒帅股份	1,300	121,888.00	0.17
92	300502	新易盛	200	121,400.00	0.17
93	601318	中国平安	2,500	119,350.00	0.17
94	002262	恩华药业	6,300	118,125.00	0.17
95	300007	汉威科技	3,000	114,600.00	0.16
96	002940	昂利康	4,000	105,640.00	0.15
97	300604	长川科技	300	102,426.00	0.14
98	601899	紫金矿业	3,900	98,046.00	0.14
99	000333	美的集团	1,200	90,636.00	0.13
100	002008	大族激光	600	90,066.00	0.13
101	688347	华虹公司	261	87,774.30	0.12
102	002475	立讯精密	1,200	84,480.00	0.12
103	688120	华海清科	245	78,934.10	0.11
104	600900	长江电力	2,900	76,763.00	0.11
105	688981	中芯国际	475	75,439.50	0.11
106	603259	药明康德	600	74,706.00	0.10
107	000725	京东方 A	8,600	74,648.00	0.10
108	688041	海光信息	200	74,060.00	0.10
109	300666	江丰电子	200	73,720.00	0.10
110	688200	华峰测控	135	70,888.50	0.10
111	300857	协创数据	200	67,980.00	0.10
112	600030	中信证券	2,300	66,079.00	0.09
113	688409	富创精密	200	61,250.00	0.09
114	300059	东方财富	3,000	61,140.00	0.09
115	002353	杰瑞股份	400	61,000.00	0.09
116	600549	厦门钨业	700	59,640.00	0.08
117	000657	中钨高新	600	57,432.00	0.08
118	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.08
119	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.08
120	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.08
121	300054	鼎龙股份	500	52,985.00	0.07
122	002484	江海股份	500	52,500.00	0.07
123	000636	风华高科	700	50,568.00	0.07
124	300408	三环集团	300	50,070.00	0.07
125	688630	芯碁微装	82	45,049.98	0.06
126	002080	中材科技	500	45,000.00	0.06
127	000021	深科技	700	44,989.00	0.06
128	600176	中国巨石	600	43,728.00	0.06
129	002202	金风科技	1,800	43,020.00	0.06
130	601208	东材科技	600	42,474.00	0.06

131	000651	格力电器	1,100	41,250.00	0.06
132	300395	菲利华	300	40,119.00	0.06
133	002185	华天科技	1,700	37,927.00	0.05
134	300390	天华新能	400	37,404.00	0.05
135	301526	国际复材	800	37,336.00	0.05
136	688372	伟测科技	200	37,200.00	0.05
137	600150	中国船舶	1,100	37,169.00	0.05
138	688002	睿创微纳	240	37,125.60	0.05
139	300346	南大光电	400	37,060.00	0.05
140	000858	五粮液	500	37,000.00	0.05
141	688313	仕佳光子	200	36,930.00	0.05
142	002222	福晶科技	400	36,912.00	0.05
143	603993	洛阳钼业	2,100	36,855.00	0.05
144	600522	中天科技	600	36,408.00	0.05
145	300394	天孚通信	120	36,321.60	0.05
146	301200	大族数控	100	36,065.00	0.05
147	600887	伊利股份	1,500	35,940.00	0.05
148	000338	潍柴动力	1,300	35,425.00	0.05
149	688536	思瑞浦	96	34,952.64	0.05
150	002028	思源电气	200	34,600.00	0.05
151	600869	远东股份	1,000	33,470.00	0.05
152	301217	铜冠铜箔	200	33,014.00	0.05
153	688519	南亚新材	86	32,683.44	0.05
154	600667	太极实业	1,100	32,098.00	0.04
155	002273	水晶光电	900	31,932.00	0.04
156	300058	蓝色光标	2,300	31,648.00	0.04
157	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.04
158	605358	立昂微	400	31,040.00	0.04
159	002415	海康威视	900	30,780.00	0.04
160	688052	纳芯微	105	30,272.55	0.04
161	601168	西部矿业	1,100	29,854.00	0.04
162	000426	兴业银锡	900	29,664.00	0.04
163	600988	赤峰黄金	1,100	28,952.00	0.04
164	601688	华泰证券	1,400	28,868.00	0.04
165	000100	TCL 科技	4,900	28,518.00	0.04
166	000811	冰轮环境	500	28,110.00	0.04
167	300037	新宙邦	300	27,855.00	0.04
168	600885	宏发股份	800	27,592.00	0.04
169	600309	万华化学	400	27,364.00	0.04
170	605376	博迁新材	100	27,130.00	0.04
171	600089	特变电工	1,200	27,000.00	0.04
172	601857	中国石油	3,100	26,908.00	0.04
173	688503	聚和材料	200	26,540.00	0.04

174	603256	宏和科技	100	26,533.00	0.04
175	300236	上海新阳	200	26,300.00	0.04
176	000960	锡业股份	600	25,614.00	0.04
177	601126	四方股份	400	25,280.00	0.04
178	002558	巨人网络	900	24,804.00	0.03
179	002245	蔚蓝锂芯	1,300	24,323.00	0.03
180	600031	三一重工	1,400	24,192.00	0.03
181	688301	奕瑞科技	195	24,180.00	0.03
182	300033	同花顺	100	24,100.00	0.03
183	002142	宁波银行	800	23,752.00	0.03
184	001389	广合科技	100	23,725.00	0.03
185	601088	中国神华	600	23,424.00	0.03
186	600497	驰宏锌锗	1,900	23,009.00	0.03
187	688300	联瑞新材	94	22,973.60	0.03
188	601601	中国太保	800	22,816.00	0.03
189	301358	湖南裕能	300	22,761.00	0.03
190	600378	昊华科技	300	22,614.00	0.03
191	002532	天山铝业	2,100	22,533.00	0.03
192	002354	天娱数科	2,400	22,320.00	0.03
193	002859	洁美科技	200	21,902.00	0.03
194	002340	格林美	3,300	21,813.00	0.03
195	688390	固德威	200	21,702.00	0.03
196	688127	蓝特光学	222	21,667.20	0.03
197	688652	京仪装备	108	21,618.36	0.03
198	601668	中国建筑	4,900	21,266.00	0.03
199	000933	神火股份	1,000	21,200.00	0.03
200	000792	盐湖股份	700	21,133.00	0.03
201	603588	高能环境	1,100	21,120.00	0.03
202	600352	浙江龙盛	1,700	20,587.00	0.03
203	002203	海亮股份	900	20,565.00	0.03
204	000783	长江证券	2,100	20,475.00	0.03
205	605111	新洁能	200	19,828.00	0.03
206	002460	赣锋锂业	300	19,620.00	0.03
207	002966	苏州银行	2,800	19,488.00	0.03
208	601233	桐昆股份	900	19,485.00	0.03
209	603799	华友钴业	400	19,304.00	0.03
210	300339	润和软件	500	19,255.00	0.03
211	300454	深信服	200	19,240.00	0.03
212	601728	中国电信	3,700	19,203.00	0.03
213	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.03
214	002850	科达利	100	18,930.00	0.03
215	688131	皓元医药	200	18,920.00	0.03
216	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.03

217	300398	飞凯材料	300	18,525.00	0.03
218	002128	电投能源	800	18,496.00	0.03
219	600690	海尔智家	900	18,369.00	0.03
220	601108	财通证券	2,100	18,165.00	0.03
221	603308	应流股份	300	18,120.00	0.03
222	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.03
223	002192	融捷股份	200	17,880.00	0.03
223	688700	东威科技	200	17,880.00	0.03
224	002517	恺英网络	1,100	17,875.00	0.03
225	002049	紫光国微	200	17,750.00	0.02
226	002797	第一创业	2,700	17,739.00	0.02
227	002487	大金重工	300	17,391.00	0.02
228	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.02
229	600941	中国移动	200	17,226.00	0.02
230	601991	大唐发电	2,400	16,992.00	0.02
231	601958	金钼股份	600	16,866.00	0.02
232	002155	湖南黄金	700	16,709.00	0.02
233	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.02
234	603678	火炬电子	200	16,600.00	0.02
235	600460	士兰微	300	16,398.00	0.02
236	000776	广发证券	700	16,380.00	0.02
237	000893	亚钾国际	400	16,356.00	0.02
238	688188	柏楚电子	153	16,325.10	0.02
239	002497	雅化集团	800	16,296.00	0.02
240	600552	凯盛科技	500	16,290.00	0.02
240	600938	中国海油	600	16,290.00	0.02
241	000703	恒逸石化	1,200	16,284.00	0.02
242	002821	凯莱英	100	16,200.00	0.02
243	603283	赛腾股份	200	16,196.00	0.02
244	600160	巨化股份	300	15,903.00	0.02
245	688213	思特威-W	148	15,846.36	0.02
246	600577	精达股份	1,600	15,648.00	0.02
247	601600	中国铝业	1,900	15,618.00	0.02
248	601665	齐鲁银行	2,700	15,579.00	0.02
249	002444	巨星科技	500	15,550.00	0.02
250	002709	天赐材料	300	15,429.00	0.02
251	000425	徐工机械	1,900	15,371.00	0.02
252	300602	飞荣达	300	15,360.00	0.02
253	300012	华测检测	1,100	15,246.00	0.02
254	603379	三美股份	200	15,178.00	0.02
255	002130	沃尔核材	800	15,168.00	0.02
256	600028	中国石化	3,400	15,164.00	0.02
257	000060	中金岭南	2,000	15,140.00	0.02

258	601766	中国中车	2,900	15,080.00	0.02
259	601677	明泰铝业	900	14,940.00	0.02
260	002747	埃斯顿	400	14,932.00	0.02
261	600109	国金证券	1,700	14,926.00	0.02
262	600884	杉杉股份	1,100	14,905.00	0.02
263	601009	南京银行	1,500	14,835.00	0.02
264	300319	麦捷科技	500	14,815.00	0.02
265	600050	中国联通	3,700	14,800.00	0.02
266	603156	养元饮品	300	14,721.00	0.02
267	002414	高德红外	1,100	14,586.00	0.02
268	600298	安琪酵母	400	14,480.00	0.02
269	000938	紫光股份	500	14,430.00	0.02
270	002617	露笑科技	1,400	14,406.00	0.02
271	300661	圣邦股份	100	14,348.00	0.02
272	000878	云南铜业	900	14,292.00	0.02
273	300323	华灿光电	700	14,280.00	0.02
274	002271	东方雨虹	1,200	14,244.00	0.02
275	300432	富临精工	700	14,063.00	0.02
276	300184	力源信息	800	14,040.00	0.02
277	600186	莲花控股	1,000	14,000.00	0.02
278	600060	海信视像	500	13,935.00	0.02
279	601696	中银证券	1,100	13,915.00	0.02
280	000034	神州数码	500	13,875.00	0.02
281	000408	藏格矿业	200	13,864.00	0.02
282	002078	太阳纸业	1,100	13,739.00	0.02
283	601128	常熟银行	2,350	13,677.00	0.02
284	000423	东阿阿胶	300	13,608.00	0.02
285	002241	歌尔股份	600	13,518.00	0.02
286	300623	捷捷微电	300	13,497.00	0.02
287	002378	章源钨业	400	13,392.00	0.02
288	603296	华勤技术	180	13,368.60	0.02
289	688146	中船特气	38	13,299.62	0.02
290	001339	智微智能	130	13,296.40	0.02
291	603119	浙江荣泰	200	13,268.00	0.02
292	300657	弘信电子	300	13,206.00	0.02
293	300919	中伟新材	300	13,125.00	0.02
294	601577	长沙银行	1,500	13,065.00	0.02
295	300558	贝达药业	200	13,014.00	0.02
296	600961	株冶集团	400	12,956.00	0.02
297	002716	湖南白银	1,600	12,944.00	0.02
298	600489	中金黄金	700	12,635.00	0.02
299	688599	天合光能	890	12,566.80	0.02
300	603606	东方电缆	300	12,453.00	0.02

301	300166	东方国信	700	12,397.00	0.02
302	300496	中科创达	200	12,358.00	0.02
303	002064	华峰化学	1,300	12,337.00	0.02
304	002466	天齐锂业	200	12,264.00	0.02
305	002171	楚江新材	900	12,213.00	0.02
306	300170	汉得信息	800	12,192.00	0.02
307	300738	奥飞数据	600	12,132.00	0.02
308	002625	光启技术	400	12,128.00	0.02
309	000630	铜陵有色	1,900	12,084.00	0.02
310	300409	道氏技术	600	11,958.00	0.02
311	688003	天准科技	93	11,838.90	0.02
312	002326	永太科技	500	11,825.00	0.02
313	688717	艾罗能源	143	11,807.51	0.02
314	603979	金诚信	200	11,806.00	0.02
315	688396	华润微	121	11,803.55	0.02
316	688036	传音控股	200	11,790.00	0.02
317	600875	东方电气	400	11,508.00	0.02
318	301031	中熔电气	96	11,467.20	0.02
319	603127	昭衍新药	300	11,466.00	0.02
320	601699	潞安环能	800	11,424.00	0.02
321	002756	永兴材料	200	11,328.00	0.02
322	600177	雅戈尔	1,500	11,295.00	0.02
323	600595	中孚实业	2,000	11,240.00	0.02
324	600596	新安股份	700	11,172.00	0.02
325	002027	分众传媒	2,300	11,132.00	0.02
326	002158	汉钟精机	300	11,124.00	0.02
327	600516	方大炭素	1,800	11,106.00	0.02
328	688005	容百科技	362	11,077.20	0.02
329	000807	云铝股份	500	11,070.00	0.02
330	300199	翰宇药业	500	11,040.00	0.02
331	002405	四维图新	1,700	10,999.00	0.02
332	001337	四川黄金	300	10,998.00	0.02
333	600323	瀚蓝环境	400	10,984.00	0.02
334	600019	宝钢股份	2,000	10,860.00	0.02
335	601995	中金公司	300	10,845.00	0.02
336	601888	中国中免	200	10,742.00	0.02
337	002518	科士达	200	10,718.00	0.02
338	300618	寒锐钴业	300	10,710.00	0.02
339	600338	西藏珠峰	700	10,668.00	0.01
340	688063	派能科技	200	10,654.00	0.01
341	000623	吉林敖东	600	10,638.00	0.01
342	605117	德业股份	100	10,618.00	0.01
343	000519	中兵红箭	500	10,535.00	0.01

344	603876	鼎胜新材	400	10,404.00	0.01
345	002841	视源股份	300	10,359.00	0.01
346	000750	国海证券	2,800	10,304.00	0.01
347	603236	移远通信	200	10,234.00	0.01
348	688029	南微医学	142	10,195.60	0.01
349	600388	龙净环保	700	10,185.00	0.01
350	600989	宝丰能源	500	10,165.00	0.01
351	688097	博众精工	161	10,151.05	0.01
352	002266	浙富控股	2,000	10,120.00	0.01
353	600521	华海药业	700	10,080.00	0.01
354	603699	纽威股份	200	10,060.00	0.01
355	600369	西南证券	2,500	10,050.00	0.01
356	688281	华秦科技	200	10,046.00	0.01
357	002745	木林森	800	10,040.00	0.01
358	002065	东华软件	1,400	9,996.00	0.01
359	601678	滨化股份	1,500	9,885.00	0.01
360	600482	中国动力	300	9,840.00	0.01
361	600985	淮北矿业	700	9,835.00	0.01
362	603225	新凤鸣	500	9,825.00	0.01
363	300693	盛弘股份	200	9,750.00	0.01
364	688158	优刻得-W	265	9,741.40	0.01
365	601377	兴业证券	1,600	9,664.00	0.01
366	600499	科达制造	700	9,660.00	0.01
367	002077	大港股份	500	9,645.00	0.01
368	000155	川能动力	800	9,584.00	0.01
369	688380	中微半导	145	9,556.95	0.01
370	000062	深圳华强	300	9,546.00	0.01
371	002151	北斗星通	300	9,525.00	0.01
372	000967	盈峰环境	900	9,477.00	0.01
373	000538	云南白药	200	9,474.00	0.01
374	601669	中国电建	2,000	9,400.00	0.01
375	002648	卫星化学	400	9,396.00	0.01
376	300002	神州泰岳	1,200	9,372.00	0.01
377	000415	渤海租赁	2,300	9,361.00	0.01
378	001301	尚太科技	100	9,351.00	0.01
379	001287	中电港	300	9,345.00	0.01
380	002430	杭氧股份	300	9,288.00	0.01
381	000737	北方铜业	700	9,254.00	0.01
382	301071	力量钻石	100	9,250.00	0.01
383	000166	申万宏源	2,100	9,240.00	0.01
384	600547	山东黄金	400	9,236.00	0.01
385	600529	山东药玻	500	9,225.00	0.01
386	000683	博源化工	1,600	9,216.00	0.01

387	002048	宁波华翔	400	9,200.00	0.01
388	000729	燕京啤酒	900	9,117.00	0.01
389	300015	爱尔眼科	1,100	9,086.00	0.01
390	601799	星宇股份	100	9,062.00	0.01
391	601369	陕鼓动力	1,000	9,050.00	0.01
392	002249	大洋电机	1,200	9,000.00	0.01
393	600704	物产中大	1,900	8,968.00	0.01
394	002389	航天彩虹	500	8,885.00	0.01
395	600531	豫光金铅	600	8,856.00	0.01
396	600346	恒力石化	500	8,855.00	0.01
397	600312	平高电气	500	8,830.00	0.01
398	002174	游族网络	700	8,827.00	0.01
399	002237	恒邦股份	600	8,814.00	0.01
399	300459	汤姆猫	2,600	8,814.00	0.01
400	601868	中国能建	3,300	8,811.00	0.01
401	600366	宁波韵升	600	8,808.00	0.01
402	300253	卫宁健康	1,300	8,749.00	0.01
403	600166	福田汽车	3,000	8,730.00	0.01
404	601066	中信建投	300	8,721.00	0.01
405	601001	晋控煤业	500	8,695.00	0.01
406	600362	江西铜业	200	8,660.00	0.01
407	600901	江苏金租	1,500	8,625.00	0.01
408	300772	运达股份	700	8,610.00	0.01
409	601918	新集能源	1,000	8,590.00	0.01
410	603338	浙江鼎力	200	8,500.00	0.01
411	603118	共进股份	700	8,477.00	0.01
412	300726	宏达电子	100	8,457.00	0.01
413	000422	湖北宜化	600	8,430.00	0.01
414	000686	东北证券	1,000	8,400.00	0.01
414	000830	鲁西化工	700	8,400.00	0.01
415	300888	稳健医疗	300	8,397.00	0.01
416	600578	京能电力	1,300	8,385.00	0.01
417	002643	万润股份	400	8,380.00	0.01
418	600063	皖维高新	1,100	8,360.00	0.01
419	600587	新华医疗	700	8,316.00	0.01
420	002985	北摩高科	300	8,310.00	0.01
421	002345	潮宏基	900	8,253.00	0.01
422	300607	拓斯达	200	8,246.00	0.01
423	002236	大华股份	500	8,245.00	0.01
424	300821	东岳硅材	400	8,224.00	0.01
425	600550	保变电气	700	8,211.00	0.01
426	002400	省广集团	1,300	8,203.00	0.01
427	000921	海信家电	300	8,196.00	0.01

428	600761	安徽合力	500	8,180.00	0.01
429	002926	华西证券	1,000	8,170.00	0.01
430	002410	广联达	1,000	8,160.00	0.01
431	300573	兴齐眼药	200	8,152.00	0.01
432	605020	永和股份	200	8,144.00	0.01
433	002545	东方铁塔	500	8,110.00	0.01
434	301029	怡合达	300	8,103.00	0.01
434	603733	仙鹤股份	300	8,103.00	0.01
435	688114	华大智造	158	8,070.64	0.01
436	300580	贝斯特	400	8,044.00	0.01
437	603345	安井食品	100	8,019.00	0.01
438	600332	白云山	400	8,016.00	0.01
439	601375	中原证券	2,000	7,980.00	0.01
440	000681	视觉中国	400	7,976.00	0.01
441	300773	拉卡拉	520	7,956.00	0.01
442	688349	三一重能	520	7,893.60	0.01
443	601000	唐山港	1,900	7,885.00	0.01
444	300008	天海防务	1,300	7,878.00	0.01
445	301316	慧博云通	200	7,876.00	0.01
446	600398	海澜之家	1,500	7,845.00	0.01
447	688690	纳微科技	177	7,805.70	0.01
448	000951	中国重汽	400	7,804.00	0.01
449	300315	掌趣科技	2,000	7,800.00	0.01
450	003022	联泓新科	300	7,770.00	0.01
451	603267	鸿远电子	100	7,748.00	0.01
452	601607	上海医药	500	7,700.00	0.01
453	002396	星网锐捷	400	7,668.00	0.01
453	603826	坤彩科技	300	7,668.00	0.01
454	600685	中船防务	300	7,632.00	0.01
455	002948	青岛银行	1,500	7,620.00	0.01
456	600008	首创环保	2,800	7,616.00	0.01
457	002947	恒铭达	100	7,605.00	0.01
458	000682	东方电子	600	7,578.00	0.01
459	000528	柳工	1,000	7,550.00	0.01
460	600170	上海建工	3,400	7,548.00	0.01
461	688336	三生国健	142	7,540.20	0.01
462	601061	中信金属	700	7,539.00	0.01
463	002493	荣盛石化	700	7,525.00	0.01
464	000690	宝新能源	1,600	7,520.00	0.01
465	002079	苏州固锝	500	7,515.00	0.01
466	600729	重庆百货	400	7,512.00	0.01
467	002152	广电运通	800	7,504.00	0.01
467	600998	九州通	1,600	7,504.00	0.01

468	002603	以岭药业	500	7,500.00	0.01
469	300244	迪安诊断	400	7,496.00	0.01
470	688472	阿特斯	692	7,487.44	0.01
471	600211	西藏药业	200	7,478.00	0.01
472	600329	达仁堂	200	7,444.00	0.01
473	000612	焦作万方	700	7,413.00	0.01
474	600995	南网储能	600	7,380.00	0.01
475	603613	国联股份	400	7,368.00	0.01
476	600282	南钢股份	1,600	7,344.00	0.01
477	300725	药石科技	200	7,320.00	0.01
478	000738	航发控制	400	7,316.00	0.01
479	002605	姚记科技	400	7,308.00	0.01
480	600395	盘江股份	1,600	7,296.00	0.01
481	600867	通化东宝	900	7,236.00	0.01
482	601788	光大证券	500	7,215.00	0.01
483	603039	泛微网络	200	7,214.00	0.01
484	601901	方正证券	1,000	7,200.00	0.01
485	603939	益丰药房	400	7,192.00	0.01
486	600426	华鲁恒升	300	7,176.00	0.01
487	603298	杭叉集团	300	7,158.00	0.01
488	603713	密尔克卫	100	7,117.00	0.01
489	600188	兖矿能源	400	7,108.00	0.01
490	603997	继峰股份	600	7,098.00	0.01
491	600557	康缘药业	600	7,062.00	0.01
492	300181	佐力药业	500	7,050.00	0.01
493	600583	海油工程	1,400	7,042.00	0.01
494	000987	越秀资本	900	7,038.00	0.01
495	000833	粤桂股份	300	7,026.00	0.01
496	002607	中公教育	3,900	7,020.00	0.01
497	300676	华大基因	200	7,012.00	0.01
498	601360	三六零	800	6,952.00	0.01
499	601058	赛轮轮胎	600	6,918.00	0.01
500	000880	潍柴重机	300	6,903.00	0.01
501	688615	合合信息	61	6,899.10	0.01
502	603496	恒为科技	300	6,894.00	0.01
503	000301	东方盛虹	600	6,870.00	0.01
504	603565	中谷物流	700	6,867.00	0.01
505	000719	中原传媒	600	6,858.00	0.01
506	300735	光弘科技	300	6,822.00	0.01
507	002498	汉缆股份	1,000	6,820.00	0.01
508	000975	山金国际	400	6,800.00	0.01
509	688779	五矿新能	838	6,796.18	0.01
510	002539	云图控股	600	6,792.00	0.01

511	600686	金龙汽车	600	6,774.00	0.01
512	300628	亿联网络	200	6,764.00	0.01
513	688400	凌云光	102	6,752.40	0.01
514	000999	华润三九	300	6,747.00	0.01
515	600196	复星医药	300	6,741.00	0.01
516	600029	南方航空	1,300	6,734.00	0.01
517	300678	中科信息	300	6,720.00	0.01
518	603816	顾家家居	300	6,708.00	0.01
519	000917	电广传媒	1,000	6,690.00	0.01
520	601111	中国国航	1,100	6,655.00	0.01
521	600458	时代新材	400	6,620.00	0.01
522	600535	天士力	500	6,615.00	0.01
523	601200	上海环境	1,000	6,600.00	0.01
524	600380	健康元	700	6,594.00	0.01
525	301219	腾远钴业	120	6,576.00	0.01
526	000758	中色股份	1,000	6,570.00	0.01
527	000567	海德股份	1,100	6,567.00	0.01
528	600546	山煤国际	600	6,558.00	0.01
529	000997	新大陆	400	6,520.00	0.01
530	301571	国科天成	100	6,518.00	0.01
531	002170	芭田股份	600	6,516.00	0.01
532	000550	江铃汽车	400	6,488.00	0.01
533	002507	涪陵榨菜	600	6,480.00	0.01
533	601609	金田股份	600	6,480.00	0.01
534	300443	金雷股份	300	6,474.00	0.01
535	600120	浙江东方	1,500	6,450.00	0.01
536	601156	东航物流	400	6,448.00	0.01
537	301175	中科环保	1,300	6,435.00	0.01
537	601666	平煤股份	900	6,435.00	0.01
538	002312	川发龙蟒	700	6,419.00	0.01
539	600064	南京高科	900	6,417.00	0.01
540	600490	鹏欣资源	1,100	6,402.00	0.01
541	301510	固高科技	200	6,386.00	0.01
542	600390	五矿资本	1,400	6,384.00	0.01
543	600562	国睿科技	300	6,366.00	0.01
544	002060	广东建工	2,100	6,363.00	0.01
545	600619	海立股份	400	6,340.00	0.01
546	002439	启明星辰	500	6,325.00	0.01
547	688006	杭可科技	173	6,323.15	0.01
548	300783	三只松鼠	400	6,320.00	0.01
549	300130	新国都	300	6,312.00	0.01
550	000778	新兴铸管	1,700	6,307.00	0.01
551	600233	圆通速递	400	6,300.00	0.01

552	300770	新媒股份	200	6,298.00	0.01
553	002399	海普瑞	700	6,286.00	0.01
554	601881	中国银河	500	6,285.00	0.01
555	300185	通裕重工	2,300	6,279.00	0.01
555	603162	海通发展	700	6,279.00	0.01
556	300855	图南股份	200	6,252.00	0.01
557	301127	武汉天源	300	6,216.00	0.01
558	600741	华域汽车	400	6,208.00	0.01
559	300687	赛意信息	200	6,200.00	0.01
560	002832	比音勒芬	300	6,192.00	0.01
561	688111	金山办公	29	6,178.45	0.01
562	601187	厦门银行	900	6,147.00	0.01
563	688050	爱博医疗	168	6,123.60	0.01
564	603323	苏农银行	1,580	6,114.60	0.01
564	688088	虹软科技	172	6,114.60	0.01
565	300416	苏试试验	300	6,114.00	0.01
566	301606	绿联科技	100	6,102.00	0.01
567	600816	建元信托	2,500	6,100.00	0.01
568	600415	小商品城	600	6,096.00	0.01
569	002244	滨江集团	800	6,080.00	0.01
570	601882	海天精工	300	6,069.00	0.01
571	002276	万马股份	600	6,066.00	0.01
571	600267	海正药业	600	6,066.00	0.01
571	600739	辽宁成大	600	6,066.00	0.01
572	002299	圣农发展	400	6,064.00	0.01
573	603305	旭升集团	500	6,060.00	0.01
574	000543	皖能电力	800	6,056.00	0.01
575	601333	广深铁路	2,200	6,050.00	0.01
576	601963	重庆银行	600	6,048.00	0.01
577	000680	山推股份	600	6,030.00	0.01
578	300134	大富科技	700	5,985.00	0.01
579	600906	财达证券	800	5,968.00	0.01
580	600509	天富能源	700	5,915.00	0.01
581	600933	爱柯迪	400	5,912.00	0.01
582	600020	中原高速	1,600	5,904.00	0.01
583	601117	中国化学	800	5,880.00	0.01
584	601107	四川成渝	1,200	5,856.00	0.01
585	300413	芒果超媒	400	5,852.00	0.01
586	301458	钧崴电子	100	5,846.00	0.01
587	002468	申通快递	400	5,824.00	0.01
588	600285	羚锐制药	300	5,814.00	0.01
589	600640	国脉文化	600	5,802.00	0.01
590	600320	振华重工	1,400	5,782.00	0.01

591	000598	兴蓉环境	900	5,778.00	0.01
592	002216	三全食品	500	5,765.00	0.01
593	002727	一心堂	600	5,754.00	0.01
594	002120	韵达股份	900	5,724.00	0.01
595	002338	奥普光电	100	5,720.00	0.01
596	301015	百洋医药	300	5,718.00	0.01
597	300031	宝通科技	200	5,714.00	0.01
598	600216	浙江医药	500	5,700.00	0.01
598	601878	浙商证券	600	5,700.00	0.01
599	600726	华电能源	800	5,696.00	0.01
600	600007	中国国贸	300	5,694.00	0.01
601	603707	健友股份	800	5,656.00	0.01
602	000963	华东医药	200	5,624.00	0.01
603	000883	湖北能源	1,300	5,616.00	0.01
604	002063	远光软件	1,100	5,610.00	0.01
605	002737	葵花药业	500	5,605.00	0.01
606	600559	老白干酒	500	5,600.00	0.01
607	300127	银河磁体	200	5,590.00	0.01
608	600908	无锡银行	1,100	5,588.00	0.01
608	603197	保隆科技	200	5,588.00	0.01
609	000027	深圳能源	900	5,580.00	0.01
609	000685	中山公用	500	5,580.00	0.01
609	600210	紫江企业	900	5,580.00	0.01
610	002979	雷赛智能	100	5,578.00	0.01
611	002701	奥瑞金	1,300	5,538.00	0.01
612	000557	西部创业	1,600	5,536.00	0.01
613	000597	东北制药	1,300	5,512.00	0.01
614	300098	高新兴	1,200	5,508.00	0.01
615	002390	信邦制药	2,100	5,481.00	0.01
616	600639	浦东金桥	600	5,472.00	0.01
617	600258	首旅酒店	500	5,460.00	0.01
618	603025	大豪科技	400	5,456.00	0.01
619	603612	索通发展	300	5,439.00	0.01
620	601900	南方传媒	500	5,430.00	0.01
621	600967	内蒙一机	500	5,425.00	0.01
622	300146	汤臣倍健	600	5,424.00	0.01
623	601801	皖新传媒	1,100	5,423.00	0.01
624	002489	浙江永强	2,000	5,420.00	0.01
625	002697	红旗连锁	1,300	5,408.00	0.01
626	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.01
627	000791	甘肃能源	700	5,320.00	0.01
627	601222	林洋能源	1,000	5,320.00	0.01
628	000088	盐田港	1,300	5,317.00	0.01

629	301376	致欧科技	300	5,316.00	0.01
630	603383	顶点软件	200	5,312.00	0.01
631	002011	盾安环境	500	5,305.00	0.01
632	000810	创维数字	400	5,300.00	0.01
633	688639	华恒生物	327	5,277.78	0.01
634	688612	威迈斯	178	5,267.02	0.01
635	600056	中国医药	600	5,250.00	0.01
636	600511	国药股份	200	5,208.00	0.01
636	601096	宏盛华源	1,200	5,208.00	0.01
637	002421	达实智能	1,500	5,205.00	0.01
638	002541	鸿路钢构	300	5,196.00	0.01
639	002023	海特高新	400	5,184.00	0.01
640	600771	广誉远	400	5,180.00	0.01
641	600508	上海能源	700	5,159.00	0.01
642	600335	国机汽车	1,100	5,148.00	0.01
642	600517	国网英大	1,100	5,148.00	0.01
643	300034	钢研高纳	300	5,142.00	0.01
644	000581	威孚高科	300	5,106.00	0.01
645	600072	中船科技	600	5,094.00	0.01
646	600633	浙数文化	500	5,090.00	0.01
646	603530	神马电力	100	5,090.00	0.01
647	688486	龙迅股份	80	5,086.40	0.01
648	002258	利尔化学	400	5,084.00	0.01
649	002568	百润股份	300	5,076.00	0.01
650	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.01
651	001286	陕西能源	500	5,070.00	0.01
652	002091	江苏国泰	700	5,061.00	0.01
653	000709	河钢股份	2,600	5,044.00	0.01
654	300861	美畅股份	200	5,038.00	0.01
655	601877	正泰电器	200	5,014.00	0.01
656	603300	海南华铁	1,100	5,005.00	0.01
657	002020	京新药业	400	4,996.00	0.01
658	002906	华阳集团	200	4,992.00	0.01
659	600480	凌云股份	600	4,986.00	0.01
660	301109	军信股份	400	4,984.00	0.01
661	300140	节能环保	1,000	4,970.00	0.01
662	603043	广州酒家	400	4,960.00	0.01
663	002925	盈趣科技	200	4,932.00	0.01
663	600655	豫园股份	1,200	4,932.00	0.01
664	300761	立华股份	300	4,923.00	0.01
665	601098	中南传媒	500	4,920.00	0.01
666	002053	云南能投	500	4,915.00	0.01
667	000990	诚志股份	600	4,908.00	0.01

668	301153	中科江南	300	4,887.00	0.01
668	301207	华兰疫苗	300	4,887.00	0.01
669	600861	北京人力	400	4,880.00	0.01
670	300363	博腾股份	300	4,872.00	0.01
670	601898	中煤能源	400	4,872.00	0.01
671	600662	外服控股	1,200	4,836.00	0.01
672	000899	赣能股份	500	4,830.00	0.01
673	000885	城发环境	400	4,812.00	0.01
673	600062	华润双鹤	300	4,812.00	0.01
674	301087	可孚医疗	100	4,765.00	0.01
675	300841	康华生物	100	4,756.00	0.01
676	002041	登海种业	600	4,722.00	0.01
677	002004	华邦健康	1,200	4,716.00	0.01
677	002242	九阳股份	600	4,716.00	0.01
678	600572	康恩贝	1,200	4,704.00	0.01
679	600039	四川路桥	600	4,692.00	0.01
680	603638	艾迪精密	200	4,690.00	0.01
681	601921	浙版传媒	700	4,683.00	0.01
682	600361	创新新材	1,300	4,680.00	0.01
682	600801	华新建材	300	4,680.00	0.01
683	000049	德赛电池	200	4,674.00	0.01
684	300337	银邦股份	400	4,664.00	0.01
684	300357	我武生物	200	4,664.00	0.01
685	002458	益生股份	600	4,662.00	0.01
686	600850	电科数字	320	4,659.20	0.01
687	002315	焦点科技	200	4,656.00	0.01
688	000902	新洋丰	400	4,624.00	0.01
689	300079	数码视讯	1,100	4,620.00	0.01
689	300529	健帆生物	300	4,620.00	0.01
690	600528	中铁工业	700	4,613.00	0.01
691	002292	奥飞娱乐	700	4,592.00	0.01
692	000650	仁和药业	900	4,581.00	0.01
693	301565	中仑新材	200	4,558.00	0.01
693	601021	春秋航空	100	4,558.00	0.01
694	688617	惠泰医疗	25	4,539.00	0.01
695	002051	中工国际	400	4,528.00	0.01
696	603233	大参林	300	4,509.00	0.01
697	600744	华银电力	700	4,501.00	0.01
698	002226	江南化工	1,000	4,490.00	0.01
698	301275	汉朔科技	100	4,490.00	0.01
699	603049	中策橡胶	100	4,481.00	0.01
700	002416	爱施德	500	4,480.00	0.01
701	600827	百联股份	600	4,446.00	0.01

702	300047	天源迪科	500	4,440.00	0.01
702	605507	国邦医药	300	4,440.00	0.01
703	300925	法本信息	300	4,437.00	0.01
704	002043	兔宝宝	400	4,432.00	0.01
704	002668	TCL 智家	400	4,432.00	0.01
705	000156	华数传媒	700	4,417.00	0.01
706	002006	精工科技	300	4,413.00	0.01
707	601069	西部黄金	200	4,400.00	0.01
708	600688	上海石化	1,500	4,395.00	0.01
708	601928	凤凰传媒	500	4,395.00	0.01
709	002017	东信和平	300	4,389.00	0.01
709	600037	歌华有线	700	4,389.00	0.01
710	002508	老板电器	300	4,386.00	0.01
710	002651	利君股份	600	4,386.00	0.01
711	603809	豪能股份	500	4,385.00	0.01
712	603858	步长制药	300	4,380.00	0.01
713	000600	建投能源	500	4,375.00	0.01
714	300406	九强生物	400	4,372.00	0.01
715	003006	百亚股份	300	4,353.00	0.01
716	600598	北大荒	400	4,336.00	0.01
717	600968	海油发展	1,300	4,329.00	0.01
718	600993	马应龙	200	4,324.00	0.01
718	601808	中海油服	400	4,324.00	0.01
719	000966	长源电力	1,100	4,312.00	0.01
720	600295	鄂尔多斯	400	4,288.00	0.01
721	600717	天津港	1,100	4,279.00	0.01
722	300856	科思股份	400	4,264.00	0.01
723	603327	福蓉科技	500	4,240.00	0.01
724	601038	一拖股份	400	4,236.00	0.01
725	601101	昊华能源	400	4,224.00	0.01
726	000089	深圳机场	700	4,221.00	0.01
727	002928	华夏航空	600	4,194.00	0.01
727	301268	铭利达	300	4,194.00	0.01
728	300298	三诺生物	300	4,185.00	0.01
729	002233	塔牌集团	600	4,182.00	0.01
730	600787	中储股份	1,000	4,180.00	0.01
731	002901	大博医疗	100	4,178.00	0.01
732	001308	康冠科技	200	4,172.00	0.01
733	301215	中汽股份	800	4,152.00	0.01
734	600098	广州发展	700	4,137.00	0.01
735	603899	晨光股份	200	4,126.00	0.01
736	002215	诺普信	500	4,115.00	0.01
737	600916	中国黄金	600	4,104.00	0.01

738	002125	湘潭电化	300	4,098.00	0.01
739	002635	安洁科技	200	4,090.00	0.01
740	000676	智度股份	800	4,088.00	0.01
740	300075	数字政通	400	4,088.00	0.01
741	000539	粤电力 A	600	4,086.00	0.01
742	601890	亚星锚链	500	4,085.00	0.01
743	000983	山西焦煤	700	4,060.00	0.01
744	603533	掌阅科技	200	4,058.00	0.01
745	301363	美好医疗	220	4,032.60	0.01
746	600618	氯碱化工	400	4,020.00	0.01
747	600808	马钢股份	1,600	4,000.00	0.01
748	603171	税友股份	100	3,985.00	0.01
749	300415	伊之密	200	3,982.00	0.01
750	002032	苏泊尔	100	3,960.00	0.01
751	000617	中油资本	600	3,954.00	0.01
752	600776	东方通信	300	3,942.00	0.01
753	600061	国投资本	600	3,930.00	0.01
754	600116	三峡水利	700	3,920.00	0.01
755	600502	安徽建工	900	3,915.00	0.01
755	603195	公牛集团	100	3,915.00	0.01
756	600266	城建发展	1,000	3,910.00	0.01
757	600389	江山股份	200	3,904.00	0.01
758	603055	台华新材	500	3,895.00	0.01
759	600515	海南机场	1,400	3,836.00	0.01
760	301487	盟固利	200	3,830.00	0.01
761	600710	苏美达	400	3,824.00	0.01
762	000708	中信特钢	300	3,786.00	0.01
763	002287	奇正藏药	200	3,768.00	0.01
764	600123	兰花科创	700	3,738.00	0.01
765	000848	承德露露	500	3,700.00	0.01
766	002204	大连重工	700	3,696.00	0.01
767	002221	东华能源	700	3,682.00	0.01
768	600059	古越龙山	500	3,660.00	0.01
769	002275	桂林三金	300	3,657.00	0.01
770	603194	中力股份	100	3,656.00	0.01
771	600757	长江传媒	500	3,655.00	0.01
772	000589	贵州轮胎	900	3,654.00	0.01
773	300428	立中集团	200	3,636.00	0.01
774	603337	杰克科技	100	3,623.00	0.01
775	000786	北新建材	200	3,618.00	0.01
776	603100	川仪股份	200	3,610.00	0.01
777	002557	洽洽食品	200	3,592.00	0.01
778	600664	哈药股份	1,200	3,588.00	0.01

779	000552	甘肃能化	1,600	3,584.00	0.01
780	688209	英集芯	123	3,576.84	0.01
781	600125	铁龙物流	700	3,549.00	0.00
782	000950	重药控股	700	3,507.00	0.00
783	605118	力鼎光电	100	3,489.00	0.00
784	000928	中钢国际	700	3,486.00	0.00
784	600764	中国海防	200	3,486.00	0.00
785	000030	富奥股份	900	3,483.00	0.00
786	601326	秦港股份	1,100	3,476.00	0.00
787	002608	江苏国信	500	3,450.00	0.00
787	600971	恒源煤电	500	3,450.00	0.00
788	300492	华图山鼎	100	3,435.00	0.00
789	603888	新华网	200	3,406.00	0.00
790	600606	绿地控股	2,800	3,388.00	0.00
791	600339	中油工程	1,100	3,377.00	0.00
792	600315	上海家化	200	3,364.00	0.00
793	000061	农产品	600	3,360.00	0.00
794	002516	旷达科技	600	3,348.00	0.00
795	002511	中顺洁柔	500	3,325.00	0.00
796	002761	浙江建投	500	3,315.00	0.00
797	002061	浙江交科	1,000	3,300.00	0.00
798	603883	老百姓	300	3,288.00	0.00
799	002243	力合科创	500	3,285.00	0.00
800	688232	新点软件	184	3,271.52	0.00
801	600928	西安银行	1,000	3,270.00	0.00
802	600033	福建高速	1,000	3,220.00	0.00
802	601298	青岛港	400	3,220.00	0.00
802	605099	共创草坪	100	3,220.00	0.00
803	600882	妙可蓝多	200	3,198.00	0.00
804	600740	山西焦化	1,000	3,190.00	0.00
805	601969	海南矿业	400	3,164.00	0.00
806	002588	史丹利	400	3,160.00	0.00
807	600305	恒顺醋业	500	3,155.00	0.00
808	601018	宁波港	1,000	3,150.00	0.00
809	002543	万和电气	500	3,110.00	0.00
810	600006	东风股份	600	3,078.00	0.00
811	688563	航材股份	60	3,073.80	0.00
812	301339	通行宝	300	3,069.00	0.00
813	300226	上海钢联	200	3,062.00	0.00
814	603128	华贸物流	600	3,030.00	0.00
815	002563	森马服饰	600	3,024.00	0.00
816	000059	华锦股份	800	3,000.00	0.00
816	300284	苏交科	600	3,000.00	0.00

817	301267	华夏眼科	200	2,918.00	0.00
818	600720	中交设计	600	2,892.00	0.00
819	300119	瑞普生物	200	2,886.00	0.00
820	603915	国茂股份	200	2,838.00	0.00
821	002941	新疆交建	300	2,832.00	0.00
822	002946	新乳业	200	2,816.00	0.00
823	000828	东莞控股	300	2,808.00	0.00
824	300768	迪普科技	200	2,754.00	0.00
825	605599	菜百股份	200	2,740.00	0.00
826	002351	漫步者	300	2,727.00	0.00
827	301101	明月镜片	100	2,724.00	0.00
828	601033	永兴股份	200	2,680.00	0.00
829	600903	贵州燃气	400	2,656.00	0.00
830	300341	麦克奥迪	200	2,650.00	0.00
831	301500	飞南资源	100	2,605.00	0.00
832	603317	天味食品	200	2,602.00	0.00
833	301371	敷尔佳	100	2,600.00	0.00
834	601019	山东出版	400	2,560.00	0.00
835	601500	通用股份	700	2,555.00	0.00
836	601163	三角轮胎	200	2,538.00	0.00
837	600927	永安期货	200	2,490.00	0.00
838	600810	神马股份	400	2,468.00	0.00
839	000028	国药一致	130	2,458.30	0.00
840	300917	特发服务	100	2,438.00	0.00
841	688522	纳睿雷达	119	2,382.38	0.00
842	605009	豪悦护理	100	2,331.00	0.00
843	300999	金龙鱼	100	2,326.00	0.00
844	301508	中机认检	100	2,314.00	0.00
845	600894	广日股份	300	2,286.00	0.00
846	603057	紫燕食品	100	2,230.00	0.00
847	003039	顺控发展	200	2,202.00	0.00
848	603556	海兴电力	100	2,200.00	0.00
849	603508	思维列控	100	2,136.00	0.00
850	603093	南华期货	100	1,815.00	0.00
851	603013	亚普股份	100	1,579.00	0.00
852	688351	微电生理	67	1,518.22	0.00
853	688083	中望软件	20	1,295.00	0.00
854	688128	中国电研	22	522.28	0.00
855	688475	萤石网络	13	355.55	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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	300308	中际旭创	3,618,316.00	4.03
2	601138	工业富联	3,326,576.00	3.71
3	001309	德明利	2,752,215.00	3.07
4	688525	佰维存储	2,646,606.05	2.95
5	300458	全志科技	2,637,585.00	2.94
6	300975	商络电子	2,560,296.00	2.86
7	688072	拓荆科技	2,376,649.48	2.65
8	301308	江波龙	2,342,361.00	2.61
9	600601	方正科技	2,195,411.00	2.45
10	688012	中微公司	2,155,941.39	2.40
11	301238	瑞泰新材	2,147,405.00	2.39
12	688498	源杰科技	2,085,678.83	2.33
13	002463	沪电股份	2,022,131.00	2.25
14	300042	朗科科技	2,013,711.00	2.25
15	300438	鹏辉能源	1,977,490.00	2.21
16	300475	香农芯创	1,973,803.00	2.20
17	600841	动力新科	1,916,672.00	2.14
18	300953	震裕科技	1,898,261.20	2.12
19	603986	兆易创新	1,873,311.00	2.09
20	688266	泽璟制药-U	1,809,412.19	2.02
21	301358	湖南裕能	1,807,403.00	2.02
22	688633	星球石墨	1,804,379.05	2.01

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

②“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超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	300975	商络电子	3,137,631.00	3.50
2	001309	德明利	2,523,797.00	2.81
3	600841	动力新科	2,232,236.00	2.49
4	300458	全志科技	2,205,430.58	2.46
5	601138	工业富联	2,185,806.00	2.44
6	300851	交大思诺	2,052,303.00	2.29
7	600262	北方股份	1,973,259.00	2.20
8	688633	星球石墨	1,953,939.92	2.18
9	300681	英搏尔	1,875,716.43	2.09
10	300308	中际旭创	1,875,120.00	2.09
11	688012	中微公司	1,849,682.53	2.06
12	603045	福达合金	1,839,900.00	2.05
13	603585	苏利股份	1,825,402.00	2.04

14	001314	亿道信息	1,793,907.00	2.00
15	688525	佰维存储	1,779,917.09	1.98
16	300389	艾比森	1,779,432.00	1.98
17	301358	湖南裕能	1,778,771.00	1.98
18	603558	健盛集团	1,747,230.00	1.95
19	603895	天永智能	1,732,255.00	1.93
20	603335	迪生力	1,727,234.00	1.93

注：①卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	517,154,015.22
卖出股票收入（成交）总额	550,389,316.31

注：①买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

②“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在大限度保证基金资产安全的基础上管理利率波动风险，实现基金资产保值增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

无。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同约定股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	23,034.98
2	应收清算款	2,173,554.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,988.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,215,577.96

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
中航量化 阿尔法六 个月持有 A	514	32,250.73	1,222.51	0.01	16,575,654.85	99.99
中航量化 阿尔法六 个月持有 C	514	66,611.55	0	-	34,238,337.87	100.00
合计	1,001	50,764.45	1,222.51	0.00	50,813,992.72	100.00

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	99.90

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	中航量化阿尔法六个月持有 A	368,472.54	2.22
	中航量化阿尔法六个月持有 C	1,883,323.07	5.50
	合计	2,251,795.61	4.43

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、 基金投资和研究部门 负责人持有本开放式 基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	10~50
	中航量化阿尔法六个月持有 C	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	0~10
	中航量化阿尔法六个月持有 C	>100

	合计	>100
--	----	------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航量化阿尔法六个月持有 A	中航量化阿尔法六个月持有 C
基金合同生效日 (2021 年 8 月 25 日)	74,904,100.76	254,269,492.63
基金份额总额		
本报告期期初基金份 额总额	24,738,160.42	57,201,609.11
本报告期基金总申购 份额	4,245,743.52	685,936.79
减：本报告期基金总 赎回份额	12,407,026.58	23,649,208.03
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	16,576,877.36	34,238,337.87

注：基金总申购份额包含基金红利再投、转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本报告期内，基金托管人无重大人事变动。
2. 2026 年 2 月 4 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2026 年 2 月 2 日起，宋鑫担任公司督察长职务，刘建不再担任公司督察长职务。
3. 2026 年 4 月 24 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2026 年 4 月 22 日起，王楠担任公司副总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金审计机构未发生变更。

10.6 管理人、托管人及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

本报告期内，本基金管理人无受到调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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 (%)	
东吴证券股份有限公司	2	590,550,985.54	55.32	260,230.10	55.03	-
国盛证券有限责任公司	2	476,992,345.99	44.68	212,685.58	44.97	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	2	-	-	-	-	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

选择标准：①实力雄厚，信誉良好；②研究、交易实力较强，选择需要支付研究服务费用的证券公司，应考察其研究服务能力，能及时为基金提供高质量的资讯服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场分析、个股分析报告、市场数据统计及其它专门报告等，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；③财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；④经营行为规范，内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求；⑤具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的要求，并能为基金提供全面的信息服务。

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

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
东吴证券东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

司						
中航证 券有限 公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
2	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 2 月 4 日
3	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2025 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
4	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 22 日
5	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 24 日
6	中航基金管理有限公司关于终止与中证金牛（北京）基金销售有限公司销售业务的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 16 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金募集的文件
2. 《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金合同》
3. 《中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批件、营业执照
5. 报告期内中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金在规定媒体上披露的各项公

告

12.2 存放地点

中航基金管理有限公司，地址：北京市朝阳区天辰东路 1 号院亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 单元。

12.3 查阅方式

1. 营业时间内到本公司免费查阅
2. 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.avicfund.cn
3. 拨打本公司客户服务电话垂询：400-666-2186

中航基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日