

中航中证智选均衡配置指数型发起式证券
投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中航基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	62
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	62
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	62

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	65
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 12 备查文件目录	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点	70
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金	
基金简称	中航中证智选均衡配置指数发起	
基金主代码	022854	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 3 月 19 日	
基金管理人	中航基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	12,163,619.31 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	中航中证智选均衡配置指数发起 A	中航中证智选均衡配置指数发起 C
下属分级基金的交 易代码	022854	022855
报告期末下属分级 基金的份额总额	10,138,855.27 份	2,024,764.04 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	（一）大类资产配置（二）股票投资策略（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、可交换债券投资策略（九）参与融资及转融通证券出借业务策略
业绩比较基准	中证智选均衡配置指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，原则上采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘建	冯萌
	联系电话	010-56716166	021-52629999-213310
	电子邮箱	liujian@avicfund.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		400-666-2186	95561
传真		010-56716198	021-62159217
注册地址		北京市石景山区五一剧场南路 2 号院 1 号楼 7 层 702E	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦

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	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	100101	200120
法定代表人	杨彦伟	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.avicfund.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
据和指标	中航中证智选均衡指数发起 A	中航中证智选均衡指数发起 C
本期已实现收益	276,658.95	90,743.91
本期利润	926,414.42	275,214.53
加权平均基金份额本期利润	0.0900	0.0714
本期加权平均净值利润率	8.66%	6.90%
本期基金份额净值增长率	9.03%	8.91%
3.1.2 期末数	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
据和指标		
期末可供分配利润	274,791.95	52,467.77
期末可供分配基金份额利润	0.0271	0.0259
期末基金资产净	11,054,309.95	2,205,104.84

值		
期末基金份额净值	1.0903	1.0891
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	9.03%	8.91%

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

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

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

④本基金基金合同于 2025 年 3 月 19 日生效，本报告实际报告期为 2025 年 3 月 19 日至 2025 年 6 月 30 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中航中证智选均衡指数发起 A

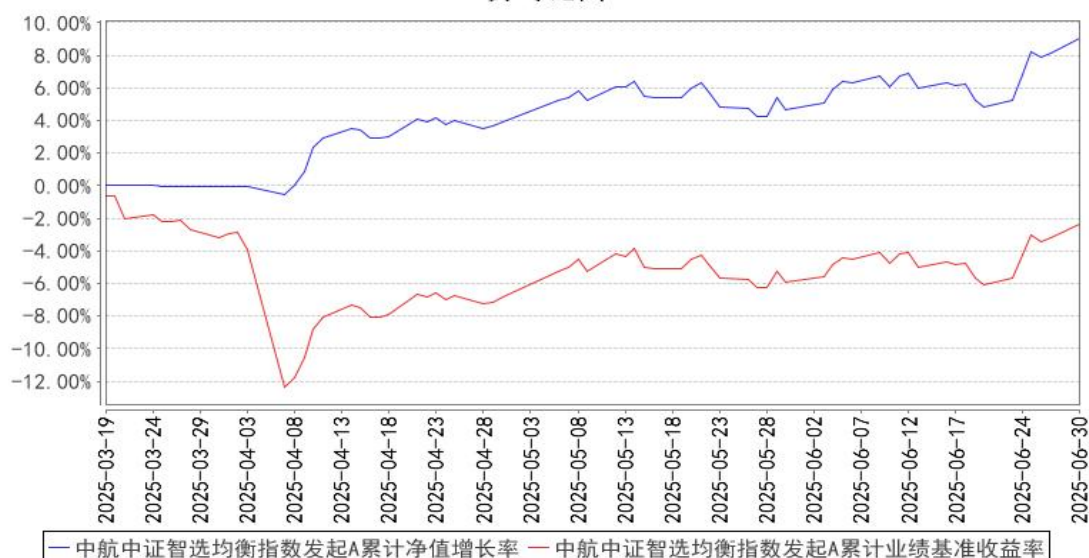
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.18%	0.65%	3.76%	0.66%	0.42%	-0.01%
过去三个月	9.07%	0.59%	0.86%	1.36%	8.21%	-0.77%
自基金合同生效起至今	9.03%	0.55%	-2.40%	1.28%	11.43%	-0.73%

中航中证智选均衡指数发起 C

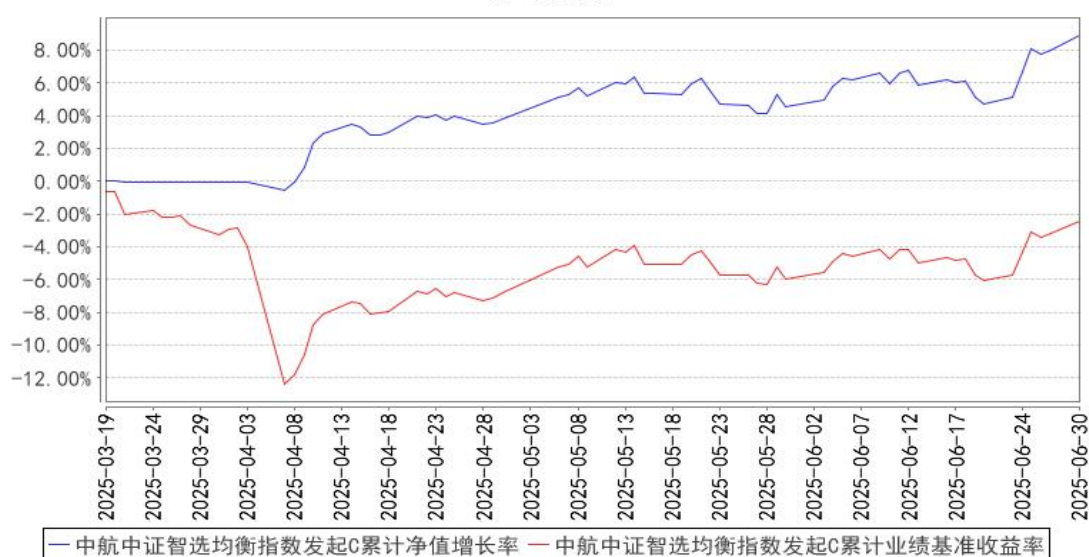
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	4.14%	0.65%	3.76%	0.66%	0.38%	-0.01%
过去三个月	8.96%	0.59%	0.86%	1.36%	8.10%	-0.77%
自基金合同生效起至今	8.91%	0.55%	-2.40%	1.28%	11.31%	-0.73%

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

中航中证智选均衡指数发起A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



中航中证智选均衡指数发起C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金合同于 2025 年 3 月 19 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内。

§ 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，注册资本金为 30,000 万元人民币，经营范围为基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
龙川	本基金基金经理	2025 年 3 月 19 日	—	14 年	统计博士学位，具有 8 年海外投资管理经验，10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于美国 Susquehanna International Group (SIG) 担任投资经理、国泰君安证券资产管理有限公司担任首席研究员、上海东方证券资产管理有限公司担任量化投资总监、安信基金管理有限责任公司担任量化投资部总经理。2020 年 2 月起加入中航基金管理有限公司，现担任中航基金管理有限公司量化投资部负责人，中航基金管理有限公司上海分公司总经理。
杨扬	本基金基金经理	2025 年 3 月 19 日	—	14 年	硕士研究生，具有 10 年以上国内证券、基金行业投资管理经验，曾任职于上海东方证券资产管理有限公司担任研究员、投资助理、安信基金管理有限责任公司先后担任投资经理助理、投资经理、基金经理助理、基金经理。2020 年 2 月加入中航基金管理有限公司，现担任量化投资部基金经理。

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，力争为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，市场风格出现较大分化，整体呈现“市值越小、涨幅越大”的局面，沪深 300、中证 500、中证 1000 上半年涨幅分别为 0.03%、3.31%、6.69%。本基金跟踪的“中证智选均衡配置指数”由于风格均衡，上半年涨幅为 3.46%，略高于沪深 300、中证 500、中证 1000 指数收益率的平均值。本基金 3 月中旬成立，由于建仓期避开了 4 月初的下跌，所以成立以来业绩走势较为稳健。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中航中证智选均衡指数发起 A 基金份额净值为 1.0903 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.03%；截至本报告期末中航中证智选均衡指数发起 C 基金份额净值为 1.0891 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.91%；同期业绩比较基准收益率为-2.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场仍处于估值修复阶段，市场上仍不乏基本面已开始好转、且估值仍然不贵的好股票。展望下半年，随着反内卷等供给侧改革、以及需求侧的持续发力，我国经济有望逐步打破负通胀螺旋，市场对基本面的预期也有望好转。我们对下半年 A 股市场保持乐观。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	137,467.72
结算备付金		852,361.19
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	12,316,663.36
其中：股票投资		12,316,663.36
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
债权投资	6.4.7.5	—
其中：债券投资		—
资产支持证券投资		—
其他投资		—
其他债权投资	6.4.7.6	—
其他权益工具投资	6.4.7.7	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		3,261.90
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		13,309,754.17
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付清算款		—
应付赎回款		1,015.58

应付管理人报酬		5,430.88
应付托管费		1,086.18
应付销售服务费		805.45
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	42,001.29
负债合计		50,339.38
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	12,163,619.31
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	1,095,795.48
净资产合计		13,259,414.79
负债和净资产总计		13,309,754.17

注：①报告截止日 2025 年 6 月 30 日，中航中证智选均衡配置指数发起份额总额 12,163,619.31 份，其中中航中证智选均衡配置指数发起 A 基金份额净值 1.0903 元，份额总额 10,138,855.27 份；中航中证智选均衡配置指数发起 C 基金份额净值 1.0891 元，份额总额 2,024,764.04 份。

②本基金基金合同于 2025 年 3 月 19 日生效，无可比期间数据，本报告实际报告期为 2025 年 3 月 19 日至 2025 年 6 月 30 日，下同。

6.2 利润表

会计主体：中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同 生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,273,266.18
1. 利息收入		5,027.38
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,027.38
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）		433,869.29
其中：股票投资收益	6.4.7.14	304,820.12
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-
股利收益	6.4.7.19	129,049.17
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	834,226.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	143.42
减：二、营业总支出		71,637.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,634.07
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,126.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,436.25
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	42,440.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,201,628.95
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,201,628.95
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		1,201,628.95

6.3 净资产变动表

会计主体：中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	16,612,196.51	-	-	16,612,196.51

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-4,448,577.20	-	1,095,795.48	-3,352,781.72
(一)、综合收益总额	-	-	1,201,628.95	1,201,628.95
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-4,448,577.20	-	-105,833.47	-4,554,410.67
其中：1. 基金申购款	1,848,280.68	-	82,395.47	1,930,676.15
2. 基金赎回款	-6,296,857.88	-	-188,228.94	-6,485,086.82
(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	12,163,619.31	-	1,095,795.48	13,259,414.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

裴荣荣

基金管理人负责人

裴荣荣

主管会计工作负责人

韩丹

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金（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[2024]1714 号文《关于准予中航中证智选均衡配置指数型发起式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《中航中证智选均衡配置指数型发起式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 2025 年 3 月 19 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。本

基金为契约型开放式基金，存续期限不定，基金合同生效日的基金份额总额为 16,612,196.51 份，有效认购户数为 59 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息折合基金份额 538.59 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经立信会计师事务所（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《中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，为更好地实现投资目标，还可以少量投资于国内依法发行上市的其他股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可交换债券、可转换债券（包括分离交易可转债）、短期融资券、超短期融资券、中期票据、公开发行的次级债、证券公司短期公司债券、政府支持机构债券、政府支持债券）、债券回购、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、现金、国债期货、股指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相关规定。

本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证券投资基金业协会制定的《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 3 号—半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—一年度和中期报告》、《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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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业务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业务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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具（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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

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

3、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权，但由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，可在履行适当程序后调整基金收益的分配原则。

6.4.4.12 分部报告

无

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	137,467.72
等于: 本金	137,431.38
加: 应计利息	36.34
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	137,467.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		11,482,437.27	-	12,316,663.36	834,226.09
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		11,482,437.27	-	12,316,663.36	834,226.09

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本报告期末本基金未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本报告期末本基金未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本报告期本基金未计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本报告期末本基金未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本报告期末本基金未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本报告期本基金未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本报告期末本基金未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	41,527.20
其他应付款	474.09
合计	42,001.29

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中航中证智选均衡指数发起 A

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,472,386.66	10,472,386.66
本期申购	415,163.47	415,163.47
本期赎回（以“-”号填列）	-748,694.86	-748,694.86
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,138,855.27	10,138,855.27

中航中证智选均衡指数发起 C

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	6,139,809.85	6,139,809.85
本期申购	1,433,117.21	1,433,117.21
本期赎回（以“-”号填列）	-5,548,163.02	-5,548,163.02
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,024,764.04	2,024,764.04

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。

6.4.7.11 其他综合收益

本报告期本基金无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中航中证智选均衡指数发起 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	276,658.95	649,755.47	926,414.42
本期基金份额交易产生的变动数	-1,867.00	-9,092.74	-10,959.74
其中：基金申购款	426.46	14,037.97	14,464.43
基金赎回款	-2,293.46	-23,130.71	-25,424.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	274,791.95	640,662.73	915,454.68

中航中证智选均衡指数发起 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	90,743.91	184,470.62	275,214.53
本期基金份额交易产生的变动数	-38,276.14	-56,597.59	-94,873.73
其中：基金申购款	4,914.14	63,016.90	67,931.04

基金赎回款	-43,190.28	-119,614.49	-162,804.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,467.77	127,873.03	180,340.80

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,467.94
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	456.32
其他	1,103.12
合计	5,027.38

注：其他包括直销申购款利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	304,820.12
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	304,820.12

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,390,801.80
减：卖出股票成本总额	6,076,315.81
减：交易费用	9,665.87
买卖股票差价收入	304,820.12

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期本基金无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

本报告期本基金无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本报告期本基金无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

本报告期本基金无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本报告期本基金无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本报告期本基金无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	129,049.17
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	129,049.17

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	834,226.09
股票投资	834,226.09
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	834,226.09

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	143.42
合计	143.42

6.4.7.22 信用减值损失

本报告期本基金无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	1,805.44

信息披露费	39,721.76
证券出借违约金	-
银行费用	311.69
开户费	600.00
其他	1.24
合计	42,440.13

6.4.7.24 分部报告

无。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期末本基金不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
中航证券有限公司	23,949,554.88	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本报告期本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
中航证券有限公司	4,931.11	100.00	—	—

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。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月19日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,634.07
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,903.14
应支付基金管理人的净管理费	18,730.93

注：①计提标准：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起5个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于5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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,126.78

注：①计提标准：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

②计提方式与支付方式：基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月首日起 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中航中证智选均衡指数发起 A	中航中证智选均衡指数发起 C	合计
中航证券有限公司	-	3,780.88	3,780.88
合计	-	3,780.88	3,780.88

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年费率为 0.40%。销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

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：销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人于次月首日起 5 个工作日内向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于 5 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、休息日或不可抗力等致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期本基金无转融通证券出借业务。

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

本报告期本基金无转融通证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	中航中证智选均衡指数发起 A	中航中证智选均衡指数发起 C
基金合同生效日（2025 年 3 月 19 日）持有的基金份额	10,000,277.80	—
报告期初持有的基金份额	—	—
报告期间申购/买入总份额	—	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	10,000,277.80	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	82.2147%	—

注：上述关联方投资本基金时，按照本基金基金合同、招募说明书约定的费率标准收取相应的手续费，并履行了信息披露义务。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025 年 3 月 19 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	137,467.72	3,467.94

中航证券有限公司	852,361.19	456.32
----------	------------	--------

注：包括活期存款，存在托管银行的定期存款，券商结算模式下的结算备付金存款。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有因暂时停牌而于期末流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本报告期末本基金未持有银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金未持有交易所市场债券正回购。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无转融通证券出借业务。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，降低跟踪误差。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力求在严格控制风险的前提下，谋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。从定性分析的角度触发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，

及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系。

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

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

监察稽核部和风险管理部是公司内部控制的职能部门。各职能部门负责从经营管理的各业务环节上贯彻落实风险管理措施，执行风险识别、风险测量、风险控制、风险评价和风险报告等风险管理程序，并持续完善相应的内部控制制度和流程。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末，本基金未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末，本基金未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

于本报告期末，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。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金可通过债券回购业务借入短期资金应对流动性需求，债券正回购资金余额不超过基金持有债券资产的公允价值，且基金开放退出期间基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	137,467.72	-	-	-	137,467.72
结算备付金	852,361.19	-	-	-	852,361.19
交易性金融资产	-	-	-	12,316,663.36	12,316,663.36

应收申购款	-	-	-	3,261.90	3,261.90
资产总计	989,828.91	-	-	12,319,925.26	13,309,754.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,015.58	1,015.58
应付管理人报酬	-	-	-	5,430.88	5,430.88
应付托管费	-	-	-	1,086.18	1,086.18
应付销售服务费	-	-	-	805.45	805.45
其他负债	-	-	-	41,527.20	41,527.20
负债总计	-	-	-	49,865.29	49,865.29
利率敏感度缺口	989,828.91	-	-	12,270,059.97	13,259,888.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资或资产支持证券投资占基金资产净值的比例为 0.00%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	12,316,663.36	92.89
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	12,316,663.36	92.89

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。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2025 年 6 月 30 日）
	业绩比较基准上升 5%	176,278.46
	业绩比较基准下降 5%	-176,278.46

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金未采用风险价值法或类似方法进行分析、管理市场风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：
第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	12,316,663.36
第二层次	-
第三层次	-
合计	12,316,663.36

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	12,316,663.36	92.54
	其中：股票	12,316,663.36	92.54
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	989,828.91	7.44
8	其他各项资产	3,261.90	0.02
9	合计	13,309,754.17	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	95,996.00	0.72
B	采矿业	547,606.50	4.13
C	制造业	8,100,123.40	61.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	232,290.00	1.75
E	建筑业	239,895.00	1.81
F	批发和零售业	224,748.00	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	288,556.00	2.18

H	住宿和餐饮业	9,891.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	787,162.36	5.94
J	金融业	1,085,810.90	8.19
K	房地产业	113,053.00	0.85
L	租赁和商务服务业	190,053.00	1.43
M	科学研究和技术服务业	146,536.20	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	51,735.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	49,633.00	0.37
R	文化、体育和娱乐业	134,966.00	1.02
S	综合	18,608.00	0.14
	合计	12,316,663.36	92.89

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	200	281,904.00	2.13
2	300750	宁德时代	900	226,998.00	1.71
3	000333	美的集团	1,700	122,740.00	0.93
4	601899	紫金矿业	5,800	113,100.00	0.85
5	002594	比亚迪	300	99,573.00	0.75
6	600030	中信证券	3,400	93,908.00	0.71
7	000858	五粮液	700	83,230.00	0.63
8	600276	恒瑞医药	1,600	83,040.00	0.63
9	300476	胜宏科技	600	80,628.00	0.61
10	601211	国泰海通	4,000	76,640.00	0.58
11	000651	格力电器	1,600	71,872.00	0.54
12	688608	恒玄科技	200	69,596.00	0.52
13	002625	光启技术	1,600	63,968.00	0.48

14	603259	药明康德	900	62,595.00	0.47
15	002475	立讯精密	1,800	62,442.00	0.47
16	600919	江苏银行	5,200	62,088.00	0.47
17	688041	海光信息	400	56,516.00	0.43
18	688981	中芯国际	600	52,902.00	0.40
19	002384	东山精密	1,400	52,878.00	0.40
20	000988	华工科技	1,100	51,711.00	0.39
21	000725	京东方 A	12,900	51,471.00	0.39
22	300124	汇川技术	700	45,199.00	0.34
23	002371	北方华创	100	44,221.00	0.33
24	002352	顺丰控股	900	43,884.00	0.33
25	300308	中际旭创	300	43,758.00	0.33
26	601728	中国电信	5,500	42,625.00	0.32
27	600988	赤峰黄金	1,700	42,296.00	0.32
28	601668	中国建筑	7,300	42,121.00	0.32
29	002714	牧原股份	1,000	42,010.00	0.32
30	300502	新易盛	320	40,646.40	0.31
31	603501	豪威集团	300	38,295.00	0.29
32	600839	四川长虹	3,900	37,908.00	0.29
33	600031	三一重工	2,100	37,695.00	0.28
34	601555	东吴证券	4,200	36,750.00	0.28
35	688012	中微公司	200	36,460.00	0.27
36	000063	中兴通讯	1,100	35,739.00	0.27
37	689009	九号公司	600	35,502.00	0.27
38	688052	纳芯微	200	34,898.00	0.26
39	002340	格林美	5,400	34,290.00	0.26
40	600660	福耀玻璃	600	34,206.00	0.26
41	601857	中国石油	4,000	34,200.00	0.26
42	300274	阳光电源	500	33,885.00	0.26
43	600941	中国移动	300	33,765.00	0.25
44	688120	华海清科	200	33,740.00	0.25
45	002156	通富微电	1,300	33,306.00	0.25
46	601919	中远海控	2,200	33,088.00	0.25
47	002558	巨人网络	1,400	32,970.00	0.25
48	002142	宁波银行	1,200	32,832.00	0.25
49	688008	澜起科技	400	32,800.00	0.25
50	301236	软通动力	600	32,784.00	0.25
51	300498	温氏股份	1,900	32,452.00	0.24
52	300803	指南针	400	32,264.00	0.24
53	600690	海尔智家	1,300	32,214.00	0.24
54	600487	亨通光电	2,100	32,130.00	0.24
55	300207	欣旺达	1,600	32,096.00	0.24
56	601688	华泰证券	1,800	32,058.00	0.24

57	605499	东鹏饮料	100	31,405.00	0.24
58	300251	光线传媒	1,500	30,405.00	0.23
59	603893	瑞芯微	200	30,372.00	0.23
60	601766	中国中车	4,300	30,272.00	0.23
61	002273	水晶光电	1,500	29,955.00	0.23
62	601168	西部矿业	1,800	29,934.00	0.23
63	601138	工业富联	1,400	29,932.00	0.23
64	600050	中国联通	5,500	29,370.00	0.22
65	000338	潍柴动力	1,900	29,222.00	0.22
66	688018	乐鑫科技	200	29,220.00	0.22
67	002130	沃尔核材	1,200	28,584.00	0.22
68	000100	TCL 科技	6,600	28,578.00	0.22
69	688099	晶晨股份	400	28,404.00	0.21
70	600885	宏发股份	1,260	28,110.60	0.21
71	688002	睿创微纳	400	27,888.00	0.21
72	300017	网宿科技	2,600	27,872.00	0.21
73	600352	浙江龙盛	2,700	27,432.00	0.21
74	300033	同花顺	100	27,301.00	0.21
75	601225	陕西煤业	1,400	26,936.00	0.20
76	600926	杭州银行	1,600	26,912.00	0.20
77	688188	柏楚电子	200	26,332.00	0.20
78	002027	分众传媒	3,600	26,280.00	0.20
79	000423	东阿阿胶	500	26,150.00	0.20
80	600150	中国船舶	800	26,032.00	0.20
81	601128	常熟银行	3,530	26,016.10	0.20
82	000997	新大陆	800	25,904.00	0.20
83	300458	全志科技	650	25,798.50	0.19
84	603236	移远通信	300	25,740.00	0.19
85	002402	和而泰	1,100	25,487.00	0.19
86	600079	人福医药	1,200	25,176.00	0.19
87	601577	长沙银行	2,500	24,850.00	0.19
88	688469	芯联集成-U	5,190	24,756.30	0.19
89	002281	光迅科技	500	24,660.00	0.19
90	300627	华测导航	700	24,500.00	0.18
91	002126	银轮股份	1,000	24,280.00	0.18
92	000783	长江证券	3,500	24,255.00	0.18
93	002078	太阳纸业	1,800	24,228.00	0.18
94	002532	天山铝业	2,900	24,099.00	0.18
95	002128	电投能源	1,200	23,736.00	0.18
96	600580	卧龙电驱	1,200	23,724.00	0.18
97	002595	豪迈科技	400	23,688.00	0.18
98	600109	国金证券	2,700	23,679.00	0.18
99	600862	中航高科	900	23,472.00	0.18

100	603288	海天味业	600	23,346.00	0.18
101	600363	联创光电	400	23,332.00	0.18
102	601009	南京银行	2,000	23,240.00	0.18
103	300054	鼎龙股份	800	22,944.00	0.17
104	300496	中科创达	400	22,888.00	0.17
105	600999	招商证券	1,300	22,867.00	0.17
106	300866	安克创新	200	22,720.00	0.17
107	603005	晶方科技	800	22,712.00	0.17
108	600143	金发科技	2,200	22,682.00	0.17
109	002850	科达利	200	22,634.00	0.17
110	002202	金风科技	2,200	22,550.00	0.17
111	000425	徐工机械	2,900	22,533.00	0.17
112	002138	顺络电子	800	22,496.00	0.17
113	000021	深科技	1,200	22,488.00	0.17
114	300604	长川科技	500	22,455.00	0.17
115	600873	梅花生物	2,100	22,449.00	0.17
116	600111	北方稀土	900	22,410.00	0.17
117	300666	江丰电子	300	22,230.00	0.17
118	000792	盐湖股份	1,300	22,204.00	0.17
119	605589	圣泉集团	800	22,200.00	0.17
120	000728	国元证券	2,800	22,092.00	0.17
121	603087	甘李药业	400	21,912.00	0.17
122	603129	春风动力	100	21,650.00	0.16
123	600089	特变电工	1,800	21,474.00	0.16
124	002223	鱼跃医疗	600	21,360.00	0.16
125	002463	沪电股份	500	21,290.00	0.16
126	300015	爱尔眼科	1,700	21,216.00	0.16
127	300674	宇信科技	700	21,203.00	0.16
128	603300	海南华铁	1,900	21,185.00	0.16
129	300037	新宙邦	600	21,120.00	0.16
130	002050	三花智控	800	21,104.00	0.16
131	600298	安琪酵母	600	21,102.00	0.16
132	603596	伯特利	400	21,076.00	0.16
133	600048	保利发展	2,600	21,060.00	0.16
134	603993	洛阳钼业	2,500	21,050.00	0.16
135	300012	华测检测	1,800	21,042.00	0.16
136	002353	杰瑞股份	600	21,000.00	0.16
137	300738	奥飞数据	1,000	20,930.00	0.16
138	002155	湖南黄金	1,170	20,884.50	0.16
139	688122	西部超导	400	20,752.00	0.16
140	002139	拓邦股份	1,500	20,715.00	0.16
141	603606	东方电缆	400	20,684.00	0.16
142	600415	小商品城	1,000	20,680.00	0.16

143	600895	张江高科	800	20,560.00	0.16
144	000426	兴业银锡	1,300	20,540.00	0.15
145	688183	生益电子	400	20,480.00	0.15
146	688213	思特威-W	200	20,444.00	0.15
147	600019	宝钢股份	3,100	20,429.00	0.15
148	002444	巨星科技	800	20,408.00	0.15
149	000977	浪潮信息	400	20,352.00	0.15
150	603063	禾望电气	600	20,316.00	0.15
151	300568	星源材质	1,600	20,288.00	0.15
152	601390	中国中铁	3,600	20,196.00	0.15
153	002179	中航光电	500	20,180.00	0.15
154	601216	君正集团	3,600	19,872.00	0.15
155	688343	云天励飞-U	400	19,768.00	0.15
156	600392	盛和资源	1,500	19,755.00	0.15
157	601600	中国铝业	2,800	19,712.00	0.15
158	601665	齐鲁银行	3,100	19,592.00	0.15
159	000729	燕京啤酒	1,500	19,395.00	0.15
160	600967	内蒙一机	1,000	19,350.00	0.15
161	300003	乐普医疗	1,400	19,292.00	0.15
162	300570	太辰光	200	19,276.00	0.15
163	601696	中银证券	1,800	19,242.00	0.15
164	000528	柳工	2,000	19,220.00	0.14
165	600547	山东黄金	600	19,158.00	0.14
166	603766	隆鑫通用	1,500	19,140.00	0.14
167	000878	云南铜业	1,500	19,080.00	0.14
167	601233	桐昆股份	1,800	19,080.00	0.14
168	600316	洪都航空	500	18,850.00	0.14
169	600153	建发股份	1,800	18,666.00	0.14
170	600521	华海药业	1,000	18,630.00	0.14
170	601677	明泰铝业	1,500	18,630.00	0.14
171	600673	东阳光	1,600	18,608.00	0.14
171	688578	艾力斯	200	18,608.00	0.14
172	603979	金诚信	400	18,576.00	0.14
173	601989	中国重工	4,000	18,560.00	0.14
174	603799	华友钴业	500	18,510.00	0.14
175	600060	海信视像	800	18,416.00	0.14
176	600958	东方证券	1,900	18,392.00	0.14
177	300014	亿纬锂能	400	18,324.00	0.14
178	601717	郑煤机	1,100	18,282.00	0.14
179	688208	道通科技	596	18,237.60	0.14
180	000893	亚钾国际	600	18,084.00	0.14
181	002245	蔚蓝锂芯	1,400	17,962.00	0.14
182	001696	宗申动力	800	17,960.00	0.14

183	300088	长信科技	3,000	17,880.00	0.13
183	300623	捷捷微电	600	17,880.00	0.13
184	002821	凯莱英	200	17,650.00	0.13
185	300182	捷成股份	3,200	17,632.00	0.13
186	002311	海大集团	300	17,577.00	0.13
187	601336	新华保险	300	17,550.00	0.13
188	300073	当升科技	400	17,548.00	0.13
189	600699	均胜电子	1,000	17,440.00	0.13
190	600398	海澜之家	2,500	17,400.00	0.13
190	600486	扬农化工	300	17,400.00	0.13
191	600704	物产中大	3,300	17,391.00	0.13
192	300558	贝达药业	300	17,385.00	0.13
193	000415	渤海租赁	5,200	17,316.00	0.13
194	300763	锦浪科技	300	17,217.00	0.13
195	600435	北方导航	1,100	17,149.00	0.13
196	002683	广东宏大	500	16,970.00	0.13
197	002958	青农商行	4,700	16,967.00	0.13
198	000623	吉林敖东	1,000	16,950.00	0.13
199	600497	驰宏锌锗	3,200	16,928.00	0.13
200	600909	华安证券	2,900	16,907.00	0.13
201	600584	长电科技	500	16,845.00	0.13
202	000776	广发证券	1,000	16,810.00	0.13
203	000938	紫光股份	700	16,793.00	0.13
204	000538	云南白药	300	16,737.00	0.13
205	603228	景旺电子	400	16,736.00	0.13
206	002015	协鑫能科	1,200	16,716.00	0.13
207	300408	三环集团	500	16,700.00	0.13
208	300748	金力永磁	700	16,688.00	0.13
209	600132	重庆啤酒	300	16,530.00	0.12
210	300432	富临精工	1,260	16,468.20	0.12
211	300682	朗新集团	700	16,450.00	0.12
212	300083	创世纪	2,000	16,440.00	0.12
212	300919	中伟股份	500	16,440.00	0.12
213	600141	兴发集团	800	16,424.00	0.12
214	002409	雅克科技	300	16,407.00	0.12
215	002318	久立特材	700	16,373.00	0.12
216	300724	捷佳伟创	300	16,290.00	0.12
217	688249	晶合集成	800	16,216.00	0.12
218	688123	聚辰股份	200	16,198.00	0.12
219	603345	安井食品	200	16,084.00	0.12
220	002400	省广集团	2,100	16,044.00	0.12
221	601567	三星医疗	700	15,694.00	0.12
222	600577	精达股份	2,100	15,624.00	0.12

223	301358	湖南裕能	500	15,595.00	0.12
224	300373	扬杰科技	300	15,570.00	0.12
225	600038	中直股份	400	15,524.00	0.12
226	600529	山东药玻	700	15,498.00	0.12
227	000960	锡业股份	1,000	15,300.00	0.12
228	603920	世运电路	500	15,255.00	0.12
229	002926	华西证券	1,700	15,198.00	0.11
230	600559	老白干酒	900	15,075.00	0.11
231	000039	中集集团	1,900	14,934.00	0.11
232	601377	兴业证券	2,400	14,856.00	0.11
233	600986	浙文互联	1,800	14,706.00	0.11
234	603939	益丰药房	600	14,682.00	0.11
235	600489	中金黄金	1,000	14,630.00	0.11
236	600323	瀚蓝环境	600	14,610.00	0.11
236	601669	中国电建	3,000	14,610.00	0.11
237	688789	宏华数科	200	14,608.00	0.11
238	002171	楚江新材	1,500	14,595.00	0.11
239	002028	思源电气	200	14,582.00	0.11
240	002262	恩华药业	700	14,546.00	0.11
241	002385	大北农	3,600	14,544.00	0.11
241	600901	江苏金租	2,400	14,544.00	0.11
242	300777	中简科技	400	14,500.00	0.11
243	603379	三美股份	300	14,436.00	0.11
244	688278	特宝生物	200	14,422.00	0.11
245	000513	丽珠集团	400	14,416.00	0.11
246	600160	巨化股份	500	14,340.00	0.11
247	002617	露笑科技	1,900	14,307.00	0.11
248	688568	中科星图	396	14,259.96	0.11
249	002807	江阴银行	3,000	14,250.00	0.11
250	002939	长城证券	1,700	14,246.00	0.11
251	600114	东睦股份	700	14,238.00	0.11
252	603338	浙江鼎力	300	14,220.00	0.11
253	600761	安徽合力	800	14,192.00	0.11
254	603083	剑桥科技	300	14,190.00	0.11
255	600728	佳都科技	2,600	14,170.00	0.11
256	601995	中金公司	400	14,144.00	0.11
257	000887	中鼎股份	800	14,072.00	0.11
258	002916	深南电路	130	14,015.30	0.11
259	600390	五矿资本	2,400	13,992.00	0.11
260	603589	口子窖	400	13,920.00	0.10
261	603323	苏农银行	2,480	13,912.80	0.10
262	601528	瑞丰银行	2,400	13,896.00	0.10
263	300285	国瓷材料	800	13,880.00	0.10

264	600998	九州通	2,700	13,878.00	0.10
265	300181	佐力药业	800	13,864.00	0.10
266	600312	平高电气	900	13,851.00	0.10
267	002841	视源股份	400	13,840.00	0.10
268	002249	大洋电机	2,100	13,818.00	0.10
269	601881	中国银河	800	13,720.00	0.10
270	002145	中核钛白	3,300	13,695.00	0.10
271	300144	宋城演艺	1,600	13,680.00	0.10
272	002080	中材科技	700	13,650.00	0.10
273	600285	羚锐制药	600	13,602.00	0.10
274	688029	南微医学	200	13,510.00	0.10
275	601179	中国西电	2,200	13,508.00	0.10
276	300035	中科电气	800	13,504.00	0.10
277	002396	星网锐捷	600	13,470.00	0.10
278	688582	芯动联科	200	13,440.00	0.10
279	002500	山西证券	2,300	13,432.00	0.10
280	000062	深圳华强	500	13,430.00	0.10
281	002203	海亮股份	1,300	13,416.00	0.10
282	600206	有研新材	700	13,377.00	0.10
283	000596	古井贡酒	100	13,315.00	0.10
284	600380	健康元	1,200	13,236.00	0.10
285	600186	莲花控股	2,200	13,200.00	0.10
286	600021	上海电力	1,500	13,185.00	0.10
287	002487	大金重工	400	13,160.00	0.10
288	600583	海油工程	2,400	13,104.00	0.10
289	002701	奥瑞金	2,200	13,090.00	0.10
290	603306	华懋科技	300	13,050.00	0.10
291	000737	北方铜业	1,200	13,032.00	0.10
291	688141	杰华特	400	13,032.00	0.10
292	000157	中联重科	1,800	13,014.00	0.10
293	002074	国轩高科	400	12,984.00	0.10
294	000686	东北证券	1,700	12,971.00	0.10
295	002948	青岛银行	2,600	12,948.00	0.10
296	600989	宝丰能源	800	12,912.00	0.10
297	000917	电广传媒	1,700	12,852.00	0.10
298	000921	海信家电	500	12,850.00	0.10
299	000060	中金岭南	2,800	12,824.00	0.10
300	601186	中国铁建	1,600	12,816.00	0.10
301	603662	柯力传感	200	12,786.00	0.10
302	002001	新和成	600	12,762.00	0.10
303	603816	顾家家居	500	12,760.00	0.10
304	002056	横店东磁	900	12,735.00	0.10
305	600595	中孚实业	2,900	12,702.00	0.10

306	601991	大唐发电	4,000	12,680.00	0.10
307	002244	滨江集团	1,300	12,675.00	0.10
308	600348	华阳股份	1,900	12,654.00	0.10
309	601788	光大证券	700	12,586.00	0.09
310	603298	杭叉集团	600	12,570.00	0.09
311	600196	复星医药	500	12,545.00	0.09
312	600535	天士力	800	12,520.00	0.09
313	601799	星宇股份	100	12,500.00	0.09
314	603699	纽威股份	400	12,468.00	0.09
315	600633	浙数文化	900	12,456.00	0.09
316	002698	博实股份	800	12,432.00	0.09
317	600066	宇通客车	500	12,430.00	0.09
318	600763	通策医疗	300	12,384.00	0.09
319	002891	中宠股份	200	12,374.00	0.09
320	000636	风华高科	900	12,366.00	0.09
321	000830	鲁西化工	1,200	12,360.00	0.09
321	002936	郑州银行	6,000	12,360.00	0.09
322	300888	稳健医疗	300	12,330.00	0.09
323	000951	中国重汽	700	12,306.00	0.09
324	605111	新洁能	400	12,296.00	0.09
325	002484	江海股份	600	12,294.00	0.09
326	600338	西藏珠峰	1,100	12,199.00	0.09
327	601333	广深铁路	4,200	12,138.00	0.09
328	300567	精测电子	200	12,122.00	0.09
329	000963	华东医药	300	12,108.00	0.09
330	600771	广誉远	600	12,096.00	0.09
331	600850	电科数字	500	12,095.00	0.09
332	600183	生益科技	400	12,060.00	0.09
333	601066	中信建投	500	12,025.00	0.09
334	300133	华策影视	1,600	12,016.00	0.09
335	600970	中材国际	1,400	12,012.00	0.09
336	600908	无锡银行	1,900	11,989.00	0.09
337	300398	飞凯材料	600	11,982.00	0.09
338	601611	中国核建	1,300	11,947.00	0.09
339	600110	诺德股份	1,700	11,883.00	0.09
340	601901	方正证券	1,500	11,865.00	0.09
341	300113	顺网科技	600	11,856.00	0.09
342	600667	太极实业	1,800	11,844.00	0.09
343	300677	英科医疗	500	11,840.00	0.09
344	600216	浙江医药	800	11,832.00	0.09
345	600004	白云机场	1,300	11,830.00	0.09
346	601058	赛轮轮胎	900	11,808.00	0.09
347	688322	奥比中光-UW	200	11,802.00	0.09

348	000563	陕国投 A	3,300	11,781.00	0.09
349	600499	科达制造	1,200	11,760.00	0.09
350	601966	玲珑轮胎	800	11,736.00	0.09
351	002270	华明装备	700	11,718.00	0.09
352	600718	东软集团	1,200	11,700.00	0.09
353	600325	华发股份	2,400	11,688.00	0.09
354	600133	东湖高新	1,300	11,674.00	0.09
355	600511	国药股份	400	11,664.00	0.09
356	603486	科沃斯	200	11,646.00	0.09
357	300236	上海新阳	300	11,640.00	0.09
358	002221	东华能源	1,200	11,592.00	0.09
359	002773	康弘药业	400	11,588.00	0.09
360	600483	福能股份	1,200	11,568.00	0.09
361	600064	南京高科	1,500	11,565.00	0.09
362	601800	中国交建	1,300	11,557.00	0.09
363	300910	瑞丰新材	200	11,550.00	0.09
364	688048	长光华芯	200	11,548.00	0.09
365	000598	兴蓉环境	1,600	11,536.00	0.09
366	002736	国信证券	1,000	11,520.00	0.09
367	600663	陆家嘴	1,300	11,518.00	0.09
368	002507	涪陵榨菜	900	11,511.00	0.09
369	688629	华丰科技	200	11,440.00	0.09
370	600011	华能国际	1,600	11,424.00	0.09
371	603678	火炬电子	300	11,409.00	0.09
372	601456	国联民生	1,100	11,385.00	0.09
373	000975	山金国际	600	11,364.00	0.09
374	600282	南钢股份	2,700	11,340.00	0.09
375	688563	航材股份	200	11,326.00	0.09
376	600993	马应龙	400	11,312.00	0.09
377	600674	川投能源	700	11,228.00	0.08
378	000807	云铝股份	700	11,186.00	0.08
379	300394	天孚通信	140	11,177.60	0.08
380	002373	千方科技	1,200	11,160.00	0.08
381	002236	大华股份	700	11,116.00	0.08
382	000050	深天马 A	1,300	11,076.00	0.08
383	000902	新洋丰	800	11,064.00	0.08
384	002048	宁波华翔	600	11,046.00	0.08
385	600739	辽宁成大	1,000	11,000.00	0.08
386	601918	新集能源	1,700	10,982.00	0.08
387	000987	越秀资本	1,600	10,976.00	0.08
388	002268	电科网安	600	10,974.00	0.08
389	000676	智度股份	1,200	10,944.00	0.08
390	601958	金钼股份	1,000	10,940.00	0.08

391	301498	乖宝宠物	100	10,937.00	0.08
392	600750	江中药业	500	10,915.00	0.08
393	600563	法拉电子	100	10,909.00	0.08
394	600685	中船防务	400	10,876.00	0.08
395	300185	通裕重工	3,800	10,868.00	0.08
396	600459	贵研铂业	700	10,857.00	0.08
397	688336	三生国健	200	10,848.00	0.08
398	002839	张家港行	2,400	10,800.00	0.08
399	600582	天地科技	1,800	10,782.00	0.08
400	002212	天融信	1,400	10,780.00	0.08
401	300303	聚飞光电	1,700	10,778.00	0.08
402	300850	新强联	300	10,746.00	0.08
403	300618	寒锐钴业	300	10,716.00	0.08
404	000559	万向钱潮	1,400	10,710.00	0.08
405	301171	易点天下	400	10,692.00	0.08
406	688297	中无人机	200	10,680.00	0.08
407	601137	博威合金	600	10,674.00	0.08
408	003031	中瓷电子	200	10,642.00	0.08
408	300776	帝尔激光	200	10,642.00	0.08
409	300601	康泰生物	700	10,633.00	0.08
410	000786	北新建材	400	10,592.00	0.08
411	600741	华域汽车	600	10,590.00	0.08
412	600320	振华重工	2,400	10,488.00	0.08
413	601868	中国能建	4,700	10,481.00	0.08
414	688076	诺泰生物	280	10,421.60	0.08
415	002648	卫星化学	600	10,398.00	0.08
416	300294	博雅生物	400	10,396.00	0.08
417	601778	晶科科技	3,500	10,395.00	0.08
418	002019	亿帆医药	800	10,392.00	0.08
419	601866	中远海发	4,200	10,374.00	0.08
420	601678	滨化股份	2,500	10,350.00	0.08
421	603529	爱玛科技	300	10,320.00	0.08
422	603737	三棵树	280	10,318.00	0.08
423	301293	三博脑科	200	10,282.00	0.08
424	600176	中国巨石	900	10,260.00	0.08
425	600210	紫江企业	1,500	10,245.00	0.08
426	002745	木林森	1,300	10,244.00	0.08
427	601231	环旭电子	700	10,241.00	0.08
428	000682	东方电子	1,000	10,240.00	0.08
429	002920	德赛西威	100	10,213.00	0.08
430	600764	中国海防	300	10,200.00	0.08
431	002649	博彦科技	700	10,171.00	0.08
432	600273	嘉化能源	1,200	10,152.00	0.08

433	002120	韵达股份	1,500	10,050.00	0.08
434	603619	中曼石油	500	10,035.00	0.08
435	002299	圣农发展	700	10,003.00	0.08
436	600478	科力远	1,600	10,000.00	0.08
437	300034	钢研高纳	600	9,978.00	0.08
438	601117	中国化学	1,300	9,971.00	0.08
439	000555	神州信息	700	9,954.00	0.08
440	300079	数码视讯	1,700	9,945.00	0.08
441	600179	安通控股	3,600	9,936.00	0.07
442	600460	士兰微	400	9,928.00	0.07
443	600258	首旅酒店	700	9,891.00	0.07
444	000680	山推股份	1,100	9,867.00	0.07
445	600057	厦门象屿	1,400	9,842.00	0.07
446	002706	良信股份	1,100	9,801.00	0.07
447	600995	南网储能	1,000	9,780.00	0.07
448	600366	宁波韵升	900	9,774.00	0.07
448	601963	重庆银行	900	9,774.00	0.07
449	601126	四方股份	600	9,762.00	0.07
450	002906	华阳集团	300	9,753.00	0.07
451	001301	尚太科技	200	9,752.00	0.07
452	000967	盈峰环境	1,400	9,730.00	0.07
453	002430	杭氧股份	500	9,710.00	0.07
454	600707	彩虹股份	1,500	9,690.00	0.07
455	688131	皓元医药	200	9,670.00	0.07
456	300319	麦捷科技	900	9,666.00	0.07
457	688088	虹软科技	200	9,650.00	0.07
458	603650	彤程新材	300	9,645.00	0.07
459	600572	康恩贝	2,200	9,636.00	0.07
460	600933	爱柯迪	600	9,606.00	0.07
461	002987	京北方	460	9,591.00	0.07
462	301205	联特科技	100	9,586.00	0.07
463	601319	中国人保	1,100	9,581.00	0.07
464	600219	南山铝业	2,500	9,575.00	0.07
465	000027	深圳能源	1,500	9,570.00	0.07
466	603565	中谷物流	1,000	9,550.00	0.07
467	000709	河钢股份	4,400	9,504.00	0.07
468	300492	华图山鼎	140	9,503.20	0.07
469	002010	传化智联	1,700	9,486.00	0.07
470	600550	保变电气	1,100	9,460.00	0.07
471	002929	润建股份	200	9,452.00	0.07
472	600578	京能电力	2,100	9,429.00	0.07
473	300620	光库科技	200	9,422.00	0.07
474	002597	金禾实业	400	9,420.00	0.07

475	002539	云图控股	1,000	9,380.00	0.07
476	600362	江西铜业	400	9,372.00	0.07
477	002831	裕同科技	400	9,368.00	0.07
478	300573	兴齐眼药	180	9,322.20	0.07
479	688270	臻镭科技	200	9,312.00	0.07
480	688300	联瑞新材	200	9,310.00	0.07
481	601399	国机重装	3,100	9,300.00	0.07
482	002215	诺普信	900	9,297.00	0.07
483	002011	盾安环境	800	9,280.00	0.07
483	002239	奥特佳	3,200	9,280.00	0.07
484	600267	海正药业	1,000	9,250.00	0.07
485	600482	中国动力	400	9,228.00	0.07
486	600621	华鑫股份	600	9,186.00	0.07
487	601098	中南传媒	700	9,184.00	0.07
488	600517	国网英大	1,800	9,180.00	0.07
489	002332	仙琚制药	1,000	9,170.00	0.07
490	600037	歌华有线	1,200	9,168.00	0.07
491	300827	上能电气	300	9,165.00	0.07
492	601156	东航物流	700	9,163.00	0.07
493	600882	妙可蓝多	300	9,159.00	0.07
494	600827	百联股份	1,000	9,140.00	0.07
495	002315	焦点科技	200	9,138.00	0.07
496	002020	京新药业	700	9,135.00	0.07
497	688690	纳微科技	400	9,132.00	0.07
498	603456	九洲药业	600	9,126.00	0.07
499	688019	安集科技	60	9,108.00	0.07
500	600587	新华医疗	600	9,084.00	0.07
501	601877	正泰电器	400	9,068.00	0.07
502	002709	天赐材料	500	9,060.00	0.07
503	000630	铜陵有色	2,700	9,018.00	0.07
504	600968	海油发展	2,200	8,976.00	0.07
505	600635	大众公用	2,300	8,970.00	0.07
506	600729	重庆百货	300	8,949.00	0.07
507	600959	江苏有线	2,600	8,944.00	0.07
508	601928	凤凰传媒	800	8,936.00	0.07
509	600039	四川路桥	900	8,910.00	0.07
510	000156	华数传媒	1,100	8,734.00	0.07
511	002003	伟星股份	800	8,728.00	0.07
511	600059	古越龙山	800	8,728.00	0.07
512	002091	江苏国泰	1,200	8,724.00	0.07
513	603505	金石资源	400	8,688.00	0.07
514	603393	新天然气	300	8,685.00	0.07
515	600055	万东医疗	500	8,640.00	0.07

516	002266	浙富控股	2,800	8,624.00	0.07
517	301165	锐捷网络	140	8,604.40	0.06
518	603171	税友股份	200	8,582.00	0.06
519	000758	中色股份	1,700	8,551.00	0.06
520	300482	万孚生物	400	8,540.00	0.06
521	600420	国药现代	800	8,520.00	0.06
521	603225	新凤鸣	800	8,520.00	0.06
522	601636	旗滨集团	1,700	8,517.00	0.06
523	002324	普利特	800	8,504.00	0.06
524	300602	飞荣达	400	8,484.00	0.06
525	603383	顶点软件	200	8,480.00	0.06
526	603588	高能环境	1,500	8,460.00	0.06
527	002541	鸿路钢构	500	8,370.00	0.06
528	600490	鹏欣资源	1,900	8,341.00	0.06
529	688403	汇成股份	800	8,312.00	0.06
530	002993	奥海科技	200	8,294.00	0.06
531	600801	华新水泥	700	8,288.00	0.06
532	000089	深圳机场	1,200	8,280.00	0.06
533	688503	聚和材料	200	8,278.00	0.06
534	600056	中国医药	800	8,272.00	0.06
535	301297	富乐德	200	8,266.00	0.06
536	600063	皖维高新	1,800	8,244.00	0.06
537	600458	时代新材	600	8,232.00	0.06
538	301291	明阳电气	200	8,230.00	0.06
539	688289	圣湘生物	400	8,192.00	0.06
540	002626	金达威	400	8,184.00	0.06
541	601890	亚星锚链	800	8,152.00	0.06
542	603233	大参林	500	8,150.00	0.06
543	300634	彩讯股份	300	8,130.00	0.06
544	600428	中远海特	1,300	8,125.00	0.06
545	002446	盛路通信	1,100	8,118.00	0.06
546	002567	唐人神	1,700	8,092.00	0.06
547	603296	华勤技术	100	8,068.00	0.06
548	300415	伊之密	400	8,060.00	0.06
549	002100	天康生物	1,300	8,047.00	0.06
550	002847	盐津铺子	100	8,040.00	0.06
551	688388	嘉元科技	400	8,032.00	0.06
552	000429	粤高速 A	600	7,998.00	0.06
552	300770	新媒股份	200	7,998.00	0.06
553	301031	中熔电气	100	7,965.00	0.06
554	300232	洲明科技	1,100	7,964.00	0.06
555	300660	江苏雷利	180	7,963.20	0.06
556	002815	崇达技术	700	7,931.00	0.06

557	000785	居然智家	2,600	7,930.00	0.06
558	002004	华邦健康	1,900	7,923.00	0.06
559	600332	白云山	300	7,908.00	0.06
560	000685	中山公用	900	7,902.00	0.06
561	600961	株冶集团	700	7,826.00	0.06
562	603197	保隆科技	200	7,814.00	0.06
563	605123	派克新材	100	7,790.00	0.06
564	600717	天津港	1,700	7,752.00	0.06
565	300725	药石科技	200	7,740.00	0.06
565	600509	天富能源	1,200	7,740.00	0.06
566	600233	圆通速递	600	7,734.00	0.06
567	300772	运达股份	600	7,728.00	0.06
568	605376	博迁新材	200	7,666.00	0.06
569	300323	华灿光电	1,000	7,650.00	0.06
570	603218	日月股份	600	7,614.00	0.06
571	000650	仁和药业	1,400	7,588.00	0.06
572	601208	东材科技	800	7,584.00	0.06
573	002023	海特高新	700	7,574.00	0.06
574	002550	千红制药	900	7,560.00	0.06
575	000537	中绿电	900	7,524.00	0.06
576	300761	立华股份	400	7,516.00	0.06
577	603659	璞泰来	400	7,512.00	0.06
578	000876	新希望	800	7,504.00	0.06
579	002468	申通快递	700	7,483.00	0.06
580	002928	华夏航空	900	7,479.00	0.06
581	600062	华润双鹤	400	7,464.00	0.06
582	600350	山东高速	700	7,462.00	0.06
583	002096	易普力	600	7,446.00	0.06
584	600389	江山股份	400	7,440.00	0.06
585	600643	爱建集团	1,000	7,420.00	0.06
586	688100	威胜信息	200	7,410.00	0.06
587	600507	方大特钢	1,700	7,378.00	0.06
588	300759	康龙化成	300	7,362.00	0.06
589	300470	中密控股	200	7,354.00	0.06
590	603612	索通发展	400	7,352.00	0.06
591	688425	铁建重工	1,800	7,344.00	0.06
592	001287	中电港	400	7,324.00	0.06
593	603583	捷昌驱动	200	7,304.00	0.06
594	000935	四川双马	400	7,288.00	0.05
595	002125	湘潭电化	500	7,265.00	0.05
596	002194	武汉凡谷	500	7,230.00	0.05
597	601311	骆驼股份	800	7,224.00	0.05
598	002925	盈趣科技	400	7,192.00	0.05

599	301155	海力风电	100	7,190.00	0.05
600	603337	杰克股份	200	7,176.00	0.05
601	002204	大连重工	1,200	7,164.00	0.05
602	300726	宏达电子	200	7,150.00	0.05
603	002545	东方铁塔	800	7,112.00	0.05
604	601965	中国汽研	400	7,100.00	0.05
605	002761	浙江建投	800	7,096.00	0.05
606	600269	赣粤高速	1,400	7,084.00	0.05
607	000915	华特达因	200	7,070.00	0.05
608	601568	北元集团	1,700	7,055.00	0.05
609	601369	陕鼓动力	800	7,016.00	0.05
610	600664	哈药股份	1,900	6,992.00	0.05
611	600531	豫光金铅	900	6,966.00	0.05
611	603027	千禾味业	600	6,966.00	0.05
612	600600	青岛啤酒	100	6,946.00	0.05
613	300446	航天智造	400	6,928.00	0.05
614	600866	星湖科技	1,000	6,910.00	0.05
615	000928	中钢国际	1,100	6,908.00	0.05
616	600138	中青旅	700	6,895.00	0.05
617	600098	广州发展	1,100	6,875.00	0.05
618	600649	城投控股	1,600	6,864.00	0.05
619	002081	金螳螂	2,000	6,860.00	0.05
620	301029	怡合达	300	6,858.00	0.05
621	300226	上海钢联	300	6,852.00	0.05
622	300641	正丹股份	300	6,837.00	0.05
623	000049	德赛电池	300	6,828.00	0.05
624	600888	新疆众和	1,000	6,820.00	0.05
625	301047	义翘神州	100	6,810.00	0.05
625	600266	城建发展	1,500	6,810.00	0.05
626	600812	华北制药	1,100	6,798.00	0.05
627	600012	皖通高速	400	6,792.00	0.05
628	300443	金雷股份	300	6,780.00	0.05
629	002518	科士达	300	6,777.00	0.05
630	002895	川恒股份	300	6,768.00	0.05
630	600061	国投资本	900	6,768.00	0.05
631	603368	柳药集团	400	6,764.00	0.05
632	603118	共进股份	600	6,762.00	0.05
633	002690	美亚光电	400	6,748.00	0.05
634	600597	光明乳业	800	6,728.00	0.05
635	600875	东方电气	400	6,696.00	0.05
636	002233	塔牌集团	900	6,660.00	0.05
637	600575	淮河能源	1,900	6,631.00	0.05
638	601019	山东出版	700	6,629.00	0.05

639	002258	利尔化学	600	6,624.00	0.05
640	301004	嘉益股份	100	6,623.00	0.05
641	600502	安徽建工	1,400	6,580.00	0.05
642	000617	中油资本	900	6,570.00	0.05
643	600027	华电国际	1,200	6,564.00	0.05
644	605599	菜百股份	400	6,540.00	0.05
645	002727	一心堂	400	6,536.00	0.05
646	600757	长江传媒	700	6,496.00	0.05
647	300685	艾德生物	300	6,459.00	0.05
648	002832	比音勒芬	400	6,420.00	0.05
649	002938	鹏鼎控股	200	6,406.00	0.05
650	603876	鼎胜新材	700	6,363.00	0.05
651	601200	上海环境	800	6,352.00	0.05
652	002061	浙江交科	1,600	6,336.00	0.05
653	300360	炬华科技	400	6,300.00	0.05
654	002007	华兰生物	400	6,268.00	0.05
655	601900	南方传媒	400	6,256.00	0.05
656	300705	九典制药	400	6,228.00	0.05
657	600125	铁龙物流	1,100	6,226.00	0.05
658	603733	仙鹤股份	300	6,222.00	0.05
659	000600	建投能源	900	6,219.00	0.05
660	603128	华贸物流	1,000	6,200.00	0.05
661	001914	招商积余	500	6,185.00	0.05
662	600305	恒顺醋业	800	6,184.00	0.05
663	002108	沧州明珠	1,600	6,176.00	0.05
664	603477	巨星农牧	300	6,174.00	0.05
665	002588	史丹利	700	6,167.00	0.05
666	002985	北摩高科	200	6,050.00	0.05
667	688147	微导纳米	200	6,036.00	0.05
668	600033	福建高速	1,700	6,018.00	0.05
669	688232	新点软件	200	6,008.00	0.05
670	600301	华锡有色	300	5,991.00	0.05
671	000756	新华制药	400	5,968.00	0.05
672	688362	甬矽电子	200	5,956.00	0.04
673	301035	润丰股份	100	5,934.00	0.04
674	605507	国邦医药	300	5,931.00	0.04
675	601595	上海电影	200	5,928.00	0.04
676	600073	光明肉业	800	5,904.00	0.04
677	600339	中油工程	1,800	5,886.00	0.04
677	603328	依顿电子	600	5,886.00	0.04
678	002043	兔宝宝	600	5,880.00	0.04
678	002705	新宝股份	400	5,880.00	0.04
679	001389	广合科技	100	5,877.00	0.04

680	002434	万里扬	800	5,864.00	0.04
681	300119	瑞普生物	300	5,826.00	0.04
682	688206	概伦电子	200	5,816.00	0.04
683	601326	秦港股份	1,800	5,814.00	0.04
684	600861	北京人力	300	5,790.00	0.04
685	688146	中船特气	200	5,782.00	0.04
686	000959	首钢股份	1,700	5,780.00	0.04
687	600710	苏美达	600	5,766.00	0.04
688	300596	利安隆	200	5,754.00	0.04
689	301267	华夏眼科	300	5,751.00	0.04
690	600025	华能水电	600	5,730.00	0.04
691	300261	雅本化学	800	5,720.00	0.04
692	002243	力合科创	700	5,712.00	0.04
693	600018	上港集团	1,000	5,710.00	0.04
694	300129	泰胜风能	800	5,688.00	0.04
695	000090	天健集团	1,600	5,664.00	0.04
696	002461	珠江啤酒	500	5,645.00	0.04
697	301095	广立微	100	5,624.00	0.04
698	300913	兆龙互连	120	5,618.40	0.04
699	605009	豪悦护理	140	5,569.20	0.04
700	688819	天能股份	200	5,552.00	0.04
701	002378	章源钨业	700	5,537.00	0.04
702	688400	凌云光	200	5,514.00	0.04
703	600928	西安银行	1,400	5,488.00	0.04
704	002777	久远银海	300	5,478.00	0.04
705	003006	百亚股份	200	5,476.00	0.04
706	300428	立中集团	300	5,466.00	0.04
707	603919	金徽酒	300	5,430.00	0.04
708	002498	汉缆股份	1,600	5,408.00	0.04
709	601096	宏盛华源	1,300	5,382.00	0.04
710	002511	中顺洁柔	800	5,376.00	0.04
710	600682	南京新百	800	5,376.00	0.04
711	601619	嘉泽新能	1,500	5,370.00	0.04
712	601607	上海医药	300	5,364.00	0.04
713	603713	密尔克卫	100	5,332.00	0.04
714	601992	金隅集团	3,500	5,320.00	0.04
715	603995	甬金股份	300	5,304.00	0.04
716	300926	博俊科技	200	5,294.00	0.04
717	000990	诚志股份	700	5,292.00	0.04
718	688739	成大生物	200	5,280.00	0.04
719	002154	报喜鸟	1,400	5,264.00	0.04
720	600020	中原高速	1,100	5,258.00	0.04
721	603638	艾迪精密	300	5,247.00	0.04

722	603008	喜临门	300	5,244.00	0.04
723	600295	鄂尔多斯	600	5,226.00	0.04
724	002051	中工国际	600	5,178.00	0.04
725	688127	蓝特光学	200	5,142.00	0.04
726	000061	农产品	800	5,112.00	0.04
727	000791	甘肃能源	800	5,104.00	0.04
728	600075	新疆天业	1,200	5,076.00	0.04
729	601500	通用股份	1,100	5,071.00	0.04
730	601101	昊华能源	700	5,068.00	0.04
731	002612	朗姿股份	300	5,052.00	0.04
732	300183	东软载波	300	5,043.00	0.04
733	601827	三峰环境	600	5,040.00	0.04
734	002034	旺能环境	300	5,037.00	0.04
735	300257	开山股份	500	5,035.00	0.04
736	002349	精华制药	700	5,033.00	0.04
737	002101	广东鸿图	400	5,004.00	0.04
738	600783	鲁信创投	400	5,000.00	0.04
739	000950	重药控股	1,000	4,990.00	0.04
740	000028	国药一致	200	4,986.00	0.04
741	000719	中原传媒	400	4,964.00	0.04
742	603609	禾丰股份	600	4,956.00	0.04
743	688150	莱特光电	200	4,944.00	0.04
744	601609	金田股份	700	4,907.00	0.04
745	688128	中国电研	200	4,900.00	0.04
746	002960	青鸟消防	500	4,885.00	0.04
747	300973	立高食品	100	4,877.00	0.04
748	002060	广东建工	1,400	4,872.00	0.04
749	300039	上海凯宝	800	4,848.00	0.04
750	001337	四川黄金	200	4,846.00	0.04
751	600169	太原重工	2,000	4,840.00	0.04
752	000401	冀东水泥	1,100	4,818.00	0.04
753	601107	四川成渝	800	4,816.00	0.04
754	002755	奥赛康	300	4,794.00	0.04
755	601801	皖新传媒	700	4,781.00	0.04
756	000048	京基智农	300	4,770.00	0.04
757	002399	海普瑞	400	4,764.00	0.04
758	002489	浙江永强	1,300	4,758.00	0.04
759	601061	中信金属	600	4,746.00	0.04
760	000672	上峰水泥	600	4,740.00	0.04
761	001203	大中矿业	500	4,725.00	0.04
762	000708	中信特钢	400	4,704.00	0.04
763	301175	中科环保	900	4,653.00	0.04
764	300702	天宇股份	200	4,652.00	0.04

765	002959	小熊电器	100	4,644.00	0.04
766	002516	旷达科技	900	4,635.00	0.03
767	600163	中闽能源	900	4,608.00	0.03
767	605020	永和股份	200	4,608.00	0.03
768	600197	伊力特	300	4,476.00	0.03
769	002941	新疆交建	400	4,456.00	0.03
770	002216	三全食品	400	4,428.00	0.03
771	600966	博汇纸业	1,000	4,420.00	0.03
772	600195	中牧股份	600	4,398.00	0.03
773	600648	外高桥	400	4,372.00	0.03
774	002585	双星新材	800	4,368.00	0.03
775	603229	奥翔药业	500	4,360.00	0.03
776	000968	蓝焰控股	600	4,350.00	0.03
777	300140	节能环保	700	4,319.00	0.03
778	688523	航天环宇	200	4,302.00	0.03
779	301500	飞南资源	200	4,284.00	0.03
780	002697	红旗连锁	800	4,280.00	0.03
781	000869	张裕 A	200	4,246.00	0.03
782	600987	航民股份	600	4,242.00	0.03
783	601236	红塔证券	500	4,235.00	0.03
784	603301	振德医疗	200	4,222.00	0.03
785	603983	丸美生物	100	4,213.00	0.03
786	603025	大豪科技	300	4,206.00	0.03
787	605116	奥锐特	200	4,180.00	0.03
788	600874	创业环保	700	4,179.00	0.03
789	002840	华统股份	400	4,164.00	0.03
790	600780	通宝能源	700	4,151.00	0.03
791	600604	市北高新	800	4,128.00	0.03
792	000498	山东路桥	700	4,116.00	0.03
793	688522	纳睿雷达	80	4,097.60	0.03
794	600662	外服控股	800	4,088.00	0.03
795	603566	普莱柯	300	4,083.00	0.03
796	601869	长飞光纤	100	4,072.00	0.03
797	000550	江铃汽车	200	4,066.00	0.03
798	601921	浙版传媒	500	4,030.00	0.03
799	000885	城发环境	300	3,996.00	0.03
800	601022	宁波远洋	400	3,948.00	0.03
801	688351	微电生理-U	200	3,940.00	0.03
802	600976	健民集团	100	3,921.00	0.03
802	601038	一拖股份	300	3,921.00	0.03
803	603801	志邦家居	400	3,876.00	0.03
804	600058	五矿发展	500	3,865.00	0.03
805	600299	安迪苏	400	3,860.00	0.03

806	300737	科顺股份	800	3,856.00	0.03
807	002267	陕天然气	500	3,785.00	0.03
808	300080	易成新能	900	3,762.00	0.03
809	002946	新乳业	200	3,754.00	0.03
810	688209	英集芯	200	3,694.00	0.03
811	601886	江河集团	600	3,690.00	0.03
812	603055	台华新材	400	3,652.00	0.03
813	301376	致欧科技	200	3,650.00	0.03
814	002901	大博医疗	100	3,624.00	0.03
814	688372	伟测科技	60	3,624.00	0.03
815	000030	富奥股份	600	3,534.00	0.03
816	603730	岱美股份	620	3,527.80	0.03
817	603013	亚普股份	200	3,456.00	0.03
818	300768	迪普科技	200	3,430.00	0.03
819	601083	锦江航运	300	3,333.00	0.03
820	301087	可孚医疗	100	3,320.00	0.03
821	601158	重庆水务	700	3,248.00	0.02
822	301069	凯盛新材	200	3,222.00	0.02
823	002978	安宁股份	100	3,158.00	0.02
824	688526	科前生物	200	3,116.00	0.02
825	600956	新天绿能	400	3,088.00	0.02
826	301339	通行宝	180	3,083.40	0.02
827	603989	艾华集团	200	3,080.00	0.02
828	605296	神农集团	100	3,074.00	0.02
829	600377	宁沪高速	200	3,068.00	0.02
830	301246	宏源药业	200	3,020.00	0.02
831	605168	三人行	100	2,943.00	0.02
832	002913	奥士康	100	2,941.00	0.02
833	002990	盛视科技	100	2,931.00	0.02
834	600618	氯碱化工	300	2,889.00	0.02
835	002275	桂林三金	200	2,862.00	0.02
836	688315	诺禾致源	200	2,824.00	0.02
837	601808	中海油服	200	2,752.00	0.02
838	001311	多利科技	130	2,687.10	0.02
839	000019	深粮控股	400	2,664.00	0.02
840	603530	神马电力	100	2,592.00	0.02
841	605577	龙版传媒	200	2,572.00	0.02
842	001308	康冠科技	100	2,262.00	0.02
843	301327	华宝新能	40	2,054.40	0.02
844	605222	起帆电缆	100	1,514.00	0.01
845	605365	立达信	100	1,473.00	0.01
846	601811	新华文轩	100	1,457.00	0.01
847	603219	富佳股份	100	1,451.00	0.01

848	603132	金徽股份	100	1,327.00	0.01
-----	--------	------	-----	----------	------

7.3.2 期末积极投资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

本报告期末本基金未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	466,812.00	3.52
2	300750	宁德时代	288,339.00	2.17
3	601318	中国平安	184,627.00	1.39
4	688608	恒玄科技	157,722.00	1.19
5	000333	美的集团	155,641.00	1.17
6	002594	比亚迪	149,163.00	1.12
7	600900	长江电力	124,043.00	0.94
8	601899	紫金矿业	118,309.00	0.89
9	600030	中信证券	109,580.00	0.83
10	000858	五粮液	108,061.00	0.81
11	600276	恒瑞医药	100,828.00	0.76
12	000651	格力电器	88,788.00	0.67
13	601211	国泰海通	83,856.00	0.63
14	002625	光启技术	80,243.00	0.61
15	688981	中芯国际	68,434.00	0.52
16	002475	立讯精密	68,313.00	0.52
17	600919	江苏银行	67,890.00	0.51
18	603259	药明康德	67,126.00	0.51
19	688188	柏楚电子	67,088.00	0.51
20	002352	顺丰控股	65,894.00	0.50

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	207,824.00	1.57
2	600519	贵州茅台	154,147.00	1.16
3	600900	长江电力	129,290.00	0.98
4	688608	恒玄科技	77,256.00	0.58
5	600887	伊利股份	65,948.00	0.50
6	601288	农业银行	62,493.00	0.47

7	600879	航天电子	56,535.00	0.43
8	688200	华峰测控	56,318.00	0.42
9	300750	宁德时代	49,866.00	0.38
10	601088	中国神华	47,096.00	0.36
11	601601	中国太保	41,469.00	0.31
12	601988	中国银行	41,391.00	0.31
13	601127	赛力斯	39,057.00	0.29
14	688188	柏楚电子	38,842.00	0.29
15	000333	美的集团	38,703.00	0.29
16	002594	比亚迪	36,957.00	0.28
17	600406	国电南瑞	32,243.00	0.24
18	002352	顺丰控股	31,019.00	0.23
19	601899	紫金矿业	28,945.00	0.22
20	000738	航发控制	28,905.00	0.22

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,558,753.08
卖出股票收入（成交）总额	6,390,801.80

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

中信证券（代码：600030）

2024 年 8 月 5 日，中国证券监督管理委员会贵州监管局对中信证券采取出具警示函的措施，并根据《证券期货市场诚信监督管理办法》（证监会令第 166 号）第七条、第八条规定记入证券期货市场诚信档案，因其保荐的安达科技上市标准含净利润标准，但上市当年即亏损。

2024 年 8 月 23 日，北京证券交易所对中信证券采取出具警示函的自律监管措施，因其保荐的安达科技上市标准含净利润标准，但上市当年即发生亏损。

2024 年 8 月 26 日，深圳证券交易所对中信证券给予通报批评的处分，通报中国证监会，并记入诚信档案。中信证券在执业过程中存在以下违规行为：一、对发行人公司治理规范性和内部控制有效性的核查程序执行不到位。二、对发行人研发投入相关的核查程序执行不到位。三、对发行人收入、成本相关的核查程序执行不到位。四、与关联方相关的核查程序执行不到位。

2024 年 11 月 8 日，深圳证券交易所对中信证券采取书面警示的监管措施。在担任深圳市皓吉达电子科技股份有限公司（以下简称发行人）首次公开发行股票并在创业板上市项目保荐人过程中，存在以下违规行为：一、对发行人实际控制人认定和控制权稳定性的核查程序执行不到位。二、未督促发行人准确、完整披露控股股东的重大股权转让情况。

2024 年 12 月 20 日，深圳证监局对中信证券采取出具警示函的行政监管措施。中信证券在业务开展过程中，存在以下问题：一是经纪业务管理存在不足。二是场外衍生品业务管理存在不足。

2025 年 5 月 14 日，上海证券交易所对中信证券予以监管警示，因其在再融资项目中未及时报告公司最近一年因首发业务被其他交易所纪律处分的情况，导致核查意见与事实不符，违反再融资分类审核规则。

2025 年 6 月 6 日，深圳证券交易所对中信证券采取书面警示的自律监管措施，因其在辉芒微电子首次公开发行股票并在创业板上市的申请保荐中未充分核查经销收入内控有效性、未审慎关

注关联方异常资金流水、未核查生产周期披露准确性。

国泰海通（代码：601211）

2024 年 8 月 5 日，郑州商品交易所对国泰君安证券采取以下处罚：给予上海飒露紫私募基金管理有限公司-国泰君安证券股份有限公司-飒露紫长期价值一号私募证券投资基金、黑龙江云山农业科技开发有限公司自 2024 年 8 月 13 日起暂停全部品种开仓交易 1 个月的纪律处分，并将其纪律处分结果记入证券期货市场诚信档案数据库。因上述当事人于 2024 年 5 月 16 日、5 月 20 日在锰硅期权 SM2407C10000 合约上存在利用对敲手段转移资金的违反交易所规则行为。

2025 年 5 月 23 日，深圳证券交易所对国泰海通证券作为发行人的项目保荐人，存在未充分关注发行人存在的重大内部控制缺陷，未对发行人财务信息的可靠性予以审慎核查，未充分核查发行人研发费用内部控制的有效性，未充分关注发行人收入确认存在的不规范情形，对发行人实际控制人资金占用流向以及关键岗位人员的资金流水核查不到位和未督促发行人及时披露对赌协议的特殊权利条款等情形，导致核查意见不准确，采取给予通报批评的处分。

本基金投资中信证券、国泰海通的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

本基金除中信证券、国泰海通外，投资的前十大证券的发行主体本期没有出现监管部门立案调查，或者在报告编制日前一年内受到公开谴责和处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,261.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,261.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
中航中证智选均衡指数发起 A	47	215,720.32	10,000,277.80	98.63	138,577.47	1.37
中航中证智选均衡指数发起 C	113	17,918.27	0	0.00	2,024,764.04	100.00
合计	152	80,023.81	10,000,277.80	82.21	2,163,341.51	17.79

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	中航中证智选均衡指数发起 A	86,001.94	0.85
	中航中证智选均衡指数发起 C	22,166.94	1.09
	合计	108,168.88	0.89

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本报告期末本基金管理人高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、本基金基金经理未持有本基金。

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,277.80	82.21	10,000,277.80	82.21	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,277.80	82.21	10,000,277.80	82.21	3 年

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中航中证智选均衡指数发起 A	中航中证智选均衡指数发起 C
基金合同生效日 (2025 年 3 月 19 日) 基金份额总额	10,472,386.66	6,139,809.85
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	415,163.47	1,433,117.21
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	748,694.86	5,548,163.02
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	10,138,855.27	2,024,764.04

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2. 2025 年 4 月 19 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 2025 年 4 月 17 日起，裴荣荣担任公司总经理职务，原任公司副总经理职务自行免去。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘任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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	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 (%)	
中航证券有限公司	2	23,949,554.88	100.00	4,931.11	100.00	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式。

2、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。

3、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。

4、本报告期内本基金新增 4 个交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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(%)
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 1 日
2	中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金托管协议	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 1 日
3	中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金招募说明书	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 1 日
4	中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金产品资料概要	管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 1 日
5	中航中证智选均衡配置指数型发起式	上海证券报、管理人网	2025 年 3 月 1 日

	证券投资基金基金份额发售公告	站、中国证监会基金电子披露网站	
6	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 14 日
7	关于中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 18 日
8	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 19 日
9	中航基金管理有限公司关于中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 20 日
10	中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 26 日
11	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 15 日
12	中航基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 18 日
13	中航基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 19 日
14	中航基金管理有限公司关于副董事长刘建先生职务名称变更为联席董事长的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 19 日
15	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 7 日
16	关于中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 20 日
17	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加招商银行股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 5 月 27 日
18	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加华宝证券股份有限公司为销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 6 日
19	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加北京汇成基金销售有限公司为销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 12 日

20	关于中航基金管理有限公司旗下部分产品增加北京新浪仓石基金销售有限公司为销售机构的公告	上海证券报、管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2025 年 6 月 13 日
----	--	---------------------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20250319-20250630	-	10,000,277.80	-	10,000,277.80	82.21
个人	1	20250331-20250527	-	3,000,000.00	1,900,000.00	1,100,000.00	9.04
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一持有人持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。当单一持有人持有份额超 20%时，将面临客户集中度较高的风险，对基金规模的稳定性带来隐患，可能的赎回将可能引发产品的流动性风险。本管理人将加强与客户的沟通，尽量了解申赎意向，审慎确认大额申购与大额赎回，提前做好投资计划，有效防控产品流动性风险，公平对待投资者，保障中小投资者合法权益，本基金管理人拥有完全、独立的投资决策权，不受特定投资者的影响。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《中航中证智选均衡配置指数型发起式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. 报告期内中航中证智选均衡配置指数型发起式证券投资基金在规定媒体上披露的各项公告

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

中航基金管理有限公司

2025 年 8 月 30 日