

中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券
投资基金
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：2025 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§ 4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 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.....	18
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
§ 6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
§ 7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 净资产变动表.....	25
7.4 报表附注.....	27
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	90
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	93
8.6 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.....	93
8.7 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.....	93

8.8 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	93
8.9 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	93
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	93
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	94
8.12 投资组合报告附注	94
§ 9 基金份额持有人信息	95
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	95
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	95
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	95
§ 10 开放式基金份额变动	97
§ 11 重大事件揭示	98
11.1 基金份额持有人大会决议	98
11.2 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	98
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	98
11.4 基金投资策略的改变	98
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	98
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	98
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	98
11.8 其他重大事件	100
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	102
12.1 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	102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	102
§ 13 备查文件目录	103
13.1 备查文件目录	103
13.2 存放地点	103
13.3 查阅方式	103

§ 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	194,091,611.01 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	54,805,567.62 份	139,286,043.39 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	刘建
	联系电话	010-56716166
	电子邮箱	liujian@avicfund.cn
客户服务电话	400-666-2186	400-61-95555
传真	010-56716198	0755-83195201

注册地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院 1 号楼 1 层 101 内 10 层 B1001 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	100101	518040
法定代表人	杨彦伟	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	中兴华会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市丰台区丽泽路 20 号院 1 号楼南楼 20 层
注册登记机构	中航基金管理有限公司	北京市朝阳区天辰东路 1 号院北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801/805/806 单元

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2024 年		2023 年		2022 年	
	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	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	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	-2,409,004.69	-6,969,011.54	-5,062,866.78	-14,514,733.46	-7,461,230.92	-22,323,289.52
本期利润	778,967.55	964,430.08	-4,817,533.82	-13,819,005.92	-12,172,443.18	-35,189,056.36
加权平均基金份额本期利润	0.0127	0.0062	-0.0672	-0.0704	-0.1457	-0.1478
本期加权平	1.73%	0.86%	-7.96%	-8.42%	-16.16%	-16.49%

均净值利润率						
本期基金份额净值增长率	3.06%	2.44%	-8.47%	-9.03%	-14.17%	-14.68%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	-11,038,379.71	-30,230,710.67	-15,024,092.45	-40,669,990.72	-11,601,630.77	-34,127,007.90
期末可供分配基金份额利	-0.2014	-0.2170	-0.2223	-0.2332	-0.1503	-0.1571

润						
期						
末						
基						
金						
资	43,927,028.	109,413,565	52,552,340.	133,705,255	65,606,709.	183,061,454
产	43	.97	59	.98	30	.20
净						
值						
期						
末						
基						
金						
份						
额						
净						
值						
增						
长						
率						
3.1.						
3						
累						
计						
期						
末						
指						
标						
	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基						
金						
份						
额						
累						
计						
净						
值						
增						
长						
率						
	-19.85%	-21.45%	-22.23%	-23.32%	-15.03%	-15.71%

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期末可供分配利润：对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；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

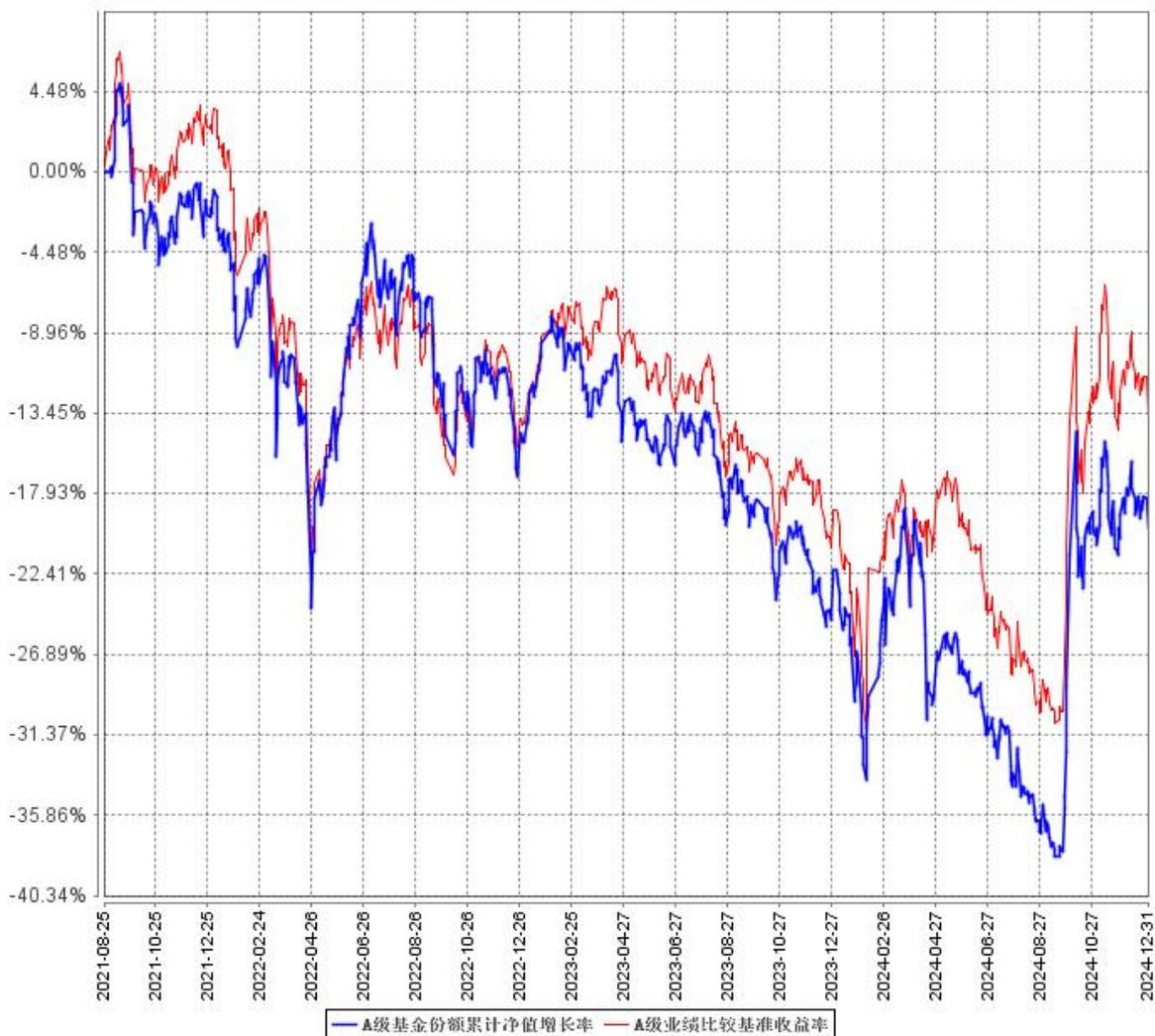
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.92%	1.91%	0.30%	1.73%	1.62%	0.18%
过去六个月	16.18%	1.89%	14.33%	1.70%	1.85%	0.19%
过去一年	3.06%	1.73%	6.37%	1.55%	-3.31%	0.18%
过去三年	-19.04%	1.31%	-16.54%	1.19%	-2.50%	0.12%
自基金合同生效起至今	-19.85%	1.27%	-13.63%	1.15%	-6.22%	0.12%

中航量化阿尔法六个月持有 C

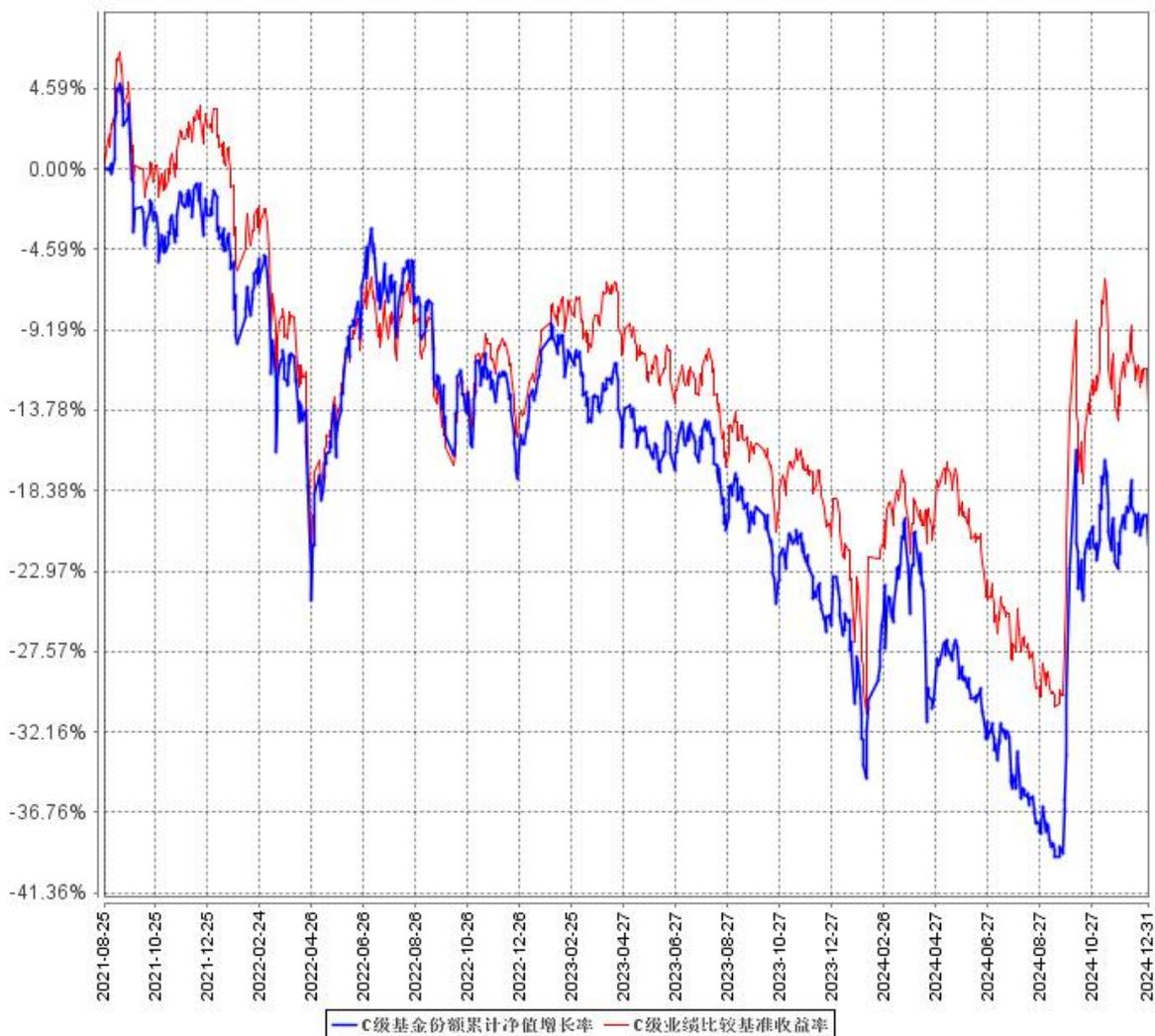
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.76%	1.91%	0.30%	1.73%	1.46%	0.18%
过去六个月	15.82%	1.89%	14.33%	1.70%	1.49%	0.19%
过去一年	2.44%	1.73%	6.37%	1.55%	-3.93%	0.18%
过去三年	-20.49%	1.31%	-16.54%	1.19%	-3.95%	0.12%
自基金合同生效起至今	-21.45%	1.27%	-13.63%	1.15%	-7.82%	0.12%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

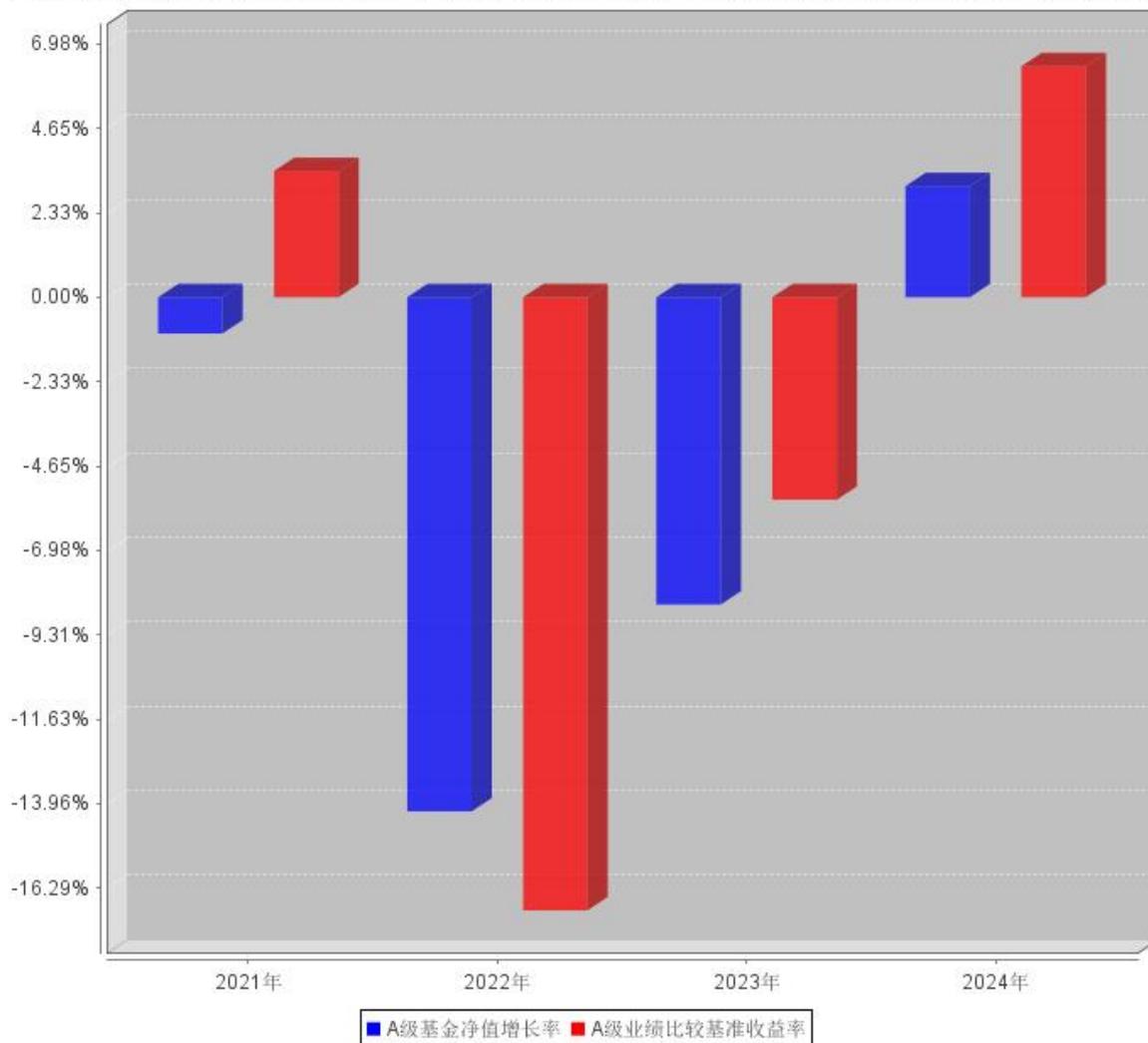


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

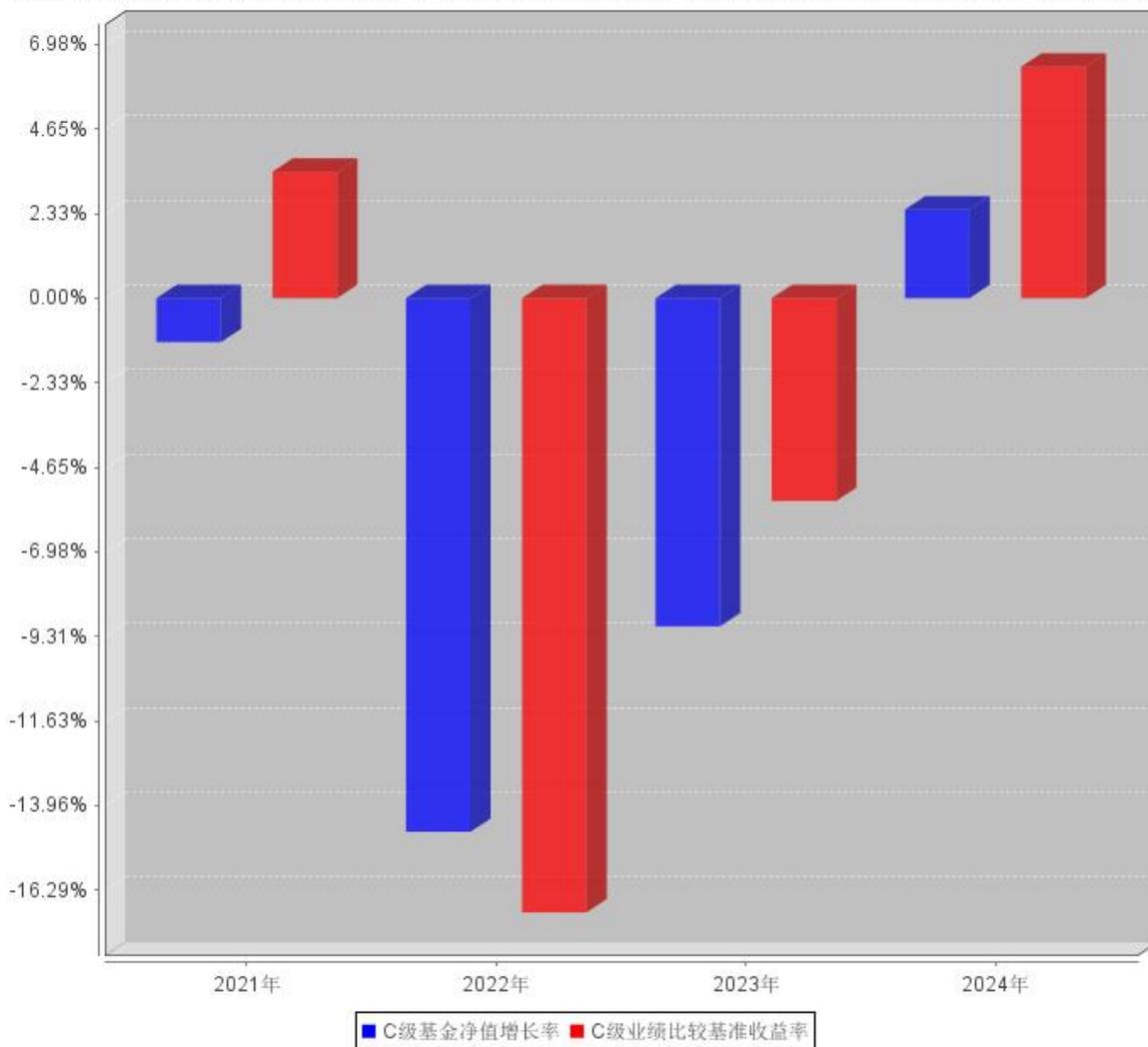


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	基金经理	2021 年 8 月 25 日	-	13	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部负责人，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。
杨扬	基金经理	2021 年 9 月 16 日	-	14	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遵规守信情况的说明

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，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 公平交易制度和控制方法

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。同时，加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内本基金不存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

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

在过去的一年里，市场走势一波三折，大多数宽基指数年线收涨。风格方面，上半年小微盘出现两轮剧烈下跌，下半年 924 行情之后，科技成长风格明显崛起，红利价值风格随着市场风险偏好的提升而走弱。本基金的投资策略是在全市场范围内筛选基本面和估值性价比均良好的个股，由于全市场选股，市值风格相对主流宽基指数稍偏中小盘，在上半年尤其二季度中出现一定超额回撤。下半年，我们观察到成长风格因子已处于历史上性价比较高的位置，及时提升了组合在科技成长方向上的敞口，净值有所修复。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值为 0.8015 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.06%；截至本报告期末中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值为 0.7855 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.44%；同期业绩比较基准收益率为 6.37%。

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 2025 年，我国经济有望在政策支持下逐渐回稳，企业盈利预期有望逐步修正，同时货币政策大概率保持宽松，资本市场流动性充裕，我们对全年 A 股市场保持中性乐观。结构方面，我们着重关注科技创新、新质生产力、先进制造等方面的机会，同时关注内需政策支持下基本面预期修复的消费板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人根据法律法规、监管要求和业务发展情况，以维护基金份额持有人利益为宗旨，组织开展内部监察稽核，完善合规与内控机制，积极推动合规风控管理，持续加强业务风险的控制与防范，有效保证了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。本报告期内，本基金管理人开展的主要监察稽核工作如下：

(1) 积极推动监管新规落实，持续完善公司内控机制。结合新规实施和公司业务发展实际，不断推动公司制度、业务流程的建立、健全和完善，以适应公司产品与业务创新发展的需要；

(2) 在公司开展新产品设计、新业务过程中，就相关问题提供合规咨询，出具合规审查意见。全面履行新产品、新业务合规评估程序，保障新产品、新业务合规开展；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况，督促完善投资者适当性管理；

(3) 有计划、有重点地对投资、研究、交易、销售、公司治理、信息技术、反洗钱等业务领域开展定期及专项监察检查，不断查缺补漏，持续提高内部控制的有效性和风险防控能力，保障公司业务合规、持续、健康、稳定发展；

(4) 持续推动建立与行业和公司业务相匹配的洗钱风险管理机制，检查洗钱风险与控制措施的有效性，进一步完善与风险能力相适应的反洗钱制度、流程，完善反洗钱系统建设，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，同时，做好反洗钱宣传培训、监督检查、信息报送等各项工作；

(5) 加强合规宣导培训，不断推动公司合规文化建设。通过“面授+线上”等多种形式，有针对性地开展了投资者个人信息保护、基金宣传推介、反洗钱、新员工入职等合规宣导与合规培训，并通过新规动态、合规专题、合规风险案例等多种方式进行合规宣导，提升员工的合规风险意识，强化全员合规、主动合规理念。

本基金管理人承诺将坚持诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，积极健全内部管理制度，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.8 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，本基金本报告期未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

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

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	中兴华审字（2025）第 010541 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金全体持有人
审计意见	我们审计了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”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果及净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于本基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>本基金管理人中航基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估本基金的持续经营</p>

	<p>能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督本基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对本基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致本基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	中兴华会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	袁春然	张治明
会计师事务所的地址	北京市丰台区丽泽路 20 号丽泽 SOHO B 座 20 层	
审计报告日期	2025 年 3 月 26 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	13,785,733.53	14,530,643.47
结算备付金		1,147,944.71	1,032,044.38
存出保证金		25,125.74	25,543.81
交易性金融资产	7.4.7.2	138,879,943.97	170,644,205.42
其中：股票投资		138,879,943.97	170,644,205.42
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		542,511.14	1,904,442.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		154,381,259.09	188,136,879.68
负债和净资产			
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		349,753.61	640,392.20
应付赎回款		17.27	396,633.22

应付管理人报酬		160,084.52	188,334.93
应付托管费		26,680.74	31,389.17
应付销售服务费		57,192.14	67,677.64
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	446,936.41	554,855.95
负债合计		1,040,664.69	1,879,283.11
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	194,091,611.01	241,951,679.74
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-40,751,016.61	-55,694,083.17
净资产合计		153,340,594.40	186,257,596.57
负债和净资产总计		154,381,259.09	188,136,879.68

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 194,091,611.01 份，其中中航量化阿尔法六个月持有 A 基金份额净值 0.8015 元，基金份额总额 54,805,567.62 份；中航量化阿尔法六个月持有 C 基金份额净值 0.7855 元，基金份额总额 139,286,043.39 份

7.2 利润表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		4,763,232.75	-13,787,703.48
1.利息收入		71,486.83	92,515.78
其中：存款利息收入	7.4.7.13	71,486.83	92,515.78
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）		-6,429,667.94	-14,821,279.76
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-9,013,452.28	-17,718,549.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	4.57	-1,590.13
股利收益	7.4.7.19	2,583,779.77	2,898,860.34

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）	7.4.7.20	11,121,413.86	941,060.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		3,019,835.12	4,848,836.26
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,895,464.00	3,175,439.17
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	315,910.62	529,239.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	677,451.29	988,135.22
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	131,009.21	156,021.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,743,397.63	-18,636,539.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,743,397.63	-18,636,539.74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,743,397.63	-18,636,539.74

7.3 净资产变动表

会计主体：中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金

本报告期：2024年1月1日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2024年1月1日至2024年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	241,951,679.74	-	-55,694,083.17	186,257,596.57
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	241,951,679.74	-	-55,694,083.17	186,257,596.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-47,860,068.73	-	14,943,066.56	-32,917,002.17
（一）、综合收益总额	-	-	1,743,397.63	1,743,397.63
（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）	-47,860,068.73	-	13,199,668.93	-34,660,399.80
其中：1.基金申购款	348,181.02	-	-93,638.84	254,542.18
2.基金赎回款	-48,208,249.75	-	13,293,307.77	-34,914,941.98
（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	194,091,611.01	-	-40,751,016.61	153,340,594.40
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	294,396,802.17	-	-45,728,638.67	248,668,163.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-52,445,122.43	-	-9,965,444.50	-62,410,566.93
（一）、综合收益总额	-	-	-18,636,539.74	-18,636,539.74
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产	-52,445,122.43	-	8,671,095.24	-43,774,027.19

减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	836,954.08	-	-117,786.06	719,168.02
2.基金赎回款	-53,282,076.51	-	8,788,881.30	-44,493,195.21
(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	241,951,679.74	-	-55,694,083.17	186,257,596.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u> 刘建 </u>	<u> 裴荣荣 </u>	<u> 韩丹 </u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《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”）、中国证券投资基金业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号—年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号—年度报告和中期报告》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金核算以人民币为记账本位币。记账单位为人民币元。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入

其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、同业存单、资产支持证券和衍生工具等分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期

信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券、同业存单和衍生工具(主要为权证投资)等按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 对于存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应该将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因其大

量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,应对估值进行调整并确定公允价值。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的,基金管理公司根据具体情况与托管银行进行商定,按最能恰当反映公允价值的价格估值。

国家有最新规定的,按其规定进行估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额所对应的金额。由于申购、赎回、转换以及分红再投资引起的实收基金的变动分别于基金相关活动确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资、资产支持证券、同业存单投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利

率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金在符合有关基金分红条件的前提下可进行收益分配,每次收益分配比例等具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告,若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;基金份额持有人持有的基金份额(原份额)所获得的红利再投资份额的持有期,按原份额的持有期计算;

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

4、本基金每一基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 分部报告

无。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本报告期本基金无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税明电【2008】2号《财政部、国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税征收方式的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年09月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税【2016】36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税【2016】46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税【2016】70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 基金运营过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税；

2. 基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加；

3. 对基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税；

4. 存款利息收入不征收增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税；

5. 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税；

6. 基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计

入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

7. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税；

8. 对于基金从事 A 股买卖，自 2008 年 09 月 19 日起，由出让方按 0.1% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	13,785,733.53	14,530,643.47
等于：本金	13,784,239.71	14,529,131.45
加：应计利息	1,493.82	1,512.02
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计：	13,785,733.53	14,530,643.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	140,980,092.77	-	138,879,943.97	-2,100,148.80
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		140,980,092.77	-	138,879,943.97	-2,100,148.80
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		183,865,768.08	-	170,644,205.42	-13,221,562.66
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		183,865,768.08	-	170,644,205.42	-13,221,562.66

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 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。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 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。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31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	441,936.41	407,855.95
其中：交易所市场	441,936.41	407,855.95
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	5,000.00	147,000.00
合计	446,936.41	554,855.95

注：预提费用为按日计提的审计费。

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,576,433.04	67,576,433.04
本期申购	215,406.21	215,406.21
本期赎回（以“-”号填列）	-12,986,271.63	-12,986,271.63
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	54,805,567.62	54,805,567.62

金额单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C		
项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,375,246.70	174,375,246.70
本期申购	132,774.81	132,774.81
本期赎回（以“-”号填列）	-35,221,978.12	-35,221,978.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	139,286,043.39	139,286,043.39

注：本期申购包含基金转换入份额；本期赎回包含基金转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-12,127,137.83	-2,896,954.62	-15,024,092.45

加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-12,127,137.83	-2,896,954.62	-15,024,092.45
本期利润	-2,409,004.69	3,187,972.24	778,967.55
本期基金份额交易 产生的变动数	3,497,762.81	-131,177.10	3,366,585.71
其中：基金申购款	-61,170.42	3,889.80	-57,280.62
基金赎回款	3,558,933.23	-135,066.90	3,423,866.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,038,379.71	159,840.52	-10,878,539.19

单位：人民币元

中航量化阿尔法六个月持有 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-33,244,167.15	-7,425,823.57	-40,669,990.72
加：会计政策变更 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-33,244,167.15	-7,425,823.57	-40,669,990.72
本期利润	-6,969,011.54	7,933,441.62	964,430.08
本期基金份额交易 产生的变动数	9,982,468.02	-149,384.80	9,833,083.22
其中：基金申购款	-37,486.94	1,128.72	-36,358.22
基金赎回款	10,019,954.96	-150,513.52	9,869,441.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,230,710.67	358,233.25	-29,872,477.42

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年 12月31日	2023年1月1日至2023年12月31 日
活期存款利息收入	50,439.14	72,536.57
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	20,336.33	17,248.10

其他	711.36	2,731.11
合计	71,486.83	92,515.78

注：其他包括基金结算保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-9,013,452.28	-17,718,549.97
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	-9,013,452.28	-17,718,549.97

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
卖出股票成交总额	2,050,274,631.64	1,581,525,194.87
减：卖出股票成本总额	2,055,315,010.22	1,595,362,619.35
减：交易费用	3,973,073.70	3,881,125.49
买卖股票差价收入	-9,013,452.28	-17,718,549.97

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益。

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期及上年度可比期间，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。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期及上年度可比期间本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
国债期货投资收益	-	-
股指期货投资收益	4.57	-1,590.13

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,583,779.77	2,898,860.34
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	2,583,779.77	2,898,860.34

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1. 交易性金融资产	11,121,413.86	941,060.50
——股票投资	11,121,413.86	941,060.50
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	11,121,413.86	941,060.50

7.4.7.21 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

本报告期及上年度可比期间，本基金无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
审计费用	5,000.00	27,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款费	6,009.21	9,021.97
开户费	-	-
交易费用	-	-
合计	131,009.21	156,021.97

7.4.7.24 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
北京首钢基金有限公司	基金管理人股东

7.4.10 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。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
中航证券有限公司	76,541,882.39	1.88%	774,861,415.56	24.92%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.1.4 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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中航证券有限公司	36,678.02	1.36%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付 佣金总额的 比例
中航证券有限公司	567,294.18	24.81%	65.56	0.02%

注：①上述佣金按照市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取、并由券商承担的费用后的净额列示。

②该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为基金提供的证券投资研究成果。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,895,464.00	3,175,439.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	929,171.32	1,558,979.64
应支付基金管理人的净管理费	966,292.68	1,616,459.53

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 为每日应付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计算，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	315,910.62	529,239.90

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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31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	-	661,768.81	661,768.81
中航基金管理有限公司	-	43.33	43.33
中航证券有限公司	-	14,070.14	14,070.14
合计	-	675,882.28	675,882.28
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31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	-	967,287.22	967,287.22
中航基金管理有限公司	-	50.18	50.18
中航证券有限公司	-	18,216.60	18,216.60
合计	-	985,554.00	985,554.00

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。

7.4.10.3 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，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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**7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间，基金管理人未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	14,570,389.54	71,486.83	15,588,231.66	92,515.78

注：包括活期存款，存在托管银行的定期存款，基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司的证券交易结算资金，即结算备付金、交易保证金。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
603072	天和磁材	2024年12月24日	3个交易日	新股流通受限	12.30	12.30	1,229	15,116.70	15,116.70	-

301626	苏州天脉	2024年10月17日	1到6个月(含)	网下配售锁定	21.23	85.47	682	14,478.86	58,290.54	-
688605	先锋精科	2024年12月4日	1到6个月(含)	网下配售锁定	11.29	70.88	584	6,593.36	41,393.92	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	1到6个月(含)	网下配售锁定	8.00	56.07	463	3,704.00	25,960.41	-
301551	无线传媒	2024年9月19日	1到6个月(含)	网下配售锁定	9.40	43.37	581	5,461.40	25,197.97	-
688449	联芸科技	2024年11月20日	1到6个月(含)	网下配售锁定	11.25	37.66	628	7,065.00	23,650.48	-
301556	托普云农	2024年10月10日	1到6个月(含)	网下配售锁定	14.50	75.56	267	3,871.50	20,174.52	-
688708	佳驰科技	2024年11月27日	1到6个月(含)	网下配售锁定	27.08	57.31	260	7,040.80	14,900.60	-
688721	龙图光罩	2024年7月30日	1到6个月(含)	网下配售锁定	18.50	56.78	211	3,903.50	11,980.58	-
301571	国科天成	2024年8月14日	1到6个月(含)	网下配售锁定	11.14	40.90	278	3,096.92	11,370.20	-
301622	英特思	2024年11月26日	1到6个月(含)	网下配售锁定	22.36	57.30	197	4,404.92	11,288.10	-
001391	国货航	2024年12月23日	1到6个月(含)	网下配售锁定	2.30	8.91	1,141	2,624.30	10,166.31	-
001279	强邦新材	2024年9月27日	1到6个月(含)	网下配售锁定	9.68	35.43	265	2,565.20	9,388.95	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	1到6个月(含)	网下配售锁定	27.70	52.89	162	4,487.40	8,568.18	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	1到6个月(含)	网下配售锁定	23.95	43.48	168	4,023.60	7,304.64	-
301552	科力装备	2024年7月15日	1到6个月(含)	网下配售锁定	30.00	56.81	127	3,810.00	7,214.87	-

			(含)							
301631	壹连科技	2024年11月12日	1到6个月(含)	网下配售锁定	72.99	120.13	58	4,233.42	6,967.54	-
603395	四方红	2024年11月19日	1到6个月(含)	网下配售锁定	7.98	43.99	154	1,228.92	6,774.46	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	1到6个月(含)	网下配售锁定	27.76	47.81	140	3,886.40	6,693.40	-
301606	绿联科技	2024年7月17日	1到6个月(含)	网下配售锁定	21.21	36.43	180	3,817.80	6,557.40	-
301608	博实结	2024年7月25日	1到6个月(含)	网下配售锁定	44.50	65.31	89	3,960.50	5,812.59	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	1到6个月(含)	网下配售锁定	26.50	41.94	135	3,577.50	5,661.90	-
603205	健康尔	2024年10月29日	1到6个月(含)	网下配售锁定	14.65	35.04	128	1,875.20	4,485.12	-
603194	中力股份	2024年12月17日	1到6个月(含)	网下配售锁定	20.32	32.96	117	2,377.44	3,856.32	-
603350	安乃达	2024年6月26日	1到6个月(含)	网下配售锁定	20.56	36.09	79	1,624.24	2,851.11	-
603391	力聚热能	2024年7月24日	1到6个月(含)	网下配售锁定	40.00	41.33	52	2,080.00	2,149.16	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1到6个月(含)	网下配售锁定	18.65	22.60	74	1,380.10	1,672.40	-
603310	巍华新材	2024年8月7日	1到6个月(含)	网下配售锁定	17.39	17.93	77	1,339.03	1,380.61	-

7.4.12.2 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
002252	上海莱士	2024年12月23日	临时停牌	7.22	2025年1月7日	6.93	9,800	71,999.75	70,756.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 信用风险

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

基金的货币资金存放在托管人和其他具有基金托管资格的股份制商业银行，与该货币资金相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险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。

于本报告期末，本基金未持有资产支持证券及同业存单。

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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期报告末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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于开放日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。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.2 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金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 7.4.12。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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,785,733.53	-	-	-	13,785,733.53

结算备付金	1,147,944.71	-	-	-	1,147,944.71
存出保证金	25,125.74	-	-	-	25,125.74
交易性金融资产	-	-	-	-138,879,943.97	138,879,943.97
应收清算款	-	-	-	542,511.14	542,511.14
资产总计	14,958,803.98	-	-	-139,422,455.11	154,381,259.09
负债					
应付清算款	-	-	-	349,753.61	349,753.61
应付赎回款	-	-	-	17.27	17.27
应付管理人报酬	-	-	-	160,084.52	160,084.52
应付托管费	-	-	-	26,680.74	26,680.74
应付销售服务费	-	-	-	57,192.14	57,192.14
其他负债	-	-	-	446,936.41	446,936.41
负债总计	-	-	-	1,040,664.69	1,040,664.69
利率敏感度缺口	14,958,803.98	-	-	-138,381,790.42	153,340,594.40
上年度末 2023 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	14,530,643.47	-	-	-	14,530,643.47
结算备付金	1,032,044.38	-	-	-	1,032,044.38
存出保证金	25,543.81	-	-	-	25,543.81
交易性金融资产	-	-	-	-170,644,205.42	170,644,205.42
应收清算款	-	-	-	1,904,442.60	1,904,442.60
资产总计	15,588,231.66	-	-	-172,548,648.02	188,136,879.68
负债					
应付清算款	-	-	-	640,392.20	640,392.20
应付赎回款	-	-	-	396,633.22	396,633.22
应付管理人报酬	-	-	-	188,334.93	188,334.93
应付托管费	-	-	-	31,389.17	31,389.17
应付销售服务费	-	-	-	67,677.64	67,677.64
其他负债	-	-	-	554,855.95	554,855.95
负债总计	-	-	-	1,879,283.11	1,879,283.11
利率敏感度缺口	15,588,231.66	-	-	-170,669,364.91	186,257,596.57

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末，若市场利率上升或者下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将不会产生重大变动。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	138,879,943.97	90.57	170,644,205.42	91.62
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	138,879,943.97	90.57	170,644,205.42	91.62

注：本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升5%	7,986,526.28	9,848,472.95
	业绩比较基准下降5%	-7,986,526.28	-9,848,472.95

7.4.13.4.4 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	138,452,358.99	169,498,685.64
第二层次	85,872.70	212,398.56
第三层次	341,712.28	933,121.22
合计	138,879,943.97	170,644,205.42

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至 2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	933,121.22	933,121.22
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	396,212.24	396,212.24
转出第三层次	-	287,700.93	287,700.93
当期利得或损失总额	-	-699,920.25	-699,920.25
其中：计入损益的利得或损失	-	-699,920.25	-699,920.25
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	341,712.28	341,712.28
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损	-	233,200.97	233,200.97

项目	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	908,477.40	908,477.40
当期购买	-	1,591,327.34	1,591,327.34
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,770,910.43	1,770,910.43
当期利得或损失总额	-	204,226.91	204,226.91
其中：计入损益的利得或损失	-	204,226.91	204,226.91
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	933,121.22	933,121.22
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	90,471.85	90,471.85

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2024 年度，本基金转入/转出第三层次的交易性金融资产均为限售期开始/结束的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	341,712.28	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1663-1.0869	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	933,121.22	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1476-1.5417	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	138,879,943.97	89.96
	其中：股票	138,879,943.97	89.96
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	14,933,678.24	9.67
8	其他各项资产	567,636.88	0.37
9	合计	154,381,259.09	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,786,419.00	1.17
B	采矿业	4,905,544.00	3.20
C	制造业	90,245,077.09	58.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,802,563.00	3.78
E	建筑业	2,162,698.00	1.41
F	批发和零售业	3,612,132.70	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	2,223,405.31	1.45
H	住宿和餐饮业	68,949.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,949,818.23	7.14
J	金融业	11,772,661.50	7.68
K	房地产业	1,644,348.00	1.07
L	租赁和商务服务业	553,593.00	0.36
M	科学研究和技术服务业	1,036,464.40	0.68

N	水利、环境和公共设施管理业	1,008,238.74	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	431,412.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	676,620.00	0.44
S	综合	-	-
	合计	138,879,943.97	90.57

8.2.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	11,200	2,979,200.00	1.94
2	600519	贵州茅台	1,900	2,895,600.00	1.89
3	601318	中国平安	41,200	2,169,180.00	1.41
4	688981	中芯国际	21,060	1,992,697.20	1.30
5	688041	海光信息	11,890	1,781,003.10	1.16
6	688256	寒武纪	2,270	1,493,660.00	0.97
7	300059	东方财富	54,500	1,407,190.00	0.92
8	000333	美的集团	17,700	1,331,394.00	0.87
9	688012	中微公司	6,311	1,193,788.76	0.78
10	300502	新易盛	9,000	1,040,220.00	0.68
11	600900	长江电力	34,400	1,016,520.00	0.66
12	600030	中信证券	32,800	956,776.00	0.62
13	601899	紫金矿业	62,400	943,488.00	0.62
14	688008	澜起科技	13,284	901,983.60	0.59
15	300308	中际旭创	7,200	889,272.00	0.58
16	300498	温氏股份	52,400	865,124.00	0.56
17	300002	神州泰岳	67,800	785,802.00	0.51
18	688111	金山办公	2,591	742,036.49	0.48
19	002475	立讯精密	18,100	737,756.00	0.48
20	000651	格力电器	15,200	690,840.00	0.45
21	002432	九安医疗	16,200	660,636.00	0.43
22	002001	新和成	29,800	654,706.00	0.43
23	600887	伊利股份	21,400	645,852.00	0.42
24	600008	首创环保	192,200	630,416.00	0.41

25	601156	东航物流	36,100	609,007.00	0.40
26	605080	浙江自然	25,200	592,200.00	0.39
27	300760	迈瑞医疗	2,300	586,500.00	0.38
28	600827	百联股份	52,200	570,546.00	0.37
29	600266	城建发展	111,800	570,180.00	0.37
30	600216	浙江医药	35,900	569,374.00	0.37
31	300641	正丹股份	22,400	556,416.00	0.36
32	300415	伊之密	27,400	549,644.00	0.36
33	000725	京东方 A	124,100	544,799.00	0.36
34	601966	玲珑轮胎	29,500	532,180.00	0.35
35	605169	洪通燃气	52,300	531,891.00	0.35
36	688658	悦康药业	36,910	531,873.10	0.35
37	603909	建发合诚	57,900	530,364.00	0.35
38	300475	香农芯创	18,600	529,914.00	0.35
39	603176	汇通集团	118,700	528,215.00	0.34
40	600149	廊坊发展	128,800	525,504.00	0.34
41	001332	锡装股份	15,000	523,800.00	0.34
42	600356	恒丰纸业	68,600	523,418.00	0.34
43	688553	汇宇制药	34,397	522,834.40	0.34
44	300881	盛德鑫泰	17,000	522,580.00	0.34
45	688777	中控技术	10,512	522,131.04	0.34
46	002479	富春环保	110,100	521,874.00	0.34
47	600310	广西能源	114,400	521,664.00	0.34
48	688379	华光新材	25,514	520,995.88	0.34
49	603173	福斯达	22,600	520,930.00	0.34
50	603115	海星股份	40,300	520,273.00	0.34
51	603998	方盛制药	49,900	519,958.00	0.34
52	301309	万得凯	21,500	519,655.00	0.34
53	603506	南都物业	61,000	519,110.00	0.34
54	002606	大连电瓷	56,300	519,086.00	0.34
55	000850	华茂股份	125,500	518,315.00	0.34
56	603158	腾龙股份	64,100	517,928.00	0.34
57	002996	顺博合金	78,000	517,920.00	0.34
58	001230	劲旅环境	31,200	517,296.00	0.34
59	600249	两面针	101,600	517,144.00	0.34
60	600261	阳光照明	158,100	516,987.00	0.34
61	603192	汇得科技	34,800	516,432.00	0.34
62	603209	兴通股份	32,300	516,154.00	0.34
63	603890	春秋电子	43,900	515,825.00	0.34

64	301192	泰祥股份	29,500	513,595.00	0.33
65	002714	牧原股份	13,300	511,252.00	0.33
66	301099	雅创电子	12,310	510,249.50	0.33
67	603577	汇金通	63,700	508,963.00	0.33
68	688588	凌志软件	36,245	500,181.00	0.33
69	300124	汇川技术	8,500	497,930.00	0.32
70	601601	中国太保	14,600	497,568.00	0.32
71	688120	华海清科	3,046	496,467.54	0.32
72	002625	光启技术	9,800	468,440.00	0.31
73	601288	农业银行	87,500	467,250.00	0.30
74	301236	软通动力	7,900	463,809.00	0.30
75	300274	阳光电源	6,220	459,222.60	0.30
76	688036	传音控股	4,795	455,525.00	0.30
77	688271	联影医疗	3,530	446,192.00	0.29
78	000953	河化股份	77,800	434,902.00	0.28
79	600865	百大集团	36,900	434,313.00	0.28
80	688617	惠泰医疗	1,154	429,668.82	0.28
81	605305	中际联合	15,100	427,783.00	0.28
82	601688	华泰证券	24,300	427,437.00	0.28
83	600690	海尔智家	14,900	424,203.00	0.28
84	688550	瑞联新材	13,552	424,042.08	0.28
85	601088	中国神华	9,700	421,756.00	0.28
86	300394	天孚通信	4,600	420,256.00	0.27
87	601113	华鼎股份	106,200	414,180.00	0.27
88	300441	鲍斯股份	47,400	413,328.00	0.27
89	300033	同花顺	1,400	402,500.00	0.26
90	600031	三一重工	24,300	400,464.00	0.26
91	002371	北方华创	1,000	391,000.00	0.25
92	688099	晶晨股份	5,667	389,209.56	0.25
93	300408	三环集团	10,100	388,951.00	0.25
94	601988	中国银行	69,600	383,496.00	0.25
95	600919	江苏银行	39,000	382,980.00	0.25
96	000063	中兴通讯	8,700	351,480.00	0.23
97	600406	国电南瑞	13,900	350,558.00	0.23
98	300207	欣旺达	15,700	350,267.00	0.23
99	688169	石头科技	1,578	346,039.62	0.23
100	002352	顺丰控股	8,300	334,490.00	0.22
101	601168	西部矿业	20,800	334,256.00	0.22
102	603501	韦尔股份	3,200	334,112.00	0.22

103	300433	蓝思科技	14,900	326,310.00	0.21
104	600660	福耀玻璃	5,200	324,480.00	0.21
105	002142	宁波银行	13,300	323,323.00	0.21
106	601766	中国中车	38,500	322,630.00	0.21
107	002028	思源电气	4,400	319,880.00	0.21
108	688122	西部超导	7,440	318,580.80	0.21
109	601138	工业富联	14,400	309,600.00	0.20
110	601225	陕西煤业	13,200	307,032.00	0.20
111	002384	东山精密	10,500	306,600.00	0.20
112	300724	捷佳伟创	4,800	303,408.00	0.20
113	002027	分众传媒	40,300	283,309.00	0.18
114	601857	中国石油	31,600	282,504.00	0.18
115	688126	沪硅产业	14,817	278,855.94	0.18
116	688188	柏楚电子	1,399	271,755.75	0.18
117	601211	国泰君安	14,200	264,830.00	0.17
118	002340	格林美	40,300	263,159.00	0.17
119	600066	宇通客车	9,800	258,524.00	0.17
120	300014	亿纬锂能	5,502	257,163.48	0.17
121	601058	赛轮轮胎	17,900	256,507.00	0.17
122	000338	潍柴动力	18,500	253,450.00	0.17
123	600050	中国联通	47,400	251,694.00	0.16
124	002185	华天科技	21,500	249,615.00	0.16
125	300015	爱尔眼科	18,800	249,100.00	0.16
126	000988	华工科技	5,700	246,810.00	0.16
127	300017	网宿科技	23,300	246,281.00	0.16
128	300136	信维通信	9,600	244,224.00	0.16
129	688599	天合光能	12,640	243,952.00	0.16
130	688223	晶科能源	33,960	241,455.60	0.16
131	601628	中国人寿	5,700	238,944.00	0.16
132	603288	海天味业	5,200	238,680.00	0.16
133	601728	中国电信	33,000	238,260.00	0.16
134	000425	徐工机械	29,900	237,107.00	0.15
135	600941	中国移动	2,000	236,320.00	0.15
136	600436	片仔癀	1,100	235,950.00	0.15
137	600089	特变电工	17,920	228,300.80	0.15
138	601668	中国建筑	37,700	226,200.00	0.15
139	300699	光威复材	6,500	225,225.00	0.15
140	002797	第一创业	26,900	224,615.00	0.15
141	300866	安克创新	2,300	224,572.00	0.15

142	300476	胜宏科技	5,300	223,077.00	0.15
143	688065	凯赛生物	5,743	222,828.40	0.15
144	300054	鼎龙股份	8,500	221,170.00	0.14
145	600585	海螺水泥	9,200	218,776.00	0.14
146	000423	东阿阿胶	3,401	213,310.72	0.14
147	688047	龙芯中科	1,600	211,648.00	0.14
148	000933	神火股份	12,500	211,250.00	0.14
149	002273	水晶光电	9,500	211,090.00	0.14
150	601600	中国铝业	28,700	210,945.00	0.14
151	600988	赤峰黄金	13,500	210,735.00	0.14
152	002241	歌尔股份	8,100	209,061.00	0.14
153	300383	光环新网	14,100	205,719.00	0.13
154	688396	华润微	4,358	205,654.02	0.13
155	300661	圣邦股份	2,500	204,450.00	0.13
156	300604	长川科技	4,600	202,998.00	0.13
157	600096	云天化	9,100	202,930.00	0.13
158	600352	浙江龙盛	19,700	202,713.00	0.13
159	603993	洛阳钼业	30,400	202,160.00	0.13
160	600905	三峡能源	45,500	198,835.00	0.13
161	600079	人福医药	8,500	198,730.00	0.13
162	688072	拓荆科技	1,287	197,773.29	0.13
163	601555	东吴证券	25,200	196,560.00	0.13
164	600584	长电科技	4,800	196,128.00	0.13
165	603606	东方电缆	3,700	194,435.00	0.13
166	600885	宏发股份	6,100	194,102.00	0.13
167	601390	中国中铁	30,300	193,617.00	0.13
168	688525	佰维存储	3,120	193,346.40	0.13
169	603986	兆易创新	1,800	192,240.00	0.13
170	600938	中国海油	6,500	191,815.00	0.13
171	601877	正泰电器	8,100	189,621.00	0.12
172	002517	恺英网络	13,700	186,457.00	0.12
173	000630	铜陵有色	57,300	185,079.00	0.12
174	300144	宋城演艺	19,900	184,871.00	0.12
175	300832	新产业	2,600	184,210.00	0.12
176	002202	金风科技	17,800	183,874.00	0.12
177	300763	锦浪科技	3,000	183,210.00	0.12
178	300001	特锐德	8,300	182,185.00	0.12
179	600879	航天电子	20,200	180,992.00	0.12
180	605117	德业股份	2,100	178,080.00	0.12

181	000977	浪潮信息	3,400	176,392.00	0.12
182	601319	中国人保	23,100	176,022.00	0.11
183	601989	中国重工	36,400	175,084.00	0.11
184	300285	国瓷材料	10,200	173,808.00	0.11
185	688187	时代电气	3,620	173,470.40	0.11
186	601567	三星医疗	5,600	172,256.00	0.11
187	000021	深科技	9,000	171,540.00	0.11
188	000776	广发证券	10,400	168,584.00	0.11
189	002078	太阳纸业	11,300	168,031.00	0.11
190	688521	芯原股份	3,203	167,933.29	0.11
191	002008	大族激光	6,700	167,500.00	0.11
192	688200	华峰测控	1,595	166,677.50	0.11
193	688538	和辉光电	71,410	165,671.20	0.11
194	002353	杰瑞股份	4,400	162,756.00	0.11
195	600298	安琪酵母	4,500	162,225.00	0.11
196	002444	巨星科技	5,000	161,750.00	0.11
197	002281	光迅科技	3,100	161,727.00	0.11
198	300529	健帆生物	5,500	161,370.00	0.11
199	600547	山东黄金	7,100	160,673.00	0.10
200	300253	卫宁健康	22,000	157,520.00	0.10
201	300442	润泽科技	3,000	155,880.00	0.10
202	600958	东方证券	14,700	155,232.00	0.10
203	002138	顺络电子	4,900	154,252.00	0.10
204	601669	中国电建	28,100	153,426.00	0.10
205	002532	天山铝业	19,400	152,678.00	0.10
206	603596	伯特利	3,400	151,606.00	0.10
207	600570	恒生电子	5,400	151,146.00	0.10
208	300558	贝达药业	2,800	151,004.00	0.10
209	002595	豪迈科技	3,000	150,570.00	0.10
210	000938	紫光股份	5,400	150,282.00	0.10
211	000783	长江证券	21,900	149,358.00	0.10
212	603799	华友钴业	5,100	149,226.00	0.10
213	601009	南京银行	14,000	149,100.00	0.10
214	688408	中信博	2,070	149,040.00	0.10
215	688180	君实生物	5,421	148,155.93	0.10
216	688303	大全能源	6,110	147,495.40	0.10
217	600745	闻泰科技	3,800	147,364.00	0.10
218	002472	双环传动	4,800	146,976.00	0.10
219	605499	东鹏饮料	580	144,141.60	0.09

220	688213	思特威	1,852	143,937.44	0.09
221	300373	扬杰科技	3,300	143,616.00	0.09
222	002128	电投能源	7,300	142,934.00	0.09
223	600886	国投电力	8,600	142,932.00	0.09
224	300628	亿联网络	3,700	142,820.00	0.09
225	601377	兴业证券	22,700	142,102.00	0.09
226	000166	申万宏源	26,500	141,775.00	0.09
227	300567	精测电子	2,200	141,460.00	0.09
228	601916	浙商银行	48,500	141,135.00	0.09
229	000401	冀东水泥	26,700	139,641.00	0.09
230	601128	常熟银行	18,350	138,909.50	0.09
231	300418	昆仑万维	3,600	138,528.00	0.09
232	301050	雷电微力	2,680	138,234.40	0.09
233	600489	中金黄金	11,400	137,142.00	0.09
234	002850	科达利	1,400	136,752.00	0.09
235	000728	国元证券	16,300	136,268.00	0.09
236	300782	卓胜微	1,500	134,550.00	0.09
237	688385	复旦微电	3,480	133,597.20	0.09
238	688002	睿创微纳	2,837	133,367.37	0.09
239	002311	海大集团	2,700	132,435.00	0.09
240	603087	甘李药业	3,000	132,300.00	0.09
241	600143	金发科技	15,300	132,192.00	0.09
242	300601	康泰生物	7,700	132,055.00	0.09
243	000683	远兴能源	23,600	131,924.00	0.09
244	300122	智飞生物	5,000	131,500.00	0.09
245	601577	长沙银行	14,600	129,794.00	0.08
246	600426	华鲁恒升	6,000	129,660.00	0.08
247	601336	新华保险	2,600	129,220.00	0.08
248	300751	迈为股份	1,220	128,283.00	0.08
249	000821	京山轻机	10,300	128,235.00	0.08
250	600060	海信视像	6,400	127,616.00	0.08
251	002409	雅克科技	2,200	127,490.00	0.08
252	600521	华海药业	7,100	126,877.00	0.08
253	600196	复星医药	5,100	126,735.00	0.08
254	600633	浙数文化	12,100	126,566.00	0.08
255	300347	泰格医药	2,300	125,626.00	0.08
256	601198	东兴证券	11,300	124,413.00	0.08
257	002648	卫星化学	6,600	124,014.00	0.08
258	600390	五矿资本	19,200	123,840.00	0.08

259	603179	新泉股份	2,900	123,830.00	0.08
260	002294	信立泰	4,000	123,720.00	0.08
261	600141	兴发集团	5,700	123,690.00	0.08
262	000623	吉林敖东	7,100	122,617.00	0.08
263	600985	淮北矿业	8,700	122,409.00	0.08
264	002984	森麒麟	4,960	122,313.60	0.08
265	603369	今世缘	2,700	122,121.00	0.08
266	300919	中伟股份	3,380	122,085.60	0.08
267	002920	德赛西威	1,100	121,121.00	0.08
268	002558	巨人网络	9,500	120,555.00	0.08
269	002065	东华软件	16,600	120,516.00	0.08
270	000738	航发控制	5,400	120,096.00	0.08
271	603979	金诚信	3,300	119,790.00	0.08
272	688009	中国通号	19,010	119,002.60	0.08
273	603477	巨星农牧	6,700	118,925.00	0.08
274	600563	法拉电子	1,000	118,920.00	0.08
275	002385	大北农	27,300	118,209.00	0.08
276	600496	精工钢构	39,100	118,082.00	0.08
277	600642	申能股份	12,400	117,676.00	0.08
278	301571	国科天成	2,771	117,347.63	0.08
279	300896	爱美客	640	116,800.00	0.08
280	002152	广电运通	10,000	116,600.00	0.08
281	300088	长信科技	17,700	115,758.00	0.08
282	600486	扬农化工	2,000	115,740.00	0.08
283	600863	内蒙华电	26,700	115,611.00	0.08
284	600019	宝钢股份	16,500	115,500.00	0.08
285	000048	京基智农	6,400	115,200.00	0.08
286	000960	锡业股份	8,200	115,046.00	0.08
287	688506	百利天恒	600	115,038.00	0.08
288	000723	美锦能源	25,500	115,005.00	0.07
289	600073	光明肉业	16,500	114,510.00	0.07
290	002262	恩华药业	4,700	114,445.00	0.07
291	601666	平煤股份	11,400	114,228.00	0.07
292	600637	东方明珠	14,700	114,072.00	0.07
293	002236	大华股份	7,100	113,600.00	0.07
294	600648	外高桥	9,500	113,145.00	0.07
295	688349	三一重能	3,646	112,588.48	0.07
296	600820	隧道股份	15,600	112,164.00	0.07
297	000878	云南铜业	9,200	112,148.00	0.07

298	600248	陕建股份	25,000	112,000.00	0.07
299	603939	益丰药房	4,620	111,480.60	0.07
300	300666	江丰电子	1,600	111,120.00	0.07
301	688082	盛美上海	1,110	111,000.00	0.07
302	000513	丽珠集团	2,900	110,200.00	0.07
303	603893	瑞芯微	1,000	110,060.00	0.07
304	601216	君正集团	20,900	109,934.00	0.07
305	000997	新大陆	5,500	109,725.00	0.07
306	601689	拓普集团	2,235	109,515.00	0.07
307	688220	翱捷科技	2,024	109,478.16	0.07
308	600704	物产中大	21,600	109,296.00	0.07
309	601868	中国能建	47,700	109,233.00	0.07
310	000786	北新建材	3,600	109,116.00	0.07
311	688728	格科微	8,100	108,864.00	0.07
312	600674	川投能源	6,300	108,675.00	0.07
313	601179	中国西电	14,300	108,537.00	0.07
314	601881	中国银河	7,100	108,133.00	0.07
315	002601	龙佰集团	6,100	107,787.00	0.07
316	603301	振德医疗	4,900	107,751.00	0.07
317	600058	五矿发展	15,100	107,512.00	0.07
318	301327	华宝新能	1,400	107,394.00	0.07
319	002155	湖南黄金	6,800	106,964.00	0.07
320	600369	西南证券	22,900	106,943.00	0.07
321	000807	云铝股份	7,900	106,887.00	0.07
322	601838	成都银行	6,200	106,082.00	0.07
323	600529	山东药玻	4,100	105,657.00	0.07
324	000157	中联重科	14,600	105,558.00	0.07
325	300803	指南针	1,100	105,545.00	0.07
326	600699	均胜电子	6,700	104,989.00	0.07
327	000596	古井贡酒	600	103,980.00	0.07
328	601717	郑煤机	8,000	103,840.00	0.07
329	300759	康龙化成	4,000	102,800.00	0.07
330	600176	中国巨石	8,900	101,371.00	0.07
331	000895	双汇发展	3,900	101,244.00	0.07
332	600170	上海建工	38,000	100,700.00	0.07
333	600177	雅戈尔	11,300	100,570.00	0.07
334	002405	四维图新	10,300	99,292.00	0.06
335	600498	烽火通信	5,100	99,246.00	0.06
336	688161	威高骨科	3,929	99,089.38	0.06

337	002871	伟隆股份	10,200	98,838.00	0.06
338	000729	燕京啤酒	8,200	98,728.00	0.06
339	600219	南山铝业	25,200	98,532.00	0.06
340	600901	江苏金租	18,800	98,136.00	0.06
341	601117	中国化学	11,800	97,822.00	0.06
342	688608	恒玄科技	300	97,611.00	0.06
343	000636	风华高科	6,800	97,580.00	0.06
344	601456	国联民生	7,200	97,344.00	0.06
345	600348	华阳股份	13,700	97,133.00	0.06
346	301269	华大九天	800	96,880.00	0.06
347	000975	山金国际	6,300	96,831.00	0.06
348	603076	乐惠国际	4,200	96,768.00	0.06
349	601566	九牧王	11,500	96,715.00	0.06
350	688070	纵横股份	2,735	96,545.50	0.06
351	688117	圣诺生物	3,757	96,442.19	0.06
352	603600	永艺股份	8,100	96,309.00	0.06
353	688093	世华科技	4,765	96,205.35	0.06
354	603768	常青股份	8,000	96,160.00	0.06
355	002059	云南旅游	17,800	95,942.00	0.06
356	002180	纳思达	3,400	95,778.00	0.06
357	688251	井松智能	5,923	95,715.68	0.06
358	002901	大博医疗	3,100	95,604.00	0.06
359	002671	龙泉股份	21,100	95,583.00	0.06
360	002044	美年健康	20,800	95,472.00	0.06
361	605259	绿田机械	6,300	95,445.00	0.06
362	301158	德石股份	6,800	95,404.00	0.06
363	600638	新黄浦	18,700	95,370.00	0.06
364	002970	锐明技术	2,000	95,260.00	0.06
365	600981	汇鸿集团	36,900	95,202.00	0.06
366	688330	宏力达	3,627	95,172.48	0.06
367	603086	先达股份	22,200	95,016.00	0.06
368	600128	苏豪弘业	11,700	95,004.00	0.06
369	688121	卓然股份	8,820	94,991.40	0.06
370	605138	盛泰集团	17,200	94,944.00	0.06
371	688557	兰剑智能	4,948	94,853.16	0.06
372	002938	鹏鼎控股	2,600	94,848.00	0.06
373	300069	金利华电	7,200	94,824.00	0.06
374	603385	惠达卫浴	14,900	94,764.00	0.06
375	002394	联发股份	12,600	94,752.00	0.06

375	300804	广康生化	4,200	94,752.00	0.06
376	688211	中科微至	3,238	94,711.50	0.06
377	300986	志特新材	7,800	94,692.00	0.06
378	000830	鲁西化工	8,100	94,689.00	0.06
379	688367	工大高科	6,163	94,663.68	0.06
380	002440	闰土股份	14,100	94,611.00	0.06
381	002696	百洋股份	20,000	94,600.00	0.06
382	000638	万方发展	20,300	94,598.00	0.06
383	688319	欧林生物	8,923	94,583.80	0.06
384	301448	开创电气	4,600	94,576.00	0.06
385	603235	天新药业	3,700	94,572.00	0.06
386	688212	澳华内镜	2,353	94,543.54	0.06
387	688558	国盛智科	4,428	94,537.80	0.06
388	600969	郴电国际	14,700	94,521.00	0.06
389	002538	司尔特	16,800	94,416.00	0.06
390	300979	华利集团	1,200	94,380.00	0.06
391	300234	开尔新材	20,200	94,334.00	0.06
392	688371	菲沃泰	6,072	94,237.44	0.06
393	603151	邦基科技	9,400	94,094.00	0.06
394	688772	珠海冠宇	5,851	94,084.08	0.06
395	603586	金麒麟	6,500	94,055.00	0.06
396	601002	晋亿实业	21,600	93,960.00	0.06
397	600758	辽宁能源	27,300	93,912.00	0.06
398	000060	中金岭南	20,000	93,800.00	0.06
399	002476	宝莫股份	22,200	93,684.00	0.06
400	300950	德固特	5,800	93,670.00	0.06
401	000965	天保基建	31,200	93,600.00	0.06
402	601177	杭齿前进	11,300	93,564.00	0.06
403	300573	兴齐眼药	1,340	93,505.20	0.06
404	000985	大庆华科	5,000	93,500.00	0.06
405	300474	景嘉微	1,000	93,490.00	0.06
406	301112	信邦智能	4,000	93,480.00	0.06
406	600731	湖南海利	16,400	93,480.00	0.06
407	000963	华东医药	2,700	93,420.00	0.06
408	688616	西力科技	8,991	93,416.49	0.06
409	301022	海泰科	4,600	93,380.00	0.06
410	002228	合兴包装	31,100	93,300.00	0.06
411	688419	耐科装备	3,000	93,240.00	0.06
412	688328	深科达	6,215	93,100.70	0.06

413	688312	燕麦科技	3,020	93,016.00	0.06
414	300743	天地数码	6,100	92,903.00	0.06
415	300515	三德科技	7,800	92,898.00	0.06
416	600592	龙溪股份	9,400	92,872.00	0.06
417	688296	和达科技	8,271	92,800.62	0.06
418	603838	四通股份	16,600	92,794.00	0.06
419	301503	智迪科技	2,700	92,664.00	0.06
420	002546	新联电子	21,400	92,662.00	0.06
421	688345	博力威	5,097	92,612.49	0.06
422	002295	精艺股份	14,400	92,592.00	0.06
423	300771	智莱科技	8,800	92,576.00	0.06
424	301613	新铝时代	1,619	92,564.23	0.06
425	000957	中通客车	8,400	92,400.00	0.06
426	002980	华盛昌	3,600	92,340.00	0.06
427	002500	山西证券	14,700	92,316.00	0.06
428	600546	山煤国际	7,800	92,274.00	0.06
429	003005	竞业达	3,400	92,208.00	0.06
430	603680	今创集团	11,100	92,130.00	0.06
431	600909	华安证券	15,200	92,112.00	0.06
432	300508	维宏股份	3,400	91,970.00	0.06
433	688363	华熙生物	1,800	91,872.00	0.06
434	603861	白云电器	10,200	91,800.00	0.06
435	603618	杭电股份	16,900	91,767.00	0.06
436	600021	上海电力	10,000	91,700.00	0.06
437	603338	浙江鼎力	1,400	90,328.00	0.06
438	688114	华大智造	1,920	89,836.80	0.06
439	300496	中科创达	1,500	89,340.00	0.06
440	600583	海油工程	16,300	89,161.00	0.06
441	002074	国轩高科	4,200	89,124.00	0.06
442	600970	中材国际	9,400	89,112.00	0.06
443	002507	涪陵榨菜	6,300	89,019.00	0.06
444	600183	生益科技	3,700	88,985.00	0.06
445	600511	国药股份	2,600	88,972.00	0.06
446	688307	中润光学	3,697	88,728.00	0.06
447	603568	伟明环保	4,100	88,683.00	0.06
448	600415	小商品城	6,600	88,506.00	0.06
449	300677	英科医疗	3,500	88,480.00	0.06
450	002130	沃尔核材	3,500	88,375.00	0.06
451	688233	神工股份	3,747	87,867.15	0.06

452	600859	王府井	5,700	87,837.00	0.06
453	601016	节能风电	27,700	87,809.00	0.06
454	600100	同方股份	12,300	87,453.00	0.06
455	002683	广东宏大	3,300	87,384.00	0.06
456	300316	晶盛机电	2,700	86,130.00	0.06
457	300450	先导智能	4,300	86,086.00	0.06
458	300142	沃森生物	7,100	85,768.00	0.06
459	000887	中鼎股份	6,500	85,280.00	0.06
460	002368	太极股份	3,600	85,248.00	0.06
461	600233	圆通速递	6,000	85,140.00	0.06
462	688234	天岳先进	1,660	84,992.00	0.06
463	002120	韵达股份	11,300	84,976.00	0.06
464	600208	衢州发展	28,700	84,952.00	0.06
465	300346	南大光电	2,200	84,898.00	0.06
466	000528	柳工	7,000	84,420.00	0.06
467	601618	中国中冶	25,400	83,820.00	0.05
468	600380	健康元	7,400	83,398.00	0.05
469	000999	华润三九	1,870	82,915.80	0.05
470	600582	天地科技	13,400	82,812.00	0.05
471	600598	北大荒	5,600	82,600.00	0.05
472	300623	捷捷微电	2,400	81,984.00	0.05
473	300223	北京君正	1,200	81,840.00	0.05
474	300682	朗新集团	6,700	81,740.00	0.05
475	300999	金龙鱼	2,500	81,525.00	0.05
476	300458	全志科技	2,100	81,396.00	0.05
477	600282	南钢股份	17,200	80,668.00	0.05
478	600004	白云机场	8,400	80,640.00	0.05
479	002429	兆驰股份	13,900	80,342.00	0.05
480	600271	航天信息	8,800	80,168.00	0.05
481	003816	中国广核	19,400	80,122.00	0.05
482	002373	千方科技	7,900	80,106.00	0.05
483	002653	海思科	2,400	79,800.00	0.05
484	300037	新宙邦	2,100	78,624.00	0.05
485	002831	裕同科技	2,900	78,590.00	0.05
486	000598	兴蓉环境	10,300	78,177.00	0.05
487	688301	奕瑞科技	814	77,793.98	0.05
488	600741	华域汽车	4,400	77,484.00	0.05
489	002926	华西证券	9,300	77,283.00	0.05
490	000876	新希望	8,600	77,228.00	0.05

491	301358	湖南裕能	1,700	77,044.00	0.05
492	600499	科达制造	9,800	76,440.00	0.05
493	000739	普洛药业	4,700	76,422.00	0.05
494	600998	九州通	14,880	76,185.60	0.05
495	002736	国信证券	6,800	76,160.00	0.05
496	301301	川宁生物	6,400	75,904.00	0.05
497	300012	华测检测	6,100	75,823.00	0.05
498	002557	洽洽食品	2,600	75,530.00	0.05
499	601898	中煤能源	6,200	75,516.00	0.05
500	688561	奇安信	2,800	75,124.00	0.05
501	601991	大唐发电	26,100	74,385.00	0.05
502	600362	江西铜业	3,600	74,304.00	0.05
503	000034	神州数码	2,100	73,605.00	0.05
504	002019	亿帆医药	6,800	72,896.00	0.05
505	002837	英维克	1,800	72,720.00	0.05
506	300413	芒果超媒	2,700	72,603.00	0.05
507	300073	当升科技	1,800	72,504.00	0.05
508	600399	抚顺特钢	12,500	72,500.00	0.05
509	300395	菲利华	1,900	71,459.00	0.05
510	600312	平高电气	3,700	71,040.00	0.05
511	002203	海亮股份	6,600	70,950.00	0.05
512	002252	上海莱士	9,800	70,756.00	0.05
513	603005	晶方科技	2,500	70,625.00	0.05
514	603298	杭叉集团	3,940	70,486.60	0.05
515	002318	久立特材	3,000	70,230.00	0.05
516	600801	华新水泥	5,800	70,180.00	0.05
517	688019	安集科技	500	69,680.00	0.05
518	603228	景旺电子	2,500	69,600.00	0.05
519	000709	河钢股份	31,400	69,394.00	0.05
520	002080	中材科技	5,300	69,324.00	0.05
521	600062	华润双鹤	3,500	69,300.00	0.05
522	600559	老白干酒	3,300	69,267.00	0.05
523	002126	银轮股份	3,700	69,264.00	0.05
524	600968	海油发展	16,200	69,174.00	0.05
525	600258	首旅酒店	4,700	68,949.00	0.04
526	301308	江波龙	800	68,800.00	0.04
527	000983	山西焦煤	8,300	68,392.00	0.04
528	600959	江苏有线	20,200	67,670.00	0.04
529	601799	星宇股份	500	66,740.00	0.04

530	600056	中国医药	6,000	66,600.00	0.04
531	300115	长盈精密	4,100	66,584.00	0.04
532	688516	奥特维	1,535	66,480.85	0.04
533	605589	圣泉集团	2,800	66,024.00	0.04
534	600027	华电国际	11,700	65,637.00	0.04
535	600875	东方电气	4,100	65,149.00	0.04
536	601677	明泰铝业	5,400	64,962.00	0.04
537	601098	中南传媒	4,300	64,543.00	0.04
538	300674	宇信科技	3,300	64,416.00	0.04
539	600528	中铁工业	7,900	63,674.00	0.04
540	603129	春风动力	400	62,828.00	0.04
541	002266	浙富控股	20,100	62,712.00	0.04
542	601231	环旭电子	3,800	62,700.00	0.04
543	600332	白云山	2,200	62,524.00	0.04
544	603707	健友股份	4,700	62,369.00	0.04
545	603379	三美股份	1,600	61,408.00	0.04
546	601611	中国核建	6,700	60,568.00	0.04
547	300003	乐普医疗	5,300	60,102.00	0.04
548	002299	圣农发展	4,100	59,368.00	0.04
549	688578	艾力斯	990	59,301.00	0.04
550	688063	派能科技	1,480	59,274.00	0.04
551	688029	南微医学	875	59,141.25	0.04
552	000987	越秀资本	8,400	58,968.00	0.04
553	300182	捷成股份	10,000	58,700.00	0.04
554	300251	光线传媒	6,200	58,528.00	0.04
555	300627	华测导航	1,400	58,520.00	0.04
556	301626	苏州天脉	682	58,290.54	0.04
557	601918	新集能源	8,100	58,158.00	0.04
558	300390	天华新能	2,500	57,625.00	0.04
559	001286	陕西能源	6,200	57,536.00	0.04
560	300454	深信服	1,000	57,400.00	0.04
561	000917	电广传媒	8,100	57,267.00	0.04
562	002139	拓邦股份	4,200	57,162.00	0.04
563	000415	渤海租赁	15,100	56,927.00	0.04
564	300296	利亚德	8,800	56,672.00	0.04
565	000686	东北证券	7,000	55,580.00	0.04
566	600848	上海临港	5,500	55,550.00	0.04
567	600023	浙能电力	9,800	55,468.00	0.04
568	002222	福晶科技	1,700	55,080.00	0.04

569	600995	南网储能	5,400	54,648.00	0.04
570	601965	中国汽研	3,100	54,622.00	0.04
571	605111	新洁能	1,600	54,256.00	0.04
572	300679	电连技术	900	53,730.00	0.04
573	000875	吉电股份	10,200	53,652.00	0.03
574	300857	协创数据	500	53,445.00	0.03
575	688375	国博电子	1,072	52,913.92	0.03
576	300487	蓝晓科技	1,100	52,657.00	0.03
577	688050	爱博医疗	578	52,615.34	0.03
578	688278	特宝生物	714	52,386.18	0.03
579	688425	铁建重工	11,853	52,153.20	0.03
580	601333	广深铁路	15,200	52,136.00	0.03
581	300146	汤臣倍健	4,300	51,815.00	0.03
582	002841	视源股份	1,400	51,674.00	0.03
583	000503	国新健康	4,700	51,606.00	0.03
584	300568	星源材质	5,300	51,516.00	0.03
585	002145	中核钛白	12,100	51,304.00	0.03
586	603225	新风鸣	4,600	51,198.00	0.03
587	600761	安徽合力	2,900	51,185.00	0.03
588	600039	四川路桥	7,000	50,960.00	0.03
589	300777	中简科技	1,800	50,922.00	0.03
590	600718	东软集团	4,700	50,619.00	0.03
591	601001	晋控煤业	3,700	50,579.00	0.03
592	603296	华勤技术	700	49,665.00	0.03
593	600098	广州发展	7,700	49,434.00	0.03
594	300083	创世纪	7,500	48,825.00	0.03
595	600285	羚锐制药	2,200	48,752.00	0.03
596	000403	派林生物	2,300	48,599.00	0.03
597	600667	太极实业	7,000	48,440.00	0.03
598	600350	山东高速	4,700	48,316.00	0.03
599	688475	萤石网络	1,600	48,304.00	0.03
600	300827	上能电气	1,100	48,290.00	0.03
601	603233	大参林	3,200	48,192.00	0.03
602	600764	中国海防	1,700	48,144.00	0.03
603	000422	湖北宜化	3,800	47,956.00	0.03
604	600517	国网英大	8,700	47,937.00	0.03
605	603236	移远通信	700	47,908.00	0.03
606	600850	电科数字	2,000	47,800.00	0.03
607	002332	仙琚制药	4,800	47,712.00	0.03

608	600967	内蒙一机	5,600	47,600.00	0.03
609	600323	瀚蓝环境	2,000	47,240.00	0.03
610	600550	保变电气	6,000	47,100.00	0.03
611	300212	易华录	2,000	46,800.00	0.03
612	300118	东方日升	3,900	46,722.00	0.03
613	300748	金力永磁	2,600	46,488.00	0.03
614	000883	湖北能源	9,300	46,314.00	0.03
615	300133	华策影视	6,400	46,208.00	0.03
616	300432	富临精工	3,000	46,140.00	0.03
617	000682	东方电子	4,300	46,053.00	0.03
618	603517	绝味食品	2,800	46,032.00	0.03
619	688568	中科星图	899	45,875.97	0.03
620	601298	青岛港	5,000	45,550.00	0.03
621	000581	威孚高科	2,400	45,312.00	0.03
622	002402	和而泰	2,500	45,275.00	0.03
623	600338	西藏珠峰	4,200	44,814.00	0.03
624	688281	华秦科技	480	44,688.00	0.03
625	002249	大洋电机	7,600	44,612.00	0.03
626	603218	日月股份	3,700	44,585.00	0.03
627	300070	碧水源	8,800	44,528.00	0.03
628	688208	道通科技	1,126	44,094.16	0.03
629	300229	拓尔思	2,100	43,974.00	0.03
630	002270	华明装备	2,600	43,914.00	0.03
631	301035	润丰股份	900	43,848.00	0.03
632	300570	太辰光	600	43,620.00	0.03
633	002063	远光软件	7,500	43,200.00	0.03
634	002400	省广集团	5,400	43,146.00	0.03
635	601528	瑞丰银行	7,600	42,788.00	0.03
636	002245	蔚蓝锂芯	4,000	42,760.00	0.03
637	600685	中船防务	1,800	42,660.00	0.03
638	300765	新诺威	1,600	42,544.00	0.03
639	000156	华数传媒	5,900	42,480.00	0.03
640	300294	博雅生物	1,400	42,392.00	0.03
641	600663	陆家嘴	4,300	42,312.00	0.03
642	300525	博思软件	2,700	42,066.00	0.03
643	300738	奥飞数据	2,900	42,050.00	0.03
644	300676	华大基因	1,000	41,970.00	0.03
645	603766	隆鑫通用	4,600	41,860.00	0.03
646	300009	安科生物	4,800	41,472.00	0.03

647	688605	先锋精科	584	41,393.92	0.03
648	601399	国机重装	13,400	41,272.00	0.03
649	001301	尚太科技	600	41,130.00	0.03
650	601222	林洋能源	5,800	41,006.00	0.03
651	600577	精达股份	5,600	40,824.00	0.03
652	603083	剑桥科技	1,000	40,600.00	0.03
653	688088	虹软科技	1,052	40,565.12	0.03
654	600821	金开新能	7,500	40,500.00	0.03
655	600578	京能电力	11,500	40,480.00	0.03
656	600064	南京高科	5,200	40,404.00	0.03
657	601992	金隅集团	22,500	40,050.00	0.03
658	300595	欧普康视	2,100	39,795.00	0.03
659	000967	盈峰环境	8,000	39,760.00	0.03
660	300170	汉得信息	3,200	39,680.00	0.03
661	600339	中油工程	11,000	39,380.00	0.03
662	603393	新天然气	1,300	39,351.00	0.03
663	000951	中国重汽	2,300	39,054.00	0.03
664	300303	聚飞光电	5,700	38,874.00	0.03
665	000543	皖能电力	4,900	38,759.00	0.03
666	002212	天融信	6,000	38,700.00	0.03
667	300319	麦捷科技	3,100	38,688.00	0.03
668	600750	江中药业	1,700	38,590.00	0.03
669	600120	浙江东方	8,200	38,212.00	0.02
669	600572	康恩贝	8,200	38,212.00	0.02
670	300776	帝尔激光	600	38,148.00	0.02
671	002221	东华能源	4,000	37,960.00	0.02
672	600728	佳都科技	8,100	37,908.00	0.02
673	000902	新洋丰	2,900	37,816.00	0.02
674	601607	上海医药	1,800	37,800.00	0.02
675	000708	中信特钢	3,300	37,653.00	0.02
675	600552	凯盛科技	3,300	37,653.00	0.02
676	601778	晶科科技	13,300	37,506.00	0.02
677	002617	露笑科技	4,900	37,485.00	0.02
678	300775	三角防务	1,500	37,395.00	0.02
679	300035	中科电气	2,500	37,375.00	0.02
680	300236	上海新阳	1,000	37,370.00	0.02
681	601126	四方股份	2,200	37,312.00	0.02
682	600320	振华重工	9,500	37,240.00	0.02
683	300618	寒锐钴业	1,100	37,147.00	0.02

684	603786	科博达	600	37,080.00	0.02
685	600330	天通股份	5,200	36,920.00	0.02
686	603678	火炬电子	1,200	36,600.00	0.02
687	601137	博威合金	1,800	36,540.00	0.02
688	002597	金禾实业	1,600	36,528.00	0.02
689	600422	昆药集团	2,300	36,455.00	0.02
690	603300	海南华铁	6,300	36,414.00	0.02
691	688819	天能股份	1,335	36,338.70	0.02
692	601019	山东出版	3,200	36,320.00	0.02
693	002396	星网锐捷	1,900	36,081.00	0.02
694	002079	苏州固锝	3,500	35,945.00	0.02
695	300079	数码视讯	6,600	35,706.00	0.02
696	000537	中绿电	3,900	35,568.00	0.02
697	688018	乐鑫科技	163	35,534.00	0.02
698	603323	苏农银行	6,700	35,443.00	0.02
699	688183	生益电子	900	35,334.00	0.02
700	002649	博彦科技	2,900	35,148.00	0.02
701	600299	安迪苏	2,800	35,140.00	0.02
702	300101	振芯科技	1,600	34,656.00	0.02
703	688409	富创精密	672	34,655.04	0.02
704	002123	梦网科技	3,200	34,592.00	0.02
705	000969	安泰科技	3,100	34,565.00	0.02
706	688798	艾为电子	495	34,560.90	0.02
707	600864	哈投股份	4,700	34,545.00	0.02
708	300352	北信源	6,500	34,320.00	0.02
709	300638	广和通	1,700	34,255.00	0.02
710	600993	马应龙	1,300	33,943.00	0.02
711	300888	稳健医疗	800	33,664.00	0.02
712	300113	顺网科技	2,000	33,620.00	0.02
713	601808	中海油服	2,200	33,550.00	0.02
714	600420	国药现代	2,800	33,432.00	0.02
715	000681	视觉中国	1,600	33,312.00	0.02
716	600587	新华医疗	2,000	33,300.00	0.02
717	300769	德方纳米	900	33,192.00	0.02
718	600210	紫江企业	5,000	33,050.00	0.02
719	002948	青岛银行	8,500	32,980.00	0.02
720	600273	嘉化能源	4,100	32,677.00	0.02
721	603690	至纯科技	1,300	32,643.00	0.02
722	600933	爱柯迪	2,000	32,600.00	0.02

723	688789	宏华数科	490	32,526.20	0.02
724	600928	西安银行	9,000	32,490.00	0.02
725	603308	应流股份	2,300	32,430.00	0.02
726	002468	申通快递	3,200	32,416.00	0.02
727	300811	铂科新材	600	32,346.00	0.02
728	601678	滨化股份	8,600	32,336.00	0.02
729	300633	开立医疗	1,100	32,329.00	0.02
730	002698	博实股份	1,900	32,300.00	0.02
730	300151	昌红科技	1,900	32,300.00	0.02
731	002004	华邦健康	7,100	32,092.00	0.02
732	603317	天味食品	2,400	32,016.00	0.02
733	002020	京新药业	2,500	32,000.00	0.02
734	603588	高能环境	6,100	31,964.00	0.02
735	300685	艾德生物	1,400	31,920.00	0.02
736	600461	洪城环境	3,200	31,840.00	0.02
737	600925	苏能股份	6,000	31,800.00	0.02
738	600986	浙文互联	5,300	31,694.00	0.02
739	600459	贵研铂业	2,300	31,579.00	0.02
740	600267	海正药业	3,800	31,540.00	0.02
741	300482	万孚生物	1,400	31,374.00	0.02
742	300034	钢研高纳	2,000	31,200.00	0.02
743	688076	诺泰生物	600	31,152.00	0.02
744	300031	宝通科技	1,700	31,144.00	0.02
745	002100	天康生物	4,700	30,785.00	0.02
746	002906	华阳集团	1,000	30,750.00	0.02
747	600328	中盐化工	3,900	30,693.00	0.02
748	688596	正帆科技	840	29,862.00	0.02
749	600037	歌华有线	4,000	29,840.00	0.02
750	002539	云图控股	3,800	29,716.00	0.02
751	603556	海兴电力	800	29,592.00	0.02
752	002567	唐人神	5,800	29,580.00	0.02
753	300783	三只松鼠	800	29,496.00	0.02
754	002701	奥瑞金	5,200	29,484.00	0.02
755	002023	海特高新	2,900	29,435.00	0.02
756	002237	恒邦股份	2,900	29,290.00	0.02
757	603281	江瀚新材	1,200	29,280.00	0.02
757	688348	昱能科技	600	29,280.00	0.02
758	300613	富瀚微	500	29,250.00	0.02
759	600717	天津港	6,000	29,220.00	0.02

760	300620	光库科技	600	29,160.00	0.02
761	300463	迈克生物	2,200	29,040.00	0.02
762	601311	骆驼股份	3,500	29,015.00	0.02
763	603267	鸿远电子	800	28,984.00	0.02
764	300203	聚光科技	1,900	28,937.00	0.02
765	301165	锐捷网络	400	28,880.00	0.02
766	601236	红塔证券	3,400	28,866.00	0.02
767	603699	纽威股份	1,300	28,821.00	0.02
768	002091	江苏国泰	3,900	28,548.00	0.02
769	002043	兔宝宝	2,400	28,512.00	0.02
770	002421	达实智能	8,300	28,469.00	0.02
771	600509	天富能源	4,400	28,468.00	0.02
772	300634	彩讯股份	1,300	28,340.00	0.02
773	301171	易点天下	1,000	28,190.00	0.02
774	002446	盛路通信	4,300	28,165.00	0.02
775	002351	漫步者	1,700	28,050.00	0.02
776	600595	中孚实业	9,900	28,017.00	0.02
777	300768	迪普科技	1,600	28,000.00	0.02
778	002928	华夏航空	3,600	27,936.00	0.02
779	601208	东材科技	3,700	27,898.00	0.02
780	002048	宁波华翔	2,200	27,764.00	0.02
781	000685	中山公用	3,000	27,690.00	0.02
781	600888	新疆众和	3,900	27,690.00	0.02
782	002233	塔牌集团	3,600	27,612.00	0.02
783	000735	罗牛山	4,100	27,306.00	0.02
784	300761	立华股份	1,400	27,244.00	0.02
785	300244	迪安诊断	2,400	27,240.00	0.02
786	600055	万东医疗	1,800	27,180.00	0.02
786	603881	数据港	1,200	27,180.00	0.02
787	002895	川恒股份	1,100	27,060.00	0.02
788	688362	甬矽电子	800	26,944.00	0.02
789	300705	九典制药	1,500	26,925.00	0.02
790	002608	江苏国信	3,500	26,845.00	0.02
791	688403	汇成股份	2,995	26,835.20	0.02
792	300232	洲明科技	3,900	26,793.00	0.02
793	301155	海力风电	500	26,655.00	0.02
794	300772	运达股份	2,000	26,480.00	0.02
795	600063	皖维高新	6,600	26,400.00	0.02
796	300470	中密控股	700	26,390.00	0.02

797	002015	协鑫能科	3,400	26,384.00	0.02
798	600138	中青旅	2,600	26,364.00	0.02
799	001309	德明利	300	26,160.00	0.02
800	002945	华林证券	1,700	26,061.00	0.02
801	301293	三博脑科	600	25,968.00	0.02
802	301611	珂玛科技	463	25,960.41	0.02
803	300443	金雷股份	1,300	25,896.00	0.02
804	000049	德赛电池	1,100	25,861.00	0.02
805	688739	成大生物	1,000	25,780.00	0.02
806	688248	南网科技	800	25,672.00	0.02
807	300957	贝泰妮	600	25,614.00	0.02
808	603713	密尔克卫	500	25,600.00	0.02
809	002773	康弘药业	1,300	25,480.00	0.02
809	603565	中谷物流	2,600	25,480.00	0.02
810	002226	江南化工	4,700	25,474.00	0.02
811	600269	赣粤高速	4,500	25,245.00	0.02
812	301551	无线传媒	581	25,197.97	0.02
813	600478	科力远	6,100	25,193.00	0.02
814	002541	鸿路钢构	1,400	25,102.00	0.02
815	002847	盐津铺子	400	25,040.00	0.02
816	600366	宁波韵升	3,400	25,024.00	0.02
817	600575	淮河能源	6,300	25,011.00	0.02
818	002315	焦点科技	600	25,008.00	0.02
819	603368	柳药集团	1,400	25,004.00	0.02
820	605507	国邦医药	1,200	24,996.00	0.02
821	688158	优刻得	1,783	24,926.34	0.02
822	600059	古越龙山	2,800	24,864.00	0.02
823	002550	千红制药	4,000	24,800.00	0.02
824	600305	恒顺醋业	3,100	24,738.00	0.02
825	603039	泛微网络	500	24,500.00	0.02
826	300409	道氏技术	1,800	24,498.00	0.02
827	300357	我武生物	1,200	24,384.00	0.02
828	600458	时代新材	1,900	24,339.00	0.02
829	300770	新媒股份	600	24,246.00	0.02
830	601890	亚星锚链	3,100	24,149.00	0.02
831	600017	日照港	7,500	24,000.00	0.02
831	600110	诺德股份	6,000	24,000.00	0.02
832	600502	安徽建工	5,000	23,900.00	0.02
833	300119	瑞普生物	1,300	23,881.00	0.02

834	601200	上海环境	2,900	23,693.00	0.02
835	300687	赛意信息	1,300	23,660.00	0.02
836	688449	联芸科技	628	23,650.48	0.02
837	300398	飞凯材料	1,500	23,640.00	0.02
838	601369	陕鼓动力	2,700	23,490.00	0.02
839	000913	钱江摩托	1,300	23,413.00	0.02
840	688372	伟测科技	400	23,408.00	0.02
841	000028	国药一致	800	23,400.00	0.02
842	688380	中微半导	780	23,322.00	0.02
843	600557	康缘药业	1,700	23,154.00	0.02
844	600757	长江传媒	2,400	22,968.00	0.01
845	603612	索通发展	1,700	22,967.00	0.01
846	000928	中钢国际	3,600	22,932.00	0.01
847	001270	铖昌科技	600	22,860.00	0.01
848	002061	浙江交科	5,600	22,848.00	0.01
849	688100	威胜信息	630	22,806.00	0.01
850	688332	中科蓝讯	174	22,707.00	0.01
851	688123	聚辰股份	388	22,705.76	0.01
852	300263	隆华科技	3,100	22,630.00	0.01
853	301219	腾远钴业	500	22,605.00	0.01
854	600340	华夏幸福	8,400	22,596.00	0.01
855	688388	嘉元科技	1,530	22,536.90	0.01
856	600033	福建高速	5,800	22,504.00	0.01
857	600531	豫光金铅	3,500	22,470.00	0.01
858	600295	鄂尔多斯	2,300	22,448.00	0.01
859	001287	中电港	1,100	22,341.00	0.01
860	603888	新华网	1,000	22,340.00	0.01
861	600710	苏美达	2,400	22,320.00	0.01
862	003021	兆威机电	300	22,173.00	0.01
863	600007	中国国贸	900	22,014.00	0.01
864	601702	华峰铝业	1,200	21,984.00	0.01
865	301291	明阳电气	500	21,960.00	0.01
866	600391	航发科技	1,100	21,835.00	0.01
867	000935	四川双马	1,500	21,720.00	0.01
868	600490	鹏欣资源	6,600	21,714.00	0.01
868	600643	爱建集团	4,200	21,714.00	0.01
869	688127	蓝特光学	800	21,680.00	0.01
870	600361	创新新材	5,600	21,616.00	0.01
871	003006	百亚股份	900	21,591.00	0.01

872	603100	川仪股份	1,000	21,550.00	0.01
873	688389	普门科技	1,441	21,456.49	0.01
874	002891	中宠股份	600	21,420.00	0.01
874	688131	皓元医药	600	21,420.00	0.01
875	601101	昊华能源	2,600	21,398.00	0.01
876	600861	北京人力	1,100	21,285.00	0.01
877	002626	金达威	1,400	21,140.00	0.01
878	000550	江铃汽车	900	21,105.00	0.01
879	603936	博敏电子	2,500	21,050.00	0.01
880	002274	华昌化工	2,700	20,979.00	0.01
881	000966	长源电力	4,400	20,900.00	0.01
882	301031	中熔电气	200	20,804.00	0.01
883	688630	芯碁微装	360	20,779.20	0.01
884	600480	凌云股份	1,900	20,539.00	0.01
885	600729	重庆百货	700	20,475.00	0.01
886	002108	沧州明珠	5,700	20,463.00	0.01
887	000795	英洛华	2,100	20,433.00	0.01
888	002250	联化科技	3,700	20,387.00	0.01
889	605376	博迁新材	700	20,265.00	0.01
890	002194	武汉凡谷	1,800	20,196.00	0.01
891	002291	遥望科技	3,200	20,192.00	0.01
892	301556	托普云农	267	20,174.52	0.01
893	688800	瑞可达	400	20,044.00	0.01
894	688295	中复神鹰	1,000	19,930.00	0.01
895	000950	重药控股	3,700	19,906.00	0.01
896	300039	上海凯宝	3,200	19,776.00	0.01
897	603328	依顿电子	2,000	19,720.00	0.01
898	688185	康希诺	323	19,719.15	0.01
899	002967	广电计量	1,200	19,680.00	0.01
900	600961	株冶集团	2,500	19,675.00	0.01
901	601163	三角轮胎	1,300	19,591.00	0.01
902	002390	信邦制药	4,300	19,565.00	0.01
903	000065	北方国际	2,000	19,560.00	0.01
904	002705	新宝股份	1,300	19,500.00	0.01
905	603876	鼎胜新材	2,200	19,470.00	0.01
906	301363	美好医疗	600	19,452.00	0.01
907	688300	联瑞新材	302	19,448.80	0.01
908	300821	东岳硅材	2,500	19,400.00	0.01
909	688692	达梦数据	53	19,315.32	0.01

910	600169	太原重工	7,700	19,173.00	0.01
911	600682	南京新百	2,800	19,152.00	0.01
912	300323	华灿光电	2,300	19,044.00	0.01
913	002258	利尔化学	2,300	19,021.00	0.01
914	688023	安恒信息	465	18,972.00	0.01
915	000061	农产品	2,700	18,927.00	0.01
916	300587	天铁科技	4,300	18,877.00	0.01
917	300579	数字认证	600	18,852.00	0.01
918	002585	双星新材	3,500	18,690.00	0.01
918	603118	共进股份	2,100	18,690.00	0.01
919	002859	洁美科技	900	18,675.00	0.01
920	300726	宏达电子	600	18,660.00	0.01
921	601619	嘉泽新能	5,600	18,592.00	0.01
922	603638	艾迪精密	1,100	18,579.00	0.01
923	300527	中船应急	2,300	18,561.00	0.01
924	002987	京北方	1,300	18,499.00	0.01
925	002204	大连重工	3,700	18,426.00	0.01
926	300143	盈康生命	2,000	18,400.00	0.01
927	300596	利安隆	600	18,300.00	0.01
928	002125	湘潭电化	1,800	18,144.00	0.01
929	002283	天润工业	3,400	18,088.00	0.01
930	600449	宁夏建材	1,200	18,024.00	0.01
931	603128	华贸物流	2,800	18,004.00	0.01
932	002051	中工国际	2,200	17,952.00	0.01
933	603187	海容冷链	1,600	17,904.00	0.01
934	301087	可孚医疗	500	17,680.00	0.01
935	603919	金徽酒	900	17,640.00	0.01
936	600751	海航科技	6,700	17,621.00	0.01
937	688298	东方生物	600	17,598.00	0.01
938	002960	青鸟消防	1,500	17,505.00	0.01
939	000582	北部湾港	2,200	17,336.00	0.01
940	301029	怡合达	700	17,304.00	0.01
941	603583	捷昌驱动	700	17,297.00	0.01
942	301175	中科环保	3,200	17,280.00	0.01
943	688392	骄成超声	423	17,258.40	0.01
944	688279	峰昭科技	109	17,189.30	0.01
945	688508	芯朋微	400	17,188.00	0.01
946	603866	桃李面包	2,600	17,160.00	0.01
947	002697	红旗连锁	2,900	17,139.00	0.01

948	000828	东莞控股	1,600	17,104.00	0.01
949	301015	百洋医药	700	16,947.00	0.01
950	603169	兰石重装	3,100	16,895.00	0.01
951	000791	甘肃能源	2,800	16,884.00	0.01
952	601801	皖新传媒	2,300	16,882.00	0.01
953	002545	东方铁塔	2,400	16,872.00	0.01
954	000672	上峰水泥	2,200	16,830.00	0.01
955	000498	山东路桥	2,800	16,660.00	0.01
956	600075	新疆天业	3,800	16,530.00	0.01
956	601096	宏盛华源	3,800	16,530.00	0.01
957	000718	苏宁环球	7,000	16,520.00	0.01
958	603995	甬金股份	900	16,461.00	0.01
959	605333	沪光股份	500	16,315.00	0.01
960	300737	科顺股份	3,200	16,224.00	0.01
960	600997	开滦股份	2,400	16,224.00	0.01
961	605123	派克新材	300	16,128.00	0.01
962	002267	陕天然气	1,900	16,055.00	0.01
963	300406	九强生物	1,200	16,032.00	0.01
964	688232	新点软件	552	16,002.48	0.01
965	601609	金田股份	2,700	15,930.00	0.01
966	000719	中原传媒	1,400	15,904.00	0.01
967	600223	福瑞达	2,100	15,876.00	0.01
967	600508	上海能源	1,200	15,876.00	0.01
968	000600	建投能源	2,800	15,848.00	0.01
969	002461	珠江啤酒	1,600	15,824.00	0.01
970	301498	乖宝宠物	200	15,664.00	0.01
971	300973	立高食品	400	15,612.00	0.01
972	688337	普源精电	400	15,600.00	0.01
973	603299	苏盐井神	1,400	15,596.00	0.01
974	002489	浙江永强	4,800	15,552.00	0.01
975	600639	浦东金桥	1,400	15,540.00	0.01
976	688531	日联科技	326	15,527.38	0.01
977	600874	创业环保	2,600	15,522.00	0.01
978	603055	台华新材	1,400	15,512.00	0.01
979	002434	万里扬	2,500	15,500.00	0.01
980	300183	东软载波	800	15,480.00	0.01
981	002096	易普力	1,300	15,444.00	0.01
982	688097	博众精工	588	15,435.00	0.01
983	301316	慧博云通	600	15,342.00	0.01

984	600301	华锡有色	900	15,309.00	0.01
985	300660	江苏雷利	400	15,288.00	0.01
986	000597	东北制药	2,900	15,283.00	0.01
987	301267	华夏眼科	800	15,232.00	0.01
988	301205	联特科技	200	15,138.00	0.01
989	603072	天和磁材	1,229	15,116.70	0.01
990	601869	长飞光纤	500	14,945.00	0.01
991	688708	佳驰科技	260	14,900.60	0.01
992	601069	西部黄金	1,300	14,885.00	0.01
993	002378	章源钨业	2,300	14,881.00	0.01
994	002135	东南网架	3,500	14,875.00	0.01
995	688691	灿芯股份	192	14,784.00	0.01
996	600604	市北高新	3,100	14,756.00	0.01
997	605599	菜百股份	1,300	14,755.00	0.01
998	603609	禾丰股份	1,700	14,654.00	0.01
999	002941	新疆交建	1,300	14,521.00	0.01
1,000	603733	仙鹤股份	700	14,441.00	0.01
1,001	600662	外服控股	2,800	14,196.00	0.01
1,002	600780	通宝能源	2,500	14,075.00	0.01
1,003	603310	巍华新材	761	14,000.41	0.01
1,004	300861	美畅股份	700	13,965.00	0.01
1,005	002034	旺能环境	900	13,950.00	0.01
1,006	300953	震裕科技	200	13,928.00	0.01
1,007	002068	黑猫股份	1,300	13,832.00	0.01
1,008	603025	大豪科技	900	13,725.00	0.01
1,009	603105	芯能科技	1,500	13,515.00	0.01
1,010	300206	理邦仪器	1,200	13,416.00	0.01
1,011	002746	仙坛股份	2,100	13,314.00	0.01
1,012	603043	广州酒家	800	13,304.00	0.01
1,013	000968	蓝焰控股	2,000	13,300.00	0.01
1,014	301080	百普赛斯	300	13,242.00	0.01
1,015	601107	四川成渝	2,500	13,075.00	0.01
1,016	603439	贵州三力	1,000	13,000.00	0.01
1,017	603983	丸美生物	400	12,904.00	0.01
1,018	002840	华统股份	1,000	12,610.00	0.01
1,019	301367	怡和嘉业	200	12,600.00	0.01
1,020	688603	天承科技	108	12,582.00	0.01
1,021	603113	金能科技	2,200	12,386.00	0.01
1,022	002549	凯美特气	2,000	12,260.00	0.01

1,023	601949	中国出版	1,700	12,206.00	0.01
1,024	301339	通行宝	600	12,204.00	0.01
1,025	603171	税友股份	400	12,200.00	0.01
1,026	605009	豪悦护理	300	11,988.00	0.01
1,027	688721	龙图光罩	211	11,980.58	0.01
1,028	688535	华海诚科	161	11,970.35	0.01
1,029	603162	海通发展	1,300	11,960.00	0.01
1,030	603348	文灿股份	500	11,830.00	0.01
1,031	000885	城发环境	900	11,799.00	0.01
1,032	300702	天宇股份	700	11,662.00	0.01
1,033	688381	帝奥微	600	11,568.00	0.01
1,034	688766	普冉股份	112	11,341.12	0.01
1,035	301371	敷尔佳	300	11,337.00	0.01
1,036	301622	英思特	197	11,288.10	0.01
1,037	688702	盛科通信	134	11,256.00	0.01
1,038	688209	英集芯	637	11,255.79	0.01
1,039	002534	西子洁能	1,000	11,110.00	0.01
1,040	601811	新华文轩	700	11,095.00	0.01
1,041	688190	云路股份	118	10,856.00	0.01
1,042	688515	裕太微	109	10,791.00	0.01
1,043	688147	微导纳米	400	10,756.00	0.01
1,044	002275	桂林三金	700	10,563.00	0.01
1,045	301207	华兰疫苗	600	10,506.00	0.01
1,046	300741	华宝股份	600	10,434.00	0.01
1,047	603595	东尼电子	600	10,254.00	0.01
1,048	002088	鲁阳节能	800	10,232.00	0.01
1,049	001391	国货航	1,141	10,166.31	0.01
1,050	002946	新乳业	700	10,157.00	0.01
1,051	601033	永兴股份	700	10,122.00	0.01
1,052	000767	晋控电力	4,000	10,120.00	0.01
1,053	688305	科德数控	148	10,089.16	0.01
1,054	688095	福昕软件	150	10,074.00	0.01
1,055	688315	诺禾致源	800	10,000.00	0.01
1,056	688439	振华风光	194	9,950.26	0.01
1,057	688399	硕世生物	151	9,923.72	0.01
1,058	600618	氯碱化工	1,000	9,860.00	0.01
1,059	603666	亿嘉和	400	9,764.00	0.01
1,060	601886	江河集团	1,800	9,720.00	0.01
1,061	301376	致欧科技	500	9,560.00	0.01

1,062	601083	锦江航运	1,000	9,520.00	0.01
1,063	688627	精智达	130	9,478.30	0.01
1,064	001279	强邦新材	265	9,388.95	0.01
1,065	002991	甘源食品	100	9,352.00	0.01
1,066	002265	建设工业	400	9,308.00	0.01
1,067	000019	深粮控股	1,400	9,198.00	0.01
1,068	603989	艾华集团	600	9,048.00	0.01
1,069	002911	佛燃能源	700	8,848.00	0.01
1,070	002961	瑞达期货	600	8,622.00	0.01
1,071	688526	科前生物	600	8,574.00	0.01
1,072	688336	三生国健	400	8,568.00	0.01
1,073	002978	安宁股份	300	8,526.00	0.01
1,074	688128	中国电研	400	8,404.00	0.01
1,075	001308	康冠科技	300	8,250.00	0.01
1,076	688322	奥比中光	170	7,905.00	0.01
1,077	603071	物产环能	600	7,752.00	0.01
1,078	001311	多利科技	300	7,737.00	0.01
1,079	603938	三孚股份	700	7,567.00	0.00
1,080	688621	阳光诺和	197	7,426.90	0.00
1,081	688652	京仪装备	151	7,414.10	0.00
1,082	603530	神马电力	300	7,413.00	0.00
1,083	688625	呈和科技	192	7,330.56	0.00
1,084	301585	蓝宇股份	168	7,304.64	0.00
1,085	301552	科力装备	127	7,214.87	0.00
1,086	301500	飞南资源	400	7,200.00	0.00
1,087	601068	中铝国际	1,600	7,056.00	0.00
1,088	688152	麒麟信安	134	6,973.36	0.00
1,089	301631	壹连科技	58	6,967.54	0.00
1,090	603693	江苏新能	700	6,895.00	0.00
1,091	688682	霍莱沃	198	6,890.40	0.00
1,092	603395	红四方	154	6,774.46	0.00
1,093	301617	博苑股份	140	6,693.40	0.00
1,094	301606	绿联科技	180	6,557.40	0.00
1,095	688020	方邦股份	184	6,504.40	0.00
1,096	688383	新益昌	144	6,461.28	0.00
1,097	601022	宁波远洋	800	6,424.00	0.00
1,098	688601	力芯微	155	6,421.65	0.00
1,099	605365	立达信	400	6,280.00	0.00
1,100	688629	华丰科技	187	6,262.63	0.00

1,101	688768	容知日新	170	6,177.80	0.00
1,102	688489	三未信安	178	6,141.00	0.00
1,103	688366	昊海生科	101	6,118.58	0.00
1,104	688720	艾森股份	151	5,973.56	0.00
1,105	688680	海优新材	176	5,945.28	0.00
1,106	688695	中创股份	195	5,929.95	0.00
1,107	301608	博实结	89	5,812.59	0.00
1,108	688192	迪哲医药	140	5,805.80	0.00
1,109	688639	华恒生物	179	5,765.59	0.00
1,110	301603	乔锋智能	135	5,661.90	0.00
1,111	603132	金徽股份	500	5,615.00	0.00
1,112	688651	盛邦安全	156	5,517.72	0.00
1,113	688799	华纳药厂	131	5,486.28	0.00
1,114	688045	必易微	169	5,391.10	0.00
1,115	688053	思科瑞	190	5,377.00	0.00
1,116	688113	联测科技	186	5,258.22	0.00
1,117	688778	厦钨新能	114	5,202.96	0.00
1,118	688228	开普云	108	4,812.48	0.00
1,119	688539	高华科技	186	4,726.26	0.00
1,120	688626	翔宇医疗	154	4,526.06	0.00
1,121	603205	健尔康	128	4,485.12	0.00
1,122	688060	云涌科技	126	4,474.26	0.00
1,123	688646	逸飞激光	132	4,449.72	0.00
1,124	688276	百克生物	172	4,318.92	0.00
1,125	688311	盟升电子	130	4,304.30	0.00
1,126	688767	博拓生物	123	4,062.69	0.00
1,127	688788	科思科技	128	4,055.04	0.00
1,128	688333	铂力特	100	3,943.00	0.00
1,129	688435	英方软件	128	3,863.04	0.00
1,130	603194	中力股份	117	3,856.32	0.00
1,131	688638	誉辰智能	137	3,836.00	0.00
1,132	688689	银河微电	178	3,771.82	0.00
1,133	688028	沃尔德	170	3,762.10	0.00
1,134	688071	华依科技	139	3,746.05	0.00
1,135	688551	科威尔	132	3,694.68	0.00
1,136	688162	巨一科技	130	3,526.90	0.00
1,137	688109	品茗科技	142	3,480.42	0.00
1,138	688709	成都华微	110	3,396.80	0.00
1,139	688719	爱科赛博	117	3,311.10	0.00

1,140	688217	睿昂基因	167	3,079.48	0.00
1,141	688737	中自科技	170	3,027.70	0.00
1,142	603350	安乃达	79	2,851.11	0.00
1,143	688069	德林海	187	2,808.74	0.00
1,144	688078	龙软科技	106	2,778.26	0.00
1,145	688697	纽威数控	165	2,745.60	0.00
1,146	688593	新相微	148	2,708.40	0.00
1,147	688612	威迈斯	113	2,660.02	0.00
1,148	688006	杭可科技	148	2,643.28	0.00
1,149	688261	东微半导	62	2,603.38	0.00
1,150	688711	宏微科技	144	2,488.32	0.00
1,151	688046	药康生物	190	2,441.50	0.00
1,152	688289	圣湘生物	107	2,428.90	0.00
1,153	688400	凌云光	108	2,367.36	0.00
1,154	688479	友车科技	133	2,360.75	0.00
1,155	688523	航天环宇	108	2,160.00	0.00
1,156	603391	力聚热能	52	2,149.16	0.00
1,157	688225	亚信安全	114	2,075.94	0.00
1,158	688135	利扬芯片	100	2,007.00	0.00
1,159	688021	奥福环保	191	1,994.04	0.00
1,160	688163	赛伦生物	102	1,791.12	0.00
1,161	603285	键邦股份	74	1,672.40	0.00
1,162	688549	中巨芯	172	1,465.44	0.00
1,163	688260	昀冢科技	100	1,395.00	0.00
1,164	688512	慧智微	125	1,238.75	0.00
1,165	688062	迈威生物	50	1,010.00	0.00
1,166	688106	金宏气体	50	850.50	0.00
1,167	688469	芯联集成	153	784.89	0.00
1,168	688668	鼎通科技	6	281.16	0.00
1,169	688685	迈信林	7	232.33	0.00
1,170	688080	映翰通	7	230.44	0.00
1,171	688683	莱尔科技	8	158.88	0.00
1,172	688519	南亚新材	7	148.82	0.00
1,173	688030	山石网科	9	139.50	0.00
1,174	688313	仕佳光子	8	131.12	0.00
1,175	688327	云从科技	8	96.80	0.00
1,176	688335	复洁环保	7	59.01	0.00
1,177	688567	孚能科技	4	46.40	0.00
1,178	688013	天臣医疗	1	17.61	0.00

1,179	688309	恒誉环保	1	12.45	0.00
1,180	688779	五矿新能	2	10.64	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	23,682,452.00	12.71
2	600519	贵州茅台	18,579,553.00	9.98
3	300760	迈瑞医疗	15,788,534.50	8.48
4	601318	中国平安	12,314,097.00	6.61
5	300274	阳光电源	10,971,361.00	5.89
6	300308	中际旭创	10,272,675.20	5.52
7	300015	爱尔眼科	9,228,228.00	4.95
8	000858	五粮液	7,360,139.00	3.95
9	300059	东方财富	7,123,315.00	3.82
10	300124	汇川技术	6,852,000.00	3.68
11	601899	紫金矿业	6,693,554.00	3.59
12	300122	智飞生物	6,689,546.00	3.59
13	300498	温氏股份	6,360,363.00	3.41
14	300014	亿纬锂能	6,344,324.78	3.41
15	002594	比亚迪	6,261,009.88	3.36
16	600900	长江电力	6,202,666.00	3.33
17	000333	美的集团	5,491,224.00	2.95
18	600030	中信证券	5,466,200.00	2.93
19	600887	伊利股份	5,416,410.00	2.91
20	300441	鲍斯股份	5,345,587.50	2.87
21	688981	中芯国际	5,278,956.29	2.83
22	600276	恒瑞医药	5,233,851.60	2.81
23	300502	新易盛	4,905,719.00	2.63
24	600227	赤天化	4,666,127.00	2.51
25	000651	格力电器	4,594,753.45	2.47
26	600262	北方股份	4,549,741.00	2.44
27	688157	松井股份	4,533,346.50	2.43
28	605136	丽人丽妆	4,354,577.00	2.34

29	002035	华帝股份	4,291,968.00	2.30
30	300394	天孚通信	4,230,613.00	2.27
31	688041	海光信息	4,091,373.69	2.20
32	300782	卓胜微	4,080,685.00	2.19
33	002623	亚玛顿	4,066,817.00	2.18
34	600510	黑牡丹	4,016,907.00	2.16
35	603956	威派格	3,991,749.00	2.14
36	300724	捷佳伟创	3,989,406.00	2.14
37	300365	恒华科技	3,977,718.00	2.14
38	600662	外服控股	3,968,615.00	2.13
39	002236	大华股份	3,911,647.00	2.10
40	603501	韦尔股份	3,861,779.00	2.07
41	688069	德林海	3,848,944.96	2.07
42	605108	同庆楼	3,816,033.00	2.05
43	688051	佳华科技	3,815,496.19	2.05
44	600854	春兰股份	3,800,063.99	2.04
45	688737	中自科技	3,772,406.87	2.03
46	605189	富春染织	3,759,082.00	2.02
47	688255	凯尔达	3,743,885.43	2.01
48	002383	合众思壮	3,738,206.00	2.01
49	300860	锋尚文化	3,737,631.20	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。

8.4.2 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	300750	宁德时代	22,876,588.00	12.28
2	600519	贵州茅台	17,919,845.50	9.62
3	300760	迈瑞医疗	17,519,761.00	9.41
4	300274	阳光电源	12,892,913.22	6.92
5	601318	中国平安	11,687,731.00	6.28
6	300015	爱尔眼科	10,405,354.70	5.59
7	300308	中际旭创	10,221,082.00	5.49
8	000858	五粮液	9,469,538.00	5.08
9	002594	比亚迪	8,644,175.00	4.64

10	300014	亿纬锂能	7,160,979.00	3.84
11	300122	智飞生物	7,063,340.21	3.79
12	300059	东方财富	6,532,536.00	3.51
13	601899	紫金矿业	6,190,604.00	3.32
14	600887	伊利股份	6,115,516.00	3.28
15	600276	恒瑞医药	6,107,980.00	3.28
16	300498	温氏股份	6,010,848.00	3.23
17	000333	美的集团	5,925,296.00	3.18
18	600030	中信证券	5,856,993.00	3.14
19	300124	汇川技术	5,822,571.00	3.13
20	000651	格力电器	5,607,866.00	3.01
21	600900	长江电力	5,441,696.00	2.92
22	300441	鲍斯股份	5,000,822.12	2.68
23	002371	北方华创	4,682,362.00	2.51
24	300502	新易盛	4,681,340.00	2.51
25	300782	卓胜微	4,625,290.00	2.48
26	603501	韦尔股份	4,584,609.00	2.46
27	600262	北方股份	4,570,905.00	2.45
28	300394	天孚通信	4,509,167.00	2.42
29	600227	赤天化	4,452,280.00	2.39
30	000568	泸州老窖	4,388,718.00	2.36
31	688157	松井股份	4,280,483.76	2.30
32	605136	丽人丽妆	4,272,340.00	2.29
33	002623	亚玛顿	4,269,517.00	2.29
34	002035	华帝股份	4,245,276.00	2.28
35	600510	黑牡丹	4,184,675.00	2.25
36	688981	中芯国际	4,073,624.33	2.19
37	600854	春兰股份	3,978,214.00	2.14
38	688737	中自科技	3,973,180.04	2.13
39	300724	捷佳伟创	3,946,640.65	2.12
40	002383	合众思壮	3,923,200.00	2.11
41	600662	外服控股	3,919,888.00	2.10
42	300316	晶盛机电	3,919,406.00	2.10
43	002415	海康威视	3,912,462.00	2.10
44	300365	恒华科技	3,890,029.00	2.09
45	600867	通化东宝	3,880,472.00	2.08
46	300860	锋尚文化	3,856,599.68	2.07
47	605108	同庆楼	3,840,702.00	2.06

48	605189	富春染织	3,820,500.00	2.05
49	603956	威派格	3,810,318.00	2.05
50	002236	大华股份	3,768,224.00	2.02

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。

8.4.3 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	2,012,429,334.91
卖出股票收入（成交）总额	2,050,274,631.64

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期内，本基金未投资于国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

无

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 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	25,125.74
2	应收清算款	542,511.14
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	567,636.88

8.12.4 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。

8.12.5 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股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	550	99,646.49	1,422.51	0.00%	54,804,145.11	100.00%
中航量化阿尔法六个月持有 C	1,039	134,057.79	0.00	0.00%	139,286,043.39	100.00%
合计	1,574	123,311.06	1,422.51	0.00%	194,090,188.50	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中航量化阿尔法六个月持有 A	192,169.87	0.35%
	中航量化阿尔法六个月持有 C	1,875,000.00	1.35%
	合计	2,067,169.87	1.07%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

	中航量化阿尔法六个月持有 C	>100
	合计	>100

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航量化阿尔法六 个月持有 A	中航量化阿尔法六 个月持有 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 25 日）基金 份额总额	74,904,100.76	254,269,492.63
本报告期期初基金份额总额	67,576,433.04	174,375,246.70
本报告期基金总申购份额	215,406.21	132,774.81
减:本报告期基金总赎回份额	12,986,271.63	35,221,978.12
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	54,805,567.62	139,286,043.39

注：基金总申购份额包含基金转换入份额，基金总赎回份额包含基金转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

2. 2024 年 1 月 31 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 1 月 29 日起，王华先生不再担任中航基金管理有限公司副总经理。

3. 2024 年 7 月 1 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 6 月 29 日起，刘建先生不再担任公司总经理职务、另有工作安排；武国强先生不再担任公司督察长职务。

4. 2024 年 7 月 1 日，本基金管理人发布《中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 7 月 1 日起，刘建先生担任公司督察长职务并且代履行公司总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

无

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金由天职国际会计师事务所(特殊普通合伙)改聘为中兴华会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金提供审计服务，本年度应支付给中兴华会计师事务所(特殊普通合伙)报酬为 5,000.00 元；截至 2024 年 12 月 31 日，该审计机构向本基金提供审计服务不满 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券股份有限公司	2	1,739,857,256.22	42.85%	1,297,762.93	48.29%	-
国金证券股份有限公司	2	1,173,945,122.49	28.91%	875,645.23	32.58%	-
国盛证券有限责任公司	2	1,070,466,952.44	26.36%	477,314.59	17.76%	-
中航证券有限公司	2	76,541,882.39	1.88%	36,678.02	1.36%	-
广发证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
华金证券	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。

3、本报告期本基金新增 2 个交易单元，注销 1 个交易单元。

4、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。

5、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。

6、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金；本公司官网披露的本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的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日，统计范围为报告期间存续过的所有公募基金，包括报告期间成立、清算、转型的公募基金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 19 日
2	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 1 月 31 日
3	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2023 年年度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 3 月 29 日
4	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 4 月 20 日
5	中航量化阿尔法六个月持有	管理人网站、中国证	2024 年 6 月 26 日

	期股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	监会基金电子披露网站	
6	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 1 日
7	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 1 日
8	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 7 月 18 日
9	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金更新的招募说明书（2024 年第 1 号）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 24 日
10	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 24 日
11	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2024 年中期报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 8 月 30 日
12	中航量化阿尔法六个月持有期股票型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 24 日
13	中航基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 1 日
14	中航基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 14 日
15	中航基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 21 日
16	中航基金管理有限公司关于上海分公司办公地址变更的公告	证券时报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 20 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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 号北京亚洲金融大厦 D 座第 8 层 801\805\806 单元。

13.3 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

2025 年 3 月 31 日