

泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:泓德基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2025 年 03 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告财务资料经审计，容诚会计师事务所（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2024年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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、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	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	54
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	55
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	88
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	91
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	91
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	91
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	91

8.10 本基金投资股指期货的投资政策	91
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
8.12 投资组合报告附注	92
§9 基金份额持有人信息	93
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	93
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	94
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情况	94
§10 开放式基金份额变动	94
§11 重大事件揭示	94
11.1 基金份额持有人大会决议	94
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	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	95
11.4 基金投资策略的改变	95
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	95
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	95
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	95
11.8 其他重大事件	99
§12 影响投资者决策的其他重要信息	100
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	100
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	100
§13 备查文件目录	100
13.1 备查文件目录	100
13.2 存放地点	101
13.3 查阅方式	101

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泓德泓信混合
基金主代码	002801
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年06月01日
基金管理人	泓德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	109,344,442.46份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，通过股票与债券等资产的合理配置，力争为投资者带来稳健的投资回报。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，从宏观经济环境、国家政策导向、产业转型与变革等多个角度，积极挖掘新经济环境下的投资机遇，精选具有核心竞争优势和持续成长能力的优质上市公司。对于债券投资策略，本基金通过对宏观经济、货币政策、财政政策、资金流动性等影响市场利率的主要因素进行深入研究，结合新券发行情况，综合分析市场利率和信用利差的变动趋势，采取久期调整、收益率曲线配置和券种配置等积极投资策略，把握债券市场投资机会，以获取稳健的投资收益。同时，本基金将本着谨慎原则，从风险管理角度出发，适度参与股指期货、国债期货投资。
业绩比较基准	中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于较高风险、较高收益的品种，其长期风险与收益特征低于股票型基金，高

	于债券型基金、货币市场基金。
--	----------------

注：自2023年12月22日起，泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%”，变更为“中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%”。

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	泓德基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓春
	联系电话	010-59850177
	电子邮箱	lixiaochun@hongdefund.com
客户服务电话	4009-100-888	95588
传真	010-59850195	010-66105798
注册地址	西藏自治区拉萨市柳梧新区 北京大道柳梧城投大厦A-120 6-1	北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址	北京市西城区德胜门外大街1 25号	北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码	100088	100140
法定代表人	王德晓	廖林

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.hongdefund.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区德胜门外大街125号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	容诚会计师事务所(特殊普通	北京市西城区阜成门外大街22号1幢

	合伙)	10层1001-1至1001-26
注册登记机构	泓德基金管理有限公司	北京市西城区德胜门外大街125号

§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
本期已实现收益	377,522.43	-33,427,569.50	-46,457,495.84
本期利润	3,285,949.04	-16,523,056.67	-73,570,759.28
加权平均基金份额 本期利润	0.0137	-0.1115	-0.5699
本期加权平均净值 利润率	1.06%	-6.91%	-29.57%
本期基金份额净值 增长率	6.86%	-7.12%	-22.55%
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	49,842,279.84	110,397,736.40	79,138,764.31
期末可供分配基金 份额利润	0.4558	0.3624	0.8256
期末基金资产净值	159,186,722.30	415,033,240.15	174,996,883.70
期末基金份额净值	1.4558	1.3624	1.8256
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	81.18%	69.55%	82.56%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.05%	1.87%	0.06%	1.83%	1.99%	0.04%
过去六个月	17.57%	1.82%	14.69%	1.81%	2.88%	0.01%
过去一年	6.86%	1.65%	5.80%	1.64%	1.06%	0.01%
过去三年	-23.14%	1.31%	-7.72%	1.04%	-15.42%	0.27%
过去五年	53.28%	1.35%	6.62%	0.91%	46.66%	0.44%
自基金合同生效起至今	81.18%	1.18%	31.56%	0.77%	49.62%	0.41%

注：本基金业绩比较基准的构建及再平衡过程：

根据《泓德基金管理有限公司关于修改泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准的公告》，本基金自2023年12月22日起变更业绩比较基准。原业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%+中证综合债券指数收益率×50%。变更后的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

基准指数的构建原则如下：

（1）中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体状况。

（2）中国债券综合全价指数是由中债金融估值中心有限公司编制，样本债券涵盖的范围全面，具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。

（3）由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照90%、10%的比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

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

泓德泓信混合累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年06月01日-2024年12月31日)



注：根据基金合同的约定，本基金建仓期为6个月，截至报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同关于投资范围及投资限制规定。

3.2.3 过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金	现金形式发	再投资形式	年度利润分	备注

	份额分红数	放总额	发放总额	配合计	
2023年	3.300	24,758,685.18	51,818,614.26	76,577,299.44	-
合计	3.300	24,758,685.18	51,818,614.26	76,577,299.44	-

注：1、本基金于2022年1月1日至2022年12月31日止会计期间未进行利润分配。

2、本基金于2023年1月1日至2023年12月31日止会计期间进行了一次利润分配，权益登记日和红利再投日为2023年10月31日，现金红利发放日为2023年11月2日。

3、本基金于2024年1月1日至2024年12月31日止会计期间未进行利润分配。

§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

本基金基金管理人为泓德基金管理有限公司（以下简称“公司”或“泓德基金”），成立于2015年3月3日，是经中国证监会证监许可[2015]258号文批准设立的公募基金管理公司。公司注册资本为人民币1.43亿元，公司注册地拉萨市。

泓德基金自成立以来，始终以“客户利益最大化”为己任，聚焦主动投资管理。公司建立了科学规范的公司治理结构，全面有效的风险管理体系，稳健的运营保障体系，专业高效的市场服务体系，中长期的激励约束机制，致力于成为能持续为客户创造价值的、受人尊重的专业化资产管理公司。泓德基金坚持长期价值投资理念，以更好地保障客户利益为出发点，强调投资长周期性，同时在产品设计以及产品销售环节配合投资理念的落地执行。

公司已覆盖从公募到专户、从股票投资到固定收益投资、从低风险到高风险等不同产品类型，公募基金产品涵盖股票型、债券型、混合型、货币型等基金品种。

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		
李子昂	本基金的基金经理	2023-10-26	-	11年	硕士研究生，具有基金从业资格，曾任本公司多资产投

					资部投资经理，北京隆慧投资有限公司投资管理部投资经理，华商基金管理有限公司量化投资部量化研究员，泰达宏利基金管理有限公司风险管理与基金评估部助理专员。
--	--	--	--	--	---

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”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从中国证监会《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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《泓德基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《泓德基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

本报告期内，本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（1日内、3日内、5日内）的同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

报告期内，A股市场出现了较大波动，小微盘股票在年初经历了大幅回撤，产品的超额收益也因为市场结构变化和流动性枯竭而受损，我们循序渐进地调整了模型架构、风格约束和成分股占比，并取得了一定的控回撤效果。后续，伴随成交量放大，市场出现明显反弹，同时市场风格再次反转，超额收益也有所修复，期间我们对模型进行了持续迭代，努力克服市场环境变化对超额收益的影响，并积极开发新的模型，力争实现Alpha来源的多样性，5月份开始市场再度掉头向下，成交量持续低迷，超额收益虽然持续修复，但幅度受到一定影响。9月份政治局会议的政策部署，强力提振了市场信心，指数迅速上涨，但选股因子却出现了不同程度的失效，我们采用的AI选股模型总体表现稳健。纵观全年，市场的大幅波动和风格的剧烈变化使我们需要越来越多地应对数据漂移的问题，对我们的模型结构、数据处理和训练方式都提出了新的挑战。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末泓德泓信混合基金份额净值为1.4558元，本报告期内，基金份额净值增长率为6.86%，同期业绩比较基准收益率为5.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年伊始，DeepSeek火爆出圈，低成本高性能的中国大模型点燃了市场的做多热情，同时带来了中国科技股新一轮的价值重估，一时间各行各业纷纷接入DeepSeek，无论是上游的算力厂商还是下游的应用公司都直接受益。纵观AI的发展历史，从早期的感知机到神经网络，再从深度神经网络到大模型，AI经历了螺旋式的发展，伴随着硬件的摩尔定律，一代又一代高性能的模型被开发迭代出来，可以想象，从AI到AGI的过程中，越来越多的行业将通过AI实现降本增效，甚至被AI颠覆。DeepSeek带动了TMT板块的资金流入，抬升了整个板块的估值水平，收窄了国内大厂与美国AI龙头的估值折价，当然，以红利为代表的稳健风格出现明显回调，尽管我们长期坚定看好AI的发展，但短期的行

情依然是风险偏好提升带来的估值修复，真正的企业盈利提升仍需要技术的进一步落地。长期来看，科技创新是改善经济结构、促进经济增长的核心动能，而中短期的经济增长依然需要更加宽松的货币政策和更加积极的财政政策，从近期一系列高层会议的定调和一揽子增量政策的部署，我们可以看到中央对于稳增长的决心。随着信心恢复，成交愈发活跃，市场也逐渐企稳。我们也会努力开发更有效的深度学习模型，努力为投资者获取更好收益。

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，本基金管理人继续完善内部控制体系和内部控制制度，健全管理制度和业务规章，依据国家相关法律法规、内部控制制度、内部管理制度和业务规章、基金合同以及基金招募说明书对本基金的投资、销售、运营等业务中的内部控制完善程度和执行情况进行持续的监察稽核，对监察稽核中发现的问题及时提示，督促改进并跟踪改进效果。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 根据法律法规的要求，推动各业务单元更新、完善内部制度及业务流程。识别业务活动中的关键风险点，确定关键控制活动，持续完善内部控制措施。

(2) 对合同、协议等法律文件及实务运作中存在的法律风险进行识别及防范。

(3) 通过事前合规审核、持续优化合规监控系统、加强合规培训等方面，对业务活动中存在的合规风险进行识别及评估，完成各类合规管理工作。

(4) 按计划完成定期稽核工作，检查内容覆盖公司主要业务部门和业务环节，并对整改情况进行跟踪。

(5) 认真贯彻落实反洗钱各项法律法规，切实履行金融机构的反洗钱法定义务，将反洗钱工作贯穿于公司各项业务流程。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。

本基金管理人制定了证券投资基金估值政策与估值程序，设立基金估值委员会，估值委员会负责指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有多年证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、基金估值运作、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管人有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关

估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已分别与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其分别按约定提供在银行间同业市场交易的债券品种和在交易所市场交易或挂牌的部分债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定以及本基金基金合同第十六部分中对基金利润分配原则的约定，2024年度未实施利润分配。

本基金截至2024年12月31日，期末可供分配利润为49,842,279.84元，其中：未分配利润已实现部分为62,940,219.89元，未分配利润未实现部分为-13,097,940.05元。

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

本报告期内，本基金管理人无应说明的预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人--泓德基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对泓德基金管理有限公司编制和披露的本基金2024年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 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	容诚审字[2025]200Z1926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	泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“泓德泓信混合基金”）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和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泓德泓信混合基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况。
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，我们独立于泓德泓信混合基金，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	-
管理层和治理层对财务报表的责任	泓德泓信混合基金的基金管理人泓德基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责

	<p>按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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泓德泓信混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算泓德泓信混合基金、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泓德泓信混合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</p>

	<p>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，就可能对泓德泓信混合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泓德泓信混合基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、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。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。</p>	
会计师事务所的名称	容诚会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈熹	林佳璐
会计师事务所的地址	北京市西城区阜成门外大街22号1幢10层1001-1至1001-26	
审计报告日期	2025-03-25	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

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	12,161,440.18	18,638,736.00

结算备付金		1,850,404.61	4,541,650.02
存出保证金		68,150.74	880,235.73
交易性金融资产	7.4.7.2	154,847,436.15	388,925,719.17
其中：股票投资		144,593,345.28	377,732,469.50
基金投资		-	-
债券投资		10,254,090.87	11,193,249.67
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	-	-
应收清算款		1,159,716.59	7,148,464.78
应收股利		-	-
应收申购款		41,452.25	1,811.20
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		170,128,600.52	420,136,616.90
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
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		-	4,152,371.87
应付赎回款		10,590,972.67	413.83
应付管理人报酬		122,537.40	272,925.72
应付托管费		22,975.76	51,173.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		0.35	3.47
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	205,392.04	626,488.26
负债合计		10,941,878.22	5,103,376.75
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	109,344,442.46	304,635,503.75
未分配利润	7.4.7.8	49,842,279.84	110,397,736.40
净资产合计		159,186,722.30	415,033,240.15
负债和净资产总计		170,128,600.52	420,136,616.90

注：报告截止日2024年12月31日，基金份额净值1.4558元，基金份额总额109,344,442.46份。

7.2 利润表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
一、营业总收入		6,449,162.74	-14,034,738.10
1.利息收入		110,984.79	60,950.95
其中：存款利息收入	7.4.7.9	110,984.79	60,950.95
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）		2,347,102.98	-31,059,763.25
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-3,197,459.10	-33,867,105.52

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	408,320.53	350,612.20
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-381,897.52	32,486.63
股利收益	7.4.7.13	5,518,139.07	2,424,243.44
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.14	2,908,426.61	16,904,512.83
4.汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.15	1,082,648.36	59,561.37
减：二、营业总支出		3,163,213.70	2,488,318.57
1.管理人报酬		2,483,777.55	1,910,041.85
2.托管费		465,708.18	358,132.95
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		2.10	166.18
8.其他费用	7.4.7.16	213,725.87	219,977.59
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		3,285,949.04	-16,523,056.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		3,285,949.04	-16,523,056.67
五、其他综合收益的税后净 额		-	-

六、综合收益总额		3,285,949.04	-16,523,056.67
----------	--	--------------	----------------

7.3 净资产变动表

会计主体：泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15
二、本期期初净资产	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-195,291,061.29	-60,555,456.56	-255,846,517.85
（一）、综合收益总额	-	3,285,949.04	3,285,949.04
（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）	-195,291,061.29	-63,841,405.60	-259,132,466.89
其中：1.基金申购款	182,315,249.00	58,331,031.93	240,646,280.93
2.基金赎回款	-377,606,310.29	-122,172,437.53	-499,778,747.82
（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、本期期末净资产	109,344,442.46	49,842,279.84	159,186,722.30

项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	95,858,119.39	79,138,764.31	174,996,883.70
二、本期期初净资产	95,858,119.39	79,138,764.31	174,996,883.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	208,777,384.36	31,258,972.09	240,036,356.45
（一）、综合收益总额	-	-16,523,056.67	-16,523,056.67
（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）	208,777,384.36	124,359,328.20	333,136,712.56
其中：1.基金申购款	238,799,054.06	144,421,847.40	383,220,901.46
2.基金赎回款	-30,021,669.70	-20,062,519.20	-50,084,188.90
（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）	-	-76,577,299.44	-76,577,299.44
四、本期期末净资产	304,635,503.75	110,397,736.40	415,033,240.15

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：

王德晓

李娇

王玲

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

泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]967号《关于准予泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由泓德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型，自基金合同生效之日起至18个月后对应日的前一个工作日（含该日）止的期间内采用封闭式运作方式，如不存在该对应日的，顺延至下一工作日，封闭期结束后转为开放式运作，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集847,529,845.47元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2016）第699号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年6月1日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为847,544,853.76份，其中认购资金利息折合15,008.29份基金份额。本基金的基金管理人为泓德基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类品种，国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转换债券）、可交换债券、资产支持证券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、中期票据、债券回购和银行存款、同业存单等固定收益类投资工具，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相关规定。本基金的投资组合比例为：封闭期内股票资产占基金资产的比例范围为0%-100%；转为开放式运作后股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%。本基金如果投资股指期货、国债期货，则在封闭期内，每个交易日日终扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持不低于交易保证金一倍的现金；转为开放式运作后，每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应保持现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×90%+中国债券综合全价指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人泓德基金管理有限公司于2025年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规

定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

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。本基金持有

的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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，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。

本基金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。

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

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

计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

本基金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。

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；或者(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、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们都必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

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。债券投资和资产支持证券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及在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税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则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对

基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

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	12,161,440.18	18,638,736.00
等于：本金	12,160,713.57	18,636,590.55
加：应计利息	726.61	2,145.45
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	12,161,440.18	18,638,736.00
----	---------------	---------------

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		144,624,669.88	-	144,593,345.28	-31,324.60
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	15,000.00	0.46	15,000.46	-
	银行间市场	10,065,600.00	213,090.41	10,239,090.41	-39,600.00
	合计	10,080,600.00	213,090.87	10,254,090.87	-39,600.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		154,705,269.88	213,090.87	154,847,436.15	-70,924.60
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		380,716,181.14	-	377,732,469.50	-2,983,711.64
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	765,400.00	438.20	933,178.63	167,340.43
	银行间市场	10,075,720.00	235,071.04	10,260,071.04	-50,720.00
	合计	10,841,120.00	235,509.24	11,193,249.67	116,620.43
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		391,557,301.14	235,509.24	388,925,719.17	-2,867,091.21

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,636,420.00	-	-	-
--股指期货	6,636,420.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,636,420.00	-	-	-

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

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

无。

7.4.7.6 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	23,804.66	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	133,587.38	446,488.26
其中：交易所市场	133,587.38	446,488.26
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	48,000.00	180,000.00
合计	205,392.04	626,488.26

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,635,503.75	304,635,503.75
本期申购	182,315,249.00	182,315,249.00
本期赎回（以“-”号填列）	-377,606,310.29	-377,606,310.29
本期末	109,344,442.46	109,344,442.46

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	122,816,213.06	-12,418,476.66	110,397,736.40
本期期初	122,816,213.06	-12,418,476.66	110,397,736.40
本期利润	377,522.43	2,908,426.61	3,285,949.04
本期基金份额交易产生的变动数	-60,253,515.60	-3,587,890.00	-63,841,405.60

其中：基金申购款	68,634,611.98	-10,303,580.05	58,331,031.93
基金赎回款	-128,888,127.58	6,715,690.05	-122,172,437.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	62,940,219.89	-13,097,940.05	49,842,279.84

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	56,008.63	36,692.36
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	53,439.48	23,507.54
其他	1,536.68	751.05
合计	110,984.79	60,950.95

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	2,490,756,811.53	1,895,124,532.63
减：卖出股票成本总额	2,491,522,885.47	1,926,203,149.79
减：交易费用	2,431,385.16	2,788,488.36
买卖股票差价收入	-3,197,459.10	-33,867,105.52

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
债券投资收益——利息收入	274,728.78	272,236.77
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	133,591.75	78,375.43
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	408,320.53	350,612.20

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月 31日	2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	11,616,641.63	10,523,406.19
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	11,168,020.00	10,244,780.00
减：应计利息总额	314,802.75	200,062.81
减：交易费用	227.13	187.95
买卖债券差价收入	133,591.75	78,375.43

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 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01月01日至2024年 12月31日	2023年01月01日至2023年 12月31日
股指期货投资收益	-381,897.52	32,486.63

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,518,139.07	2,424,243.44
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,518,139.07	2,424,243.44

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	2,796,166.61	17,016,772.83
——股票投资	2,952,387.04	16,895,772.40
——债券投资	-156,220.43	121,000.43
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	112,260.00	-112,260.00
——权证投资	-	-
——期货投资	112,260.00	-112,260.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-

合计	2,908,426.61	16,904,512.83
----	--------------	---------------

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
基金赎回费收入	971,353.53	44,623.01
基金转换费收入	111,294.83	14,938.36
合计	1,082,648.36	59,561.37

注：1、本基金的赎回费率随着持有期限的增加而递减，将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中不低于赎回费25%的部分归入转出基金的基金资产。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	48,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	8,525.87	2,777.59
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,200.00
合计	213,725.87	219,977.59

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

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泓德基金管理有限公司（以下简称“泓德基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）	基金托管人、基金销售机构
王德晓	基金管理人的自然人股东
阳光资产管理股份有限公司	基金管理人股东
珠海市基业长青投资中心（有限合伙）	基金管理人股东
泓德基业（西藏）企业管理有限公司	基金管理人股东
南京民生租赁股份有限公司	基金管理人股东
江苏岛村实业发展有限公司	基金管理人股东
珠海市崇德企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
上海捷朔信息技术有限公司	基金管理人股东
珠海市广业企业管理咨询中心（有限合伙）	基金管理人股东
温永鹏	基金管理人的自然人股东
李晓春	基金管理人的自然人股东
王克玉	基金管理人的自然人股东
秦毅	基金管理人的自然人股东
李娇	基金管理人的自然人股东
李操纲	基金管理人的自然人股东

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

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 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,483,777.55	1,910,041.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	31,265.42	25,129.58
应支付基金管理人的净管理费	2,452,512.13	1,884,912.27

注：支付基金管理人泓德基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	465,708.18	358,132.95

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

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

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年12月31日
报告期初持有的基金份额	35,353,087.68	11,609,107.83
报告期间申购/买入总份额	-	23,743,979.85

报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	35,353,087.68	-
报告期末持有的基金份额	-	35,353,087.68
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	11.61%

注：1.申购/买入总份额含红利再投、转换（入）份额、强制调增份额，赎回/卖出总份额含转换（出）份额、强制调减份额。

2.基金管理人投资本基金的相关费用符合基金招募说明书及相关临时公告、交易所、登记结算机构的有关规定。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	356,488.47	0.33%	3,359,385.72	1.10%
泓德基业(西藏)企业管理有限公司	6,524,368.76	5.97%	30,809,733.01	10.11%

7.4.10.5 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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年01月01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
中国工商银行	12,161,440.18	56,008.63	18,638,736.00	36,692.36

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月以上	限售股	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6个月以上	限售股	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月以上	限售股	17.58	33.06	904	15,892.32	29,886.24	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月以上	限售股	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
688615	合合信息	2024-09-19	6个月以上	限售股	55.18	165.78	161	8,883.98	26,690.58	-
301522	上大股份	2024-10-09	6个月以上	限售股	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-

603072	天和磁材	2024-12-24	7个交易日	新股未上市	12.30	12.30	1,379	16,961.70	16,961.70	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6个月以上	限售股	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024-10-10	6个月以上	限售股	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024-08-14	6个月以上	限售股	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6个月以上	限售股	21.21	36.49	357	7,571.97	13,026.93	-
301608	博实结	2024-07-25	6个月以上	限售股	44.50	65.38	178	7,921.00	11,637.64	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月以上	限售股	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024-08-27	6个月以上	限售股	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301613	新铝时代	2024-10-18	6个月以上	限售股	27.70	41.77	266	7,368.20	11,110.82	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6个月以上	限售股	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
001391	国货航	2024-12-23	6个月以上	限售股	2.30	6.80	1,406	3,233.80	9,560.80	-

301607	富特科技	2024-08-28	6个月以上	限售股	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301552	科力装备	2024-07-15	6个月以上	限售股	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6个月以上	限售股	23.95	35.85	207	4,957.65	7,420.95	-
001279	强邦新材	2024-09-27	6个月以上	限售股	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603207	小方制药	2024-08-19	6个月以上	限售股	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6个月以上	限售股	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6个月以上	限售股	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603194	中力股份	2024-12-17	6个月以上	限售股	20.32	28.13	141	2,865.12	3,966.33	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月以上	限售股	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603205	健尔康	2024-10-29	6个月以上	限售股	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月以上	限售股	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-

603310	巍华新材	2024-08-07	6个月以上	限售股	17.39	17.95	148	2,573.72	2,656.60	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月以上	新股未上市且限售	12.30	12.30	154	1,894.20	1,894.20	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110098	南药转债	2024-12-26	16个交易日	新债未上市	100.00	100.00	150	15,000.00	15,000.46	-

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

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	2024-12-23	重大资产重组	7.22	2025-01-07	6.93	13,600	93,020.00	98,192.00	-

注：本基金截至2024年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人致力于全面内部控制体系的建设，建立了从董事会层面到各业务部门的风险管理组织架构。本基金的基金管理人在董事会下设风险控制委员会，主要负责制定基金管理人风险控制战略和控制政策等事项；督察长负责对基金管理人各业务环节合法合规运作进行监督检查，组织、指导基金管理人内部监察稽核工作，并可向董事会和中国证监会直接报告；在公司内部设立独立的监察稽核部，专职负责对基金管理人各部门、各业务的风险控制情况进行督促和检查，并适时提出整改建议。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，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。

7.4.13.2 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。

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他信用良好的境内商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以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。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券(若有)占基金资产净值的比例为0.01%(上年度末：0.22%)。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金严格按照相关法律法规要求、基金合同约定的投资范围与比例限制实施投资管理，确保投资组合资产变现能力与投资者赎回需求保持动态平衡。

在资产端，本基金遵循组合管理、分散投资的基本原则，主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人对基金持有资产的集中度、高流动性资产比例、流动性受限资产比例、逆回购分布等指标进行监控，定期开展压力测试，持续对投资组合流动性水平进行监测与评估。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，除在“7.4.12期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限的情况外（如有），其余均能及时变现。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

于本报告期末，本基金持有的流动性受限资产占基金资产净值比例、单一证券占基金资产净值比例及7日可变现资产价值等流动性指标均符合法律法规的要求。

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

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

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	12,161,440.18	-	-	-	12,161,440.18
结算备付金	1,850,404.61	-	-	-	1,850,404.61
存出保证金	68,150.74	-	-	-	68,150.74
交易性金融资产	10,239,090.41	-	15,000.46	144,593,345.28	154,847,436.15
应收清算款	-	-	-	1,159,716.59	1,159,716.59
应收申购款	-	-	-	41,452.25	41,452.25
资产总计	24,319,085.94	-	15,000.46	145,794,514.12	170,128,600.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,590,972.67	10,590,972.67
应付管理人报酬	-	-	-	122,537.40	122,537.40
应付托管费	-	-	-	22,975.76	22,975.76
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	205,392.04	205,392.04
负债总计	-	-	-	10,941,878.22	10,941,878.22
利率敏感度缺口	24,319,085.94	-	15,000.46	134,852,635.90	159,186,722.30
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	18,638,736.00	-	-	-	18,638,736.00
结算备付金	4,541,650.02	-	-	-	4,541,650.02

存出保证金	97,336.53	-	-	782,899.20	880,235.73
交易性金融资产	10,260,071.04	-	933,178.63	377,732,469.50	388,925,719.17
应收清算款	-	-	-	7,148,464.78	7,148,464.78
应收申购款	-	-	-	1,811.20	1,811.20
资产总计	33,537,793.59	-	933,178.63	385,665,644.68	420,136,616.90
负债					
应付清算款	-	-	-	4,152,371.87	4,152,371.87
应付赎回款	-	-	-	413.83	413.83
应付管理人报酬	-	-	-	272,925.72	272,925.72
应付托管费	-	-	-	51,173.60	51,173.60
应交税费	-	-	-	3.47	3.47
其他负债	-	-	-	626,488.26	626,488.26
负债总计	-	-	-	5,103,376.75	5,103,376.75
利率敏感度缺口	33,537,793.59	-	933,178.63	380,562,267.93	415,033,240.15

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，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券（若有）公允价值占基金资产净值的比例为6.44%(上年度末：2.70%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年度末：同)。

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时地对风险进行跟踪和控制。

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	144,593,345.28	90.83	377,732,469.50	91.01
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	144,593,345.28	90.83	377,732,469.50	91.01

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资（附注7.4.7.3）。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化5%，其他变量不变		
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%	7,644,505.31	31,150,837.08
	业绩比较基准下降5%	-7,644,505.31	-31,150,837.08

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	144,077,246.51	378,451,271.29
第二层次	10,371,138.77	10,260,071.04
第三层次	399,050.87	214,376.84
合计	154,847,436.15	388,925,719.17

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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01月01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	-	214,376.84	214,376.84
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	990,368.24	990,368.24
转出第三层次	-	601,121.26	601,121.26
当期利得或损失总额	-	-204,572.95	-204,572.95
其中：计入损益的利得或损失	-	-204,572.95	-204,572.95
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	399,050.87	399,050.87
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	-	-56,236.18	-56,236.18
项目	上年度可比期间 2023年01月01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	-	731,804.60	731,804.60
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	324,434.71	324,434.71
转出第三层次	-	899,227.41	899,227.41
当期利得或损失总额	-	57,364.94	57,364.94
其中：计入损益的利得或损失	-	57,364.94	57,364.94
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	214,376.84	214,376.84
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	-	-58,207.83	-58,207.83

损失的变动——公允价值变动损益			
-----------------	--	--	--

注：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主要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，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。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
股票投资	399,050.87	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	26.65%-57.44%	负相关
股票投资	-	现金流贴现法	加权平均资本成本	8.5%	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
股票投资	214,376.84	平均价格亚式期权模型	股价的预期年化波动率	27.16%-219.88%	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

无。

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

无。

§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	144,593,345.28	84.99
	其中：股票	144,593,345.28	84.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,254,090.87	6.03
	其中：债券	10,254,090.87	6.03
	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	14,011,844.79	8.24
8	其他各项资产	1,269,319.58	0.75
9	合计	170,128,600.52	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,375,606.00	0.86
B	采矿业	6,354,741.00	3.99
C	制造业	91,525,093.55	57.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,734,133.00	2.35
E	建筑业	1,527,014.00	0.96
F	批发和零售业	4,497,352.10	2.83
G	交通运输、仓储和邮政业	3,657,417.80	2.30
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,564,423.89	6.01

J	金融业	15,373,722.00	9.66
K	房地产业	1,895,845.00	1.19
L	租赁和商务服务业	1,331,349.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	990,074.94	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	1,016,106.00	0.64
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	719,754.00	0.45
R	文化、体育和娱乐业	1,030,713.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	144,593,345.28	90.83

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	29,000	845,930.00	0.53
2	601319	中国人保	85,500	651,510.00	0.41
3	300502	新易盛	5,200	601,016.00	0.38
4	000050	深天马 A	65,900	595,077.00	0.37
5	000725	京东方 A	135,400	594,406.00	0.37
6	002500	山西证券	91,800	576,504.00	0.36
7	300002	神州泰岳	49,300	571,387.00	0.36
8	600096	云天化	25,400	566,420.00	0.36
9	601179	中国西电	73,600	558,624.00	0.35
10	600998	九州通	108,168	553,820.16	0.35
11	600925	苏能股份	104,100	551,730.00	0.35
12	601318	中国平安	10,300	542,295.00	0.34
13	601168	西部矿业	33,200	533,524.00	0.34
14	002266	浙富控股	164,900	514,488.00	0.32

15	600707	彩虹股份	61,200	503,064.00	0.32
16	000933	神火股份	29,200	493,480.00	0.31
17	601399	国机重装	157,500	485,100.00	0.30
18	600968	海油发展	113,400	484,218.00	0.30
19	600928	西安银行	134,100	484,101.00	0.30
20	002273	水晶光电	21,600	479,952.00	0.30
21	601212	白银有色	167,600	465,928.00	0.29
22	002128	电投能源	23,600	462,088.00	0.29
23	600519	贵州茅台	300	457,200.00	0.29
24	000686	东北证券	57,400	455,756.00	0.29
25	600219	南山铝业	113,500	443,785.00	0.28
26	000783	长江证券	64,600	440,572.00	0.28
27	600517	国网英大	79,200	436,392.00	0.27
28	002532	天山铝业	55,400	435,998.00	0.27
29	601919	中远海控	28,000	434,000.00	0.27
30	688425	铁建重工	98,400	432,960.00	0.27
31	601108	财通证券	52,900	432,193.00	0.27
32	600959	江苏有线	128,900	431,815.00	0.27
33	300289	利德曼	87,400	428,260.00	0.27
34	601899	紫金矿业	28,100	424,872.00	0.27
35	600435	北方导航	43,500	424,560.00	0.27
36	600299	安迪苏	33,500	420,425.00	0.26
37	600879	航天电子	45,800	410,368.00	0.26
38	002724	海洋王	76,000	404,320.00	0.25
39	002881	美格智能	13,400	401,464.00	0.25
40	600361	创新新材	103,900	401,054.00	0.25
41	601958	金钼股份	39,300	395,358.00	0.25
42	600418	江淮汽车	10,500	393,750.00	0.25
43	601228	广州港	115,900	392,901.00	0.25
44	002517	恺英网络	28,700	390,607.00	0.25
45	600578	京能电力	110,800	390,016.00	0.25

46	002745	木林森	44,600	388,912.00	0.24
47	000967	盈峰环境	77,800	386,666.00	0.24
48	603799	华友钴业	13,200	386,232.00	0.24
49	002550	千红制药	61,800	383,160.00	0.24
50	002563	森马服饰	54,500	382,590.00	0.24
51	601528	瑞丰银行	67,700	381,151.00	0.24
52	002970	锐明技术	8,000	381,040.00	0.24
53	002414	高德红外	50,882	378,053.26	0.24
54	601788	光大证券	20,800	376,688.00	0.24
55	601825	沪农商行	44,200	376,142.00	0.24
56	688055	龙腾光电	90,958	375,656.54	0.24
57	300866	安克创新	3,840	374,937.60	0.24
58	000156	华数传媒	52,000	374,400.00	0.24
59	605166	聚合顺	31,100	372,267.00	0.23
60	603577	汇金通	46,500	371,535.00	0.23
61	000509	华塑控股	111,300	370,629.00	0.23
62	601211	国泰君安	19,800	369,270.00	0.23
63	300724	捷佳伟创	5,800	366,618.00	0.23
64	603699	纽威股份	16,400	363,588.00	0.23
65	002001	新和成	16,500	362,505.00	0.23
66	601158	重庆水务	73,100	358,190.00	0.23
67	300604	长川科技	8,100	357,453.00	0.22
68	600383	金地集团	80,600	353,028.00	0.22
69	601568	北元集团	83,900	352,380.00	0.22
70	601601	中国太保	10,200	347,616.00	0.22
71	688798	艾为电子	4,937	344,701.34	0.22
72	000559	万向钱潮	55,900	343,785.00	0.22
73	600000	浦发银行	33,200	341,628.00	0.21
74	002241	歌尔股份	13,200	340,692.00	0.21
75	002926	华西证券	40,600	337,386.00	0.21
76	301267	华夏眼科	17,600	335,104.00	0.21

77	002498	汉缆股份	98,800	334,932.00	0.21
78	002625	光启技术	7,000	334,600.00	0.21
79	000959	首钢股份	109,400	333,670.00	0.21
80	601336	新华保险	6,700	332,990.00	0.21
81	600739	辽宁成大	32,000	331,200.00	0.21
82	002557	洽洽食品	11,400	331,170.00	0.21
83	600390	五矿资本	51,200	330,240.00	0.21
84	603893	瑞芯微	3,000	330,180.00	0.21
85	603129	春风动力	2,100	329,847.00	0.21
86	600918	中泰证券	50,100	329,157.00	0.21
87	601288	农业银行	61,600	328,944.00	0.21
88	601665	齐鲁银行	57,900	323,661.00	0.20
89	600563	法拉电子	2,700	321,084.00	0.20
90	601608	中信重工	76,300	320,460.00	0.20
91	002385	大北农	73,400	317,822.00	0.20
92	002330	得利斯	71,600	312,892.00	0.20
93	600873	梅花生物	30,900	309,927.00	0.19
94	601886	江河集团	57,100	308,340.00	0.19
95	002019	亿帆医药	28,700	307,664.00	0.19
96	000423	东阿阿胶	4,900	307,328.00	0.19
97	603408	建霖家居	24,400	305,732.00	0.19
98	000404	长虹华意	41,200	304,880.00	0.19
99	300447	全信股份	21,400	303,238.00	0.19
100	600488	津药药业	71,500	303,160.00	0.19
101	301015	百洋医药	12,500	302,625.00	0.19
102	000623	吉林敖东	17,500	302,225.00	0.19
103	600909	华安证券	49,800	301,788.00	0.19
104	000039	中集集团	38,700	300,699.00	0.19
105	000528	柳工	24,900	300,294.00	0.19
106	002027	分众传媒	42,400	298,072.00	0.19
107	300433	蓝思科技	13,600	297,840.00	0.19

108	002673	西部证券	36,500	297,475.00	0.19
109	002202	金风科技	28,700	296,471.00	0.19
110	603601	再升科技	87,300	293,328.00	0.18
111	300750	宁德时代	1,100	292,600.00	0.18
112	600827	百联股份	26,500	289,645.00	0.18
113	002203	海亮股份	26,900	289,175.00	0.18
114	600216	浙江医药	18,200	288,652.00	0.18
115	002384	东山精密	9,859	287,882.80	0.18
116	000100	TCL科技	57,200	287,716.00	0.18
117	600066	宇通客车	10,900	287,542.00	0.18
118	600050	中国联通	54,100	287,271.00	0.18
119	600871	石化油服	140,600	286,824.00	0.18
120	600282	南钢股份	61,000	286,090.00	0.18
121	300628	亿联网络	7,300	281,780.00	0.18
122	601666	平煤股份	28,000	280,560.00	0.18
123	600084	中信尼雅	53,100	279,306.00	0.18
124	601717	郑煤机	21,500	279,070.00	0.18
125	600820	隧道股份	38,700	278,253.00	0.17
126	600718	东软集团	25,600	275,712.00	0.17
127	600887	伊利股份	9,100	274,638.00	0.17
128	000703	恒逸石化	43,700	274,436.00	0.17
129	000877	天山股份	48,300	273,378.00	0.17
130	600268	国电南自	40,300	270,816.00	0.17
131	003035	南网能源	64,100	267,938.00	0.17
132	600131	国网信通	14,100	266,631.00	0.17
133	002224	三力士	61,400	265,248.00	0.17
134	002648	卫星化学	14,000	263,060.00	0.17
135	601995	中金公司	7,800	262,782.00	0.17
136	601128	常熟银行	34,700	262,679.00	0.17
137	600380	健康元	23,100	260,337.00	0.16
138	601106	中国一重	89,300	259,863.00	0.16

139	600018	上港集团	42,300	258,876.00	0.16
140	000790	华神科技	66,300	258,570.00	0.16
141	000166	申万宏源	48,300	258,405.00	0.16
142	601137	博威合金	12,700	257,810.00	0.16
143	300972	万辰集团	3,200	257,312.00	0.16
144	688772	珠海冠宇	16,000	257,280.00	0.16
145	600610	中毅达	60,700	256,761.00	0.16
146	600731	湖南海利	45,000	256,500.00	0.16
147	003022	联泓新科	18,600	256,122.00	0.16
148	601018	宁波港	66,200	254,870.00	0.16
149	002594	比亚迪	900	254,394.00	0.16
150	000401	冀东水泥	48,600	254,178.00	0.16
151	300110	华仁药业	71,500	251,680.00	0.16
152	603600	永艺股份	21,100	250,879.00	0.16
153	688208	道通科技	6,376	249,684.16	0.16
154	300111	向日葵	76,800	248,832.00	0.16
155	002636	金安国纪	32,100	248,454.00	0.16
156	000333	美的集团	3,300	248,226.00	0.16
157	605333	沪光股份	7,600	247,988.00	0.16
158	300253	卫宁健康	34,600	247,736.00	0.16
159	000598	兴蓉环境	32,500	246,675.00	0.15
160	603858	步长制药	15,600	246,480.00	0.15
161	002797	第一创业	29,500	246,325.00	0.15
162	300185	通裕重工	95,700	245,949.00	0.15
163	688779	五矿新能	46,141	245,470.12	0.15
164	600900	长江电力	8,300	245,265.00	0.15
165	600688	上海石化	81,100	244,922.00	0.15
166	688550	瑞联新材	7,775	243,279.75	0.15
167	601628	中国人寿	5,800	243,136.00	0.15
168	300682	朗新集团	19,900	242,780.00	0.15
169	603508	思维列控	10,200	242,556.00	0.15

170	601377	兴业证券	38,700	242,262.00	0.15
171	002726	龙大美食	30,400	240,768.00	0.15
172	600419	天润乳业	25,700	239,267.00	0.15
173	600109	国金证券	27,400	239,202.00	0.15
174	600655	豫园股份	37,200	239,196.00	0.15
175	600958	东方证券	22,500	237,600.00	0.15
176	600956	新天绿能	31,500	237,510.00	0.15
177	603173	福斯达	10,300	237,415.00	0.15
178	603201	常润股份	14,000	236,740.00	0.15
179	688019	安集科技	1,695	236,215.20	0.15
180	603979	金诚信	6,500	235,950.00	0.15
181	603595	东尼电子	13,700	234,133.00	0.15
182	300475	香农芯创	8,200	233,618.00	0.15
183	688018	乐鑫科技	1,068	232,824.00	0.15
184	601231	环旭电子	14,100	232,650.00	0.15
185	002418	康盛股份	94,900	231,556.00	0.15
186	601156	东航物流	13,700	231,119.00	0.15
187	601058	赛轮轮胎	16,100	230,713.00	0.14
188	688509	正元地信	57,954	230,077.38	0.14
189	688183	生益电子	5,857	229,945.82	0.14
190	688981	中芯国际	2,400	227,088.00	0.14
191	600271	航天信息	24,900	226,839.00	0.14
192	600867	通化东宝	28,100	226,486.00	0.14
193	600166	福田汽车	89,800	225,398.00	0.14
194	300699	光威复材	6,500	225,225.00	0.14
195	601866	中远海发	85,600	223,416.00	0.14
196	603688	石英股份	7,750	222,657.50	0.14
197	603077	和邦生物	109,000	222,360.00	0.14
198	002506	协鑫集成	82,700	220,809.00	0.14
199	603707	健友股份	16,600	220,282.00	0.14
200	002867	周大生	15,100	219,403.00	0.14

201	000630	铜陵有色	67,900	219,317.00	0.14
202	600710	苏美达	23,500	218,550.00	0.14
203	002368	太极股份	9,200	217,856.00	0.14
204	603609	禾丰股份	25,200	217,224.00	0.14
205	301165	锐捷网络	3,000	216,600.00	0.14
206	600663	陆家嘴	22,000	216,480.00	0.14
207	000825	太钢不锈	62,200	216,456.00	0.14
208	002544	普天科技	10,100	216,443.00	0.14
209	601688	华泰证券	12,300	216,357.00	0.14
210	002311	海大集团	4,400	215,820.00	0.14
211	300558	贝达药业	4,000	215,720.00	0.14
212	002156	通富微电	7,300	215,715.00	0.14
213	000776	广发证券	13,300	215,593.00	0.14
214	603256	宏和科技	25,800	215,430.00	0.14
215	600499	科达制造	27,600	215,280.00	0.14
216	002340	格林美	32,800	214,184.00	0.13
217	601002	晋亿实业	49,200	214,020.00	0.13
218	002132	恒星科技	78,000	213,720.00	0.13
219	600428	中远海特	29,200	213,160.00	0.13
220	002546	新联电子	49,200	213,036.00	0.13
221	600583	海油工程	38,900	212,783.00	0.13
222	300394	天孚通信	2,320	211,955.20	0.13
223	603298	杭叉集团	11,800	211,102.00	0.13
224	002465	海格通信	19,200	210,816.00	0.13
225	002996	顺博合金	31,730	210,687.20	0.13
226	000807	云铝股份	15,400	208,362.00	0.13
227	603697	有友食品	20,200	205,636.00	0.13
228	000655	金岭矿业	33,300	204,795.00	0.13
229	002688	金河生物	45,800	204,726.00	0.13
230	600496	精工钢构	67,700	204,454.00	0.13
231	605117	德业股份	2,400	203,520.00	0.13

232	600582	天地科技	32,900	203,322.00	0.13
233	300761	立华股份	10,400	202,384.00	0.13
234	600489	中金黄金	16,800	202,104.00	0.13
235	600118	中国卫星	7,400	202,020.00	0.13
236	002609	捷顺科技	24,400	201,544.00	0.13
237	300705	九典制药	11,200	201,040.00	0.13
238	601000	唐山港	42,600	200,646.00	0.13
239	600101	明星电力	22,800	200,640.00	0.13
240	688127	蓝特光学	7,400	200,540.00	0.13
241	688606	奥泰生物	3,165	200,344.50	0.13
242	002180	纳思达	7,100	200,007.00	0.13
243	300529	健帆生物	6,800	199,512.00	0.13
244	601877	正泰电器	8,500	198,985.00	0.13
245	301187	欧圣电气	5,800	197,780.00	0.12
246	000539	粤电力A	43,500	197,055.00	0.12
247	688009	中国通号	31,469	196,995.94	0.12
248	688588	凌志软件	14,200	195,960.00	0.12
249	002261	拓维信息	10,700	195,917.00	0.12
250	688122	西部超导	4,575	195,901.50	0.12
251	601162	天风证券	43,700	195,776.00	0.12
252	002255	海陆重工	35,200	195,712.00	0.12
253	002371	北方华创	500	195,500.00	0.12
254	600143	金发科技	22,600	195,264.00	0.12
255	300777	中简科技	6,900	195,201.00	0.12
256	300674	宇信科技	10,000	195,200.00	0.12
257	600649	城投控股	43,800	194,910.00	0.12
258	002891	中宠股份	5,400	192,780.00	0.12
259	605305	中际联合	6,800	192,644.00	0.12
260	002212	天融信	29,800	192,210.00	0.12
261	300821	东岳硅材	24,600	190,896.00	0.12
262	002111	威海广泰	17,300	190,646.00	0.12

263	688408	中信博	2,641	190,152.00	0.12
264	600516	方大炭素	39,300	189,819.00	0.12
265	002670	国盛金控	14,400	188,496.00	0.12
266	605080	浙江自然	8,000	188,000.00	0.12
267	601279	英利汽车	49,000	187,670.00	0.12
268	600536	中国软件	4,000	186,760.00	0.12
269	688578	艾力斯	3,116	186,648.40	0.12
270	002753	永东股份	29,700	186,219.00	0.12
271	002044	美年健康	40,500	185,895.00	0.12
272	601728	中国电信	25,700	185,554.00	0.12
273	002109	兴化股份	58,500	185,445.00	0.12
274	600173	卧龙地产	46,800	185,328.00	0.12
275	002678	珠江钢琴	41,300	184,611.00	0.12
276	300140	节能环境	30,800	184,492.00	0.12
277	601218	吉鑫科技	56,500	184,190.00	0.12
278	002214	大立科技	16,500	183,975.00	0.12
279	002299	圣农发展	12,700	183,896.00	0.12
280	002475	立讯精密	4,500	183,420.00	0.12
281	000021	深科技	9,600	182,976.00	0.11
282	600737	中粮糖业	17,900	182,759.00	0.11
283	300803	指南针	1,900	182,305.00	0.11
284	000032	深桑达A	10,300	181,692.00	0.11
285	600528	中铁工业	22,500	181,350.00	0.11
286	300979	华利集团	2,300	180,895.00	0.11
287	300136	信维通信	7,100	180,624.00	0.11
288	600521	华海药业	10,100	180,487.00	0.11
289	600977	中国电影	15,500	179,955.00	0.11
290	600369	西南证券	38,500	179,795.00	0.11
291	002653	海思科	5,400	179,550.00	0.11
292	688313	仕佳光子	10,942	179,339.38	0.11
293	002508	老板电器	8,300	177,869.00	0.11

294	002991	甘源食品	1,900	177,688.00	0.11
295	600392	盛和资源	17,200	176,816.00	0.11
296	300888	稳健医疗	4,200	176,736.00	0.11
297	002686	亿利达	32,800	175,808.00	0.11
298	002035	华帝股份	23,800	174,692.00	0.11
299	000001	平安银行	14,900	174,330.00	0.11
300	600765	中航重机	8,500	173,995.00	0.11
301	605499	东鹏饮料	700	173,964.00	0.11
302	603019	中科曙光	2,400	173,568.00	0.11
303	300088	长信科技	26,500	173,310.00	0.11
304	603233	大参林	11,500	173,190.00	0.11
305	300679	电连技术	2,900	173,130.00	0.11
306	300453	三鑫医疗	23,100	172,326.00	0.11
307	002683	广东宏大	6,500	172,120.00	0.11
308	600497	驰宏锌锗	30,900	172,113.00	0.11
309	600988	赤峰黄金	11,000	171,710.00	0.11
310	600155	华创云信	23,200	171,680.00	0.11
311	002436	兴森科技	15,400	171,094.00	0.11
312	603558	健盛集团	15,900	171,084.00	0.11
313	000998	隆平高科	15,300	170,901.00	0.11
314	000750	国海证券	39,900	170,772.00	0.11
315	301236	软通动力	2,900	170,259.00	0.11
316	000060	中金岭南	36,300	170,247.00	0.11
317	600704	物产中大	33,500	169,510.00	0.11
318	002185	华天科技	14,600	169,506.00	0.11
319	603166	福达股份	23,200	168,664.00	0.11
320	300357	我武生物	8,300	168,656.00	0.11
321	600064	南京高科	21,700	168,609.00	0.11
322	300283	温州宏丰	30,700	168,543.00	0.11
323	002373	千方科技	16,600	168,324.00	0.11
324	600416	湘电股份	14,900	168,221.00	0.11

325	000951	中国重汽	9,900	168,102.00	0.11
326	600248	陕建股份	37,500	168,000.00	0.11
327	600970	中材国际	17,700	167,796.00	0.11
328	603338	浙江鼎力	2,600	167,752.00	0.11
329	002522	浙江众成	42,900	167,739.00	0.11
330	000932	华菱钢铁	40,100	167,618.00	0.11
331	002008	大族激光	6,700	167,500.00	0.11
332	002533	金杯电工	17,000	167,280.00	0.11
333	603228	景旺电子	6,000	167,040.00	0.10
334	600316	洪都航空	5,200	167,024.00	0.10
335	000723	美锦能源	37,000	166,870.00	0.10
336	600906	财达证券	23,500	166,850.00	0.10
337	601616	广电电气	38,000	166,820.00	0.10
338	300659	中孚信息	10,300	166,757.00	0.10
339	002463	沪电股份	4,200	166,530.00	0.10
340	300360	炬华科技	9,900	166,023.00	0.10
341	600252	中恒集团	67,400	165,804.00	0.10
342	002250	联化科技	30,000	165,300.00	0.10
343	002984	森麒麟	6,700	165,222.00	0.10
344	000885	城发环境	12,600	165,186.00	0.10
345	002043	兔宝宝	13,900	165,132.00	0.10
346	300016	北陆药业	26,600	164,920.00	0.10
346	002263	大东南	66,500	164,920.00	0.10
347	600073	光明肉业	23,700	164,478.00	0.10
348	001332	锡装股份	4,700	164,124.00	0.10
349	601388	怡球资源	66,700	164,082.00	0.10
350	000999	华润三九	3,700	164,058.00	0.10
351	300414	中光防雷	20,600	163,976.00	0.10
352	688205	德科立	1,800	163,800.00	0.10
353	002100	天康生物	25,000	163,750.00	0.10
354	300861	美畅股份	8,200	163,590.00	0.10

355	688508	芯朋微	3,800	163,286.00	0.10
356	600618	氯碱化工	16,500	162,690.00	0.10
357	600861	北京人力	8,400	162,540.00	0.10
358	300827	上能电气	3,700	162,430.00	0.10
359	000672	上峰水泥	21,200	162,180.00	0.10
360	002852	道道全	19,600	161,896.00	0.10
361	000629	钒钛股份	56,200	161,856.00	0.10
362	300498	温氏股份	9,800	161,798.00	0.10
363	300017	网宿科技	15,300	161,721.00	0.10
364	300641	正丹股份	6,500	161,460.00	0.10
365	688553	汇宇制药	10,600	161,120.00	0.10
366	000977	浪潮信息	3,100	160,828.00	0.10
367	603369	今世缘	3,542	160,204.66	0.10
368	601799	星宇股份	1,200	160,176.00	0.10
369	300570	太辰光	2,200	159,940.00	0.10
370	301050	雷电微力	3,100	159,898.00	0.10
371	002032	苏泊尔	3,000	159,630.00	0.10
372	300685	艾德生物	7,000	159,600.00	0.10
373	603676	卫信康	16,000	159,200.00	0.10
374	002432	九安医疗	3,900	159,042.00	0.10
375	000921	海信家电	5,500	158,950.00	0.10
376	002912	中新赛克	6,200	158,658.00	0.10
377	600714	金瑞矿业	16,300	158,436.00	0.10
378	601083	锦江航运	16,600	158,032.00	0.10
379	003005	竞业达	5,800	157,296.00	0.10
380	601088	中国神华	3,600	156,528.00	0.10
381	601198	东兴证券	14,200	156,342.00	0.10
382	002850	科达利	1,600	156,288.00	0.10
383	301031	中熔电气	1,500	156,030.00	0.10
384	600660	福耀玻璃	2,500	156,000.00	0.10
385	002265	建设工业	6,700	155,909.00	0.10

386	600177	雅戈尔	17,500	155,750.00	0.10
387	603993	洛阳钼业	23,400	155,610.00	0.10
388	688209	英集芯	8,800	155,496.00	0.10
389	688789	宏华数科	2,340	155,329.20	0.10
390	600664	哈药股份	37,600	155,288.00	0.10
391	603158	腾龙股份	19,200	155,136.00	0.10
392	002294	信立泰	5,000	154,650.00	0.10
393	300034	钢研高纳	9,900	154,440.00	0.10
394	000738	航发控制	6,900	153,456.00	0.10
395	600350	山东高速	14,900	153,172.00	0.10
396	300760	迈瑞医疗	600	153,000.00	0.10
397	688312	燕麦科技	4,946	152,336.80	0.10
398	600500	中化国际	37,800	151,956.00	0.10
399	603288	海天味业	3,300	151,470.00	0.10
400	603305	旭升集团	11,500	151,225.00	0.09
401	000030	富奥股份	29,400	150,822.00	0.09
402	002585	双星新材	28,200	150,588.00	0.09
403	601113	华鼎股份	38,600	150,540.00	0.09
404	002540	亚太科技	24,400	150,304.00	0.09
405	603000	人民网	6,800	149,872.00	0.09
406	688041	海光信息	1,000	149,790.00	0.09
407	002738	中矿资源	4,200	149,100.00	0.09
408	688617	惠泰医疗	400	148,932.00	0.09
409	600491	龙元建设	39,700	148,478.00	0.09
410	001914	招商积余	14,000	147,980.00	0.09
411	001227	兰州银行	59,300	145,878.00	0.09
412	600266	城建发展	28,500	145,350.00	0.09
413	300389	艾比森	12,200	145,302.00	0.09
414	002624	完美世界	14,000	144,620.00	0.09
415	688131	皓元医药	4,040	144,228.00	0.09
416	603885	吉祥航空	10,400	142,480.00	0.09

417	601598	中国外运	26,600	142,310.00	0.09
418	002408	齐翔腾达	28,100	141,343.00	0.09
419	002281	光迅科技	2,700	140,859.00	0.09
420	600236	桂冠电力	20,600	140,080.00	0.09
421	601019	山东出版	12,300	139,605.00	0.09
422	600892	大晟文化	37,800	139,482.00	0.09
423	000988	华工科技	3,200	138,560.00	0.09
424	603109	神驰机电	7,800	138,450.00	0.09
425	300317	珈伟新能	37,700	138,359.00	0.09
426	600183	生益科技	5,700	137,085.00	0.09
427	300059	东方财富	5,300	136,846.00	0.09
428	002065	东华软件	18,800	136,488.00	0.09
429	000701	厦门信达	29,800	136,186.00	0.09
430	300525	博思软件	8,700	135,546.00	0.09
431	002831	裕同科技	5,000	135,500.00	0.09
432	002573	清新环境	34,000	135,320.00	0.09
433	600403	大有能源	46,000	135,240.00	0.08
434	600729	重庆百货	4,600	134,550.00	0.08
435	002788	鹭燕医药	16,314	133,937.94	0.08
436	300922	天秦装备	9,300	133,455.00	0.08
437	600535	天士力	9,200	133,032.00	0.08
438	600167	联美控股	23,200	132,936.00	0.08
439	300073	当升科技	3,300	132,924.00	0.08
440	601965	中国汽研	7,500	132,150.00	0.08
441	000893	亚钾国际	6,500	131,040.00	0.08
442	600690	海尔智家	4,600	130,962.00	0.08
443	300474	景嘉微	1,400	130,886.00	0.08
444	300230	永利股份	28,900	128,605.00	0.08
445	600320	振华重工	32,700	128,184.00	0.08
446	002099	海翔药业	24,800	127,968.00	0.08
447	603156	养元饮品	5,600	127,904.00	0.08

448	300708	聚灿光电	10,200	127,398.00	0.08
449	600691	阳煤化工	57,200	126,984.00	0.08
450	300251	光线传媒	13,400	126,496.00	0.08
451	600546	山煤国际	10,600	125,398.00	0.08
452	300910	瑞丰新材	2,600	123,734.00	0.08
453	300244	迪安诊断	10,900	123,715.00	0.08
454	002064	华峰化学	15,000	122,700.00	0.08
455	601801	皖新传媒	16,700	122,578.00	0.08
456	300114	中航电测	1,700	122,026.00	0.08
457	300074	华平股份	30,600	121,788.00	0.08
458	601225	陕西煤业	5,200	120,952.00	0.08
459	002352	顺丰控股	3,000	120,900.00	0.08
460	002300	太阳电缆	22,600	120,684.00	0.08
461	000728	国元证券	14,400	120,384.00	0.08
462	300150	世纪瑞尔	27,200	119,136.00	0.07
463	300065	海兰信	14,500	118,900.00	0.07
464	300009	安科生物	13,700	118,368.00	0.07
465	600481	双良节能	21,500	118,250.00	0.07
466	300485	赛升药业	16,800	117,768.00	0.07
467	002661	克明食品	11,700	117,702.00	0.07
468	601518	吉林高速	42,100	117,038.00	0.07
469	600967	内蒙一机	13,600	115,600.00	0.07
470	300033	同花顺	400	115,000.00	0.07
471	300211	亿通科技	12,900	114,810.00	0.07
472	603920	世运电路	3,900	114,660.00	0.07
473	000958	电投产融	18,300	114,009.00	0.07
474	600261	阳光照明	34,800	113,796.00	0.07
475	000066	中国长城	7,800	113,646.00	0.07
476	300697	电工合金	9,000	113,490.00	0.07
477	002390	信邦制药	24,800	112,840.00	0.07
478	000338	潍柴动力	8,200	112,340.00	0.07

479	300190	维尔利	32,000	112,320.00	0.07
480	600981	汇鸿集团	43,400	111,972.00	0.07
481	000895	双汇发展	4,300	111,628.00	0.07
482	002554	惠博普	44,400	111,444.00	0.07
483	688543	国科军工	2,200	110,264.00	0.07
484	002920	德赛西威	1,000	110,110.00	0.07
485	688050	爱博医疗	1,200	109,236.00	0.07
486	300752	隆利科技	6,400	108,800.00	0.07
487	603187	海容冷链	9,600	107,424.00	0.07
488	000400	许继电气	3,900	107,367.00	0.07
489	601216	君正集团	20,300	106,778.00	0.07
490	688311	盟升电子	3,188	105,554.68	0.07
491	002595	豪迈科技	2,100	105,399.00	0.07
492	603516	淳中科技	1,900	105,032.00	0.07
493	600398	海澜之家	14,000	105,000.00	0.07
494	002461	珠江啤酒	10,600	104,834.00	0.07
495	601311	骆驼股份	12,600	104,454.00	0.07
496	600575	淮河能源	26,300	104,411.00	0.07
497	600755	厦门国贸	15,700	104,248.00	0.07
498	300024	机器人	5,800	104,110.00	0.07
499	603730	岱美股份	11,500	103,385.00	0.06
500	600874	创业环保	17,300	103,281.00	0.06
501	688083	中望软件	1,200	102,684.00	0.06
502	000729	燕京啤酒	8,500	102,340.00	0.06
503	600585	海螺水泥	4,300	102,254.00	0.06
504	002865	钧达股份	2,000	102,200.00	0.06
505	603712	七一二	5,200	101,244.00	0.06
506	688033	天宜上佳	17,600	101,200.00	0.06
507	601677	明泰铝业	8,400	101,052.00	0.06
508	600862	中航高科	4,000	101,040.00	0.06
509	002106	莱宝高科	9,200	100,372.00	0.06

510	000519	中兵红箭	6,900	99,705.00	0.06
511	601939	建设银行	11,300	99,327.00	0.06
512	002060	广东建工	27,100	99,186.00	0.06
513	000061	农产品	14,100	98,841.00	0.06
514	000848	承德露露	11,000	98,670.00	0.06
515	601898	中煤能源	8,100	98,658.00	0.06
516	002252	上海莱士	13,600	98,192.00	0.06
517	601098	中南传媒	6,500	97,565.00	0.06
518	600372	中航机载	7,900	97,407.00	0.06
519	002372	伟星新材	7,700	97,251.00	0.06
520	000798	中水渔业	13,100	97,071.00	0.06
521	600651	飞乐音响	23,400	96,876.00	0.06
522	002230	科大讯飞	2,000	96,640.00	0.06
523	600103	青山纸业	37,700	96,512.00	0.06
524	300870	欧陆通	900	96,102.00	0.06
525	600848	上海临港	9,500	95,950.00	0.06
526	000997	新大陆	4,800	95,760.00	0.06
527	605018	长华集团	10,900	95,702.00	0.06
528	600352	浙江龙盛	9,300	95,697.00	0.06
529	603708	家家悦	8,400	95,676.00	0.06
530	300404	博济医药	10,900	95,157.00	0.06
531	000800	一汽解放	11,600	95,120.00	0.06
532	605066	天正电气	15,800	95,116.00	0.06
533	002608	江苏国信	12,400	95,108.00	0.06
534	600062	华润双鹤	4,800	95,040.00	0.06
534	000761	本钢板材	29,700	95,040.00	0.06
535	600662	外服控股	18,700	94,809.00	0.06
536	600191	华资实业	13,700	94,804.00	0.06
537	600637	东方明珠	12,200	94,672.00	0.06
538	002056	横店东磁	7,300	94,608.00	0.06
539	300001	特锐德	4,300	94,385.00	0.06

540	300513	恒实科技	10,300	94,039.00	0.06
541	300308	中际旭创	760	93,867.60	0.06
542	603317	天味食品	7,000	93,380.00	0.06
543	002439	启明星辰	5,900	93,338.00	0.06
544	600681	百川能源	26,600	93,100.00	0.06
545	000758	中色股份	18,800	92,872.00	0.06
546	300232	洲明科技	13,500	92,745.00	0.06
547	688172	燕东微	4,600	92,230.00	0.06
548	301321	翰博高新	6,400	92,160.00	0.06
549	300285	国瓷材料	5,400	92,016.00	0.06
550	002363	隆基机械	14,000	91,980.00	0.06
551	002863	今飞凯达	19,800	91,872.00	0.06
552	000636	风华高科	6,400	91,840.00	0.06
553	002228	合兴包装	30,500	91,500.00	0.06
554	603113	金能科技	16,200	91,206.00	0.06
555	002938	鹏鼎控股	2,500	91,200.00	0.06
556	300822	贝仕达克	4,400	90,860.00	0.06
557	601956	东贝集团	18,800	90,804.00	0.06
558	600750	江中药业	4,000	90,800.00	0.06
559	601615	明阳智能	7,200	90,792.00	0.06
560	002958	青农商行	29,800	90,592.00	0.06
561	601991	大唐发电	31,600	90,060.00	0.06
562	600237	铜峰电子	13,700	89,735.00	0.06
563	600169	太原重工	36,000	89,640.00	0.06
564	000751	锌业股份	31,700	89,077.00	0.06
565	603927	中科软	4,100	88,970.00	0.06
566	600537	亿晶光电	28,900	88,723.00	0.06
567	300259	新天科技	25,200	88,200.00	0.06
568	600032	浙江新能	11,900	88,060.00	0.06
569	601229	上海银行	9,600	87,840.00	0.06
570	002847	盐津铺子	1,400	87,640.00	0.06

571	002916	深南电路	700	87,500.00	0.05
572	600612	老凤祥	1,600	86,832.00	0.05
573	300737	科顺股份	17,100	86,697.00	0.05
574	600037	歌华有线	11,600	86,536.00	0.05
575	600129	太极集团	3,500	86,520.00	0.05
576	603766	隆鑫通用	9,500	86,450.00	0.05
577	000078	海王生物	33,900	86,445.00	0.05
578	000048	京基智农	4,800	86,400.00	0.05
579	002152	广电运通	7,400	86,284.00	0.05
580	688289	圣湘生物	3,800	86,260.00	0.05
581	002127	南极电商	19,600	86,240.00	0.05
582	000739	普洛药业	5,300	86,178.00	0.05
583	603529	爱玛科技	2,100	86,142.00	0.05
584	601702	华峰铝业	4,700	86,104.00	0.05
585	000709	河钢股份	38,900	85,969.00	0.05
586	600985	淮北矿业	6,100	85,827.00	0.05
587	600511	国药股份	2,500	85,550.00	0.05
588	600814	杭州解百	10,300	85,387.00	0.05
589	002768	国恩股份	3,700	85,359.00	0.05
590	600208	衢州发展	28,800	85,248.00	0.05
591	002507	涪陵榨菜	6,026	85,147.38	0.05
592	300003	乐普医疗	7,500	85,050.00	0.05
593	002342	巨力索具	26,300	84,949.00	0.05
594	600623	华谊集团	12,100	84,700.00	0.05
595	601998	中信银行	12,100	84,458.00	0.05
596	603297	永新光学	900	84,438.00	0.05
597	300212	易华录	3,600	84,240.00	0.05
598	605376	博迁新材	2,900	83,955.00	0.05
599	600872	中炬高新	3,800	83,676.00	0.05
600	002155	湖南黄金	5,300	83,369.00	0.05
601	002936	郑州银行	39,600	83,160.00	0.05

602	605296	神农集团	3,000	83,100.00	0.05
603	601016	节能风电	26,200	83,054.00	0.05
604	601636	旗滨集团	14,800	83,028.00	0.05
605	000960	锡业股份	5,900	82,777.00	0.05
606	600741	华域汽车	4,700	82,767.00	0.05
607	600449	宁夏建材	5,500	82,610.00	0.05
608	688409	富创精密	1,600	82,512.00	0.05
609	002860	星帅尔	8,400	82,404.00	0.05
610	603678	火炬电子	2,700	82,350.00	0.05
611	600126	杭钢股份	17,200	82,216.00	0.05
612	000892	欢瑞世纪	25,200	82,152.00	0.05
613	603456	九洲药业	6,000	82,080.00	0.05
614	688005	容百科技	2,600	82,030.00	0.05
615	002531	天顺风能	10,300	81,473.00	0.05
616	001203	大中矿业	9,400	81,404.00	0.05
617	601857	中国石油	9,100	81,354.00	0.05
618	301090	华润材料	11,700	81,198.00	0.05
619	600961	株冶集团	10,300	81,061.00	0.05
620	600648	外高桥	6,800	80,988.00	0.05
621	301004	嘉益股份	700	80,955.00	0.05
622	000898	鞍钢股份	33,700	80,880.00	0.05
623	688093	世华科技	4,000	80,760.00	0.05
624	300643	万通智控	6,700	80,132.00	0.05
625	601658	邮储银行	14,100	80,088.00	0.05
626	000975	山金国际	5,200	79,924.00	0.05
627	603890	春秋电子	6,800	79,900.00	0.05
628	002851	麦格米特	1,300	79,898.00	0.05
629	600346	恒力石化	5,200	79,820.00	0.05
630	300512	中亚股份	11,700	79,677.00	0.05
631	600377	宁沪高速	5,200	79,612.00	0.05
632	688388	嘉元科技	5,400	79,542.00	0.05

633	600057	厦门象屿	12,200	79,178.00	0.05
634	601918	新集能源	11,000	78,980.00	0.05
635	300855	图南股份	3,600	78,912.00	0.05
636	601339	百隆东方	14,500	78,880.00	0.05
637	000966	长源电力	16,600	78,850.00	0.05
638	002637	赞宇科技	8,000	78,800.00	0.05
639	000607	华媒控股	21,200	78,652.00	0.05
640	300638	广和通	3,900	78,585.00	0.05
641	000831	中国稀土	2,800	78,540.00	0.05
642	002946	新乳业	5,400	78,354.00	0.05
643	301498	乖宝宠物	1,000	78,320.00	0.05
644	688582	芯动联科	1,554	78,181.74	0.05
645	002483	润邦股份	15,000	78,150.00	0.05
646	600021	上海电力	8,500	77,945.00	0.05
647	000538	云南白药	1,300	77,935.00	0.05
648	688188	柏楚电子	400	77,700.00	0.05
649	002841	视源股份	2,100	77,511.00	0.05
650	600795	国电电力	16,900	77,402.00	0.05
651	000651	格力电器	1,700	77,265.00	0.05
652	603939	益丰药房	3,200	77,216.00	0.05
653	603083	剑桥科技	1,900	77,140.00	0.05
654	600746	江苏索普	11,000	77,110.00	0.05
655	600095	湘财股份	10,700	77,040.00	0.05
656	600202	哈空调	17,300	76,985.00	0.05
657	002326	永太科技	8,600	76,884.00	0.05
658	002478	常宝股份	14,500	76,705.00	0.05
659	000659	珠海中富	27,100	76,422.00	0.05
660	688685	迈信林	2,299	76,303.81	0.05
661	603538	美诺华	6,000	76,260.00	0.05
662	002707	众信旅游	10,300	76,117.00	0.05
663	688025	杰普特	1,600	76,000.00	0.05

664	600141	兴发集团	3,500	75,950.00	0.05
665	300568	星源材质	7,800	75,816.00	0.05
666	000786	北新建材	2,500	75,775.00	0.05
667	002174	游族网络	8,100	75,735.00	0.05
668	000422	湖北宜化	6,000	75,720.00	0.05
669	000301	东方盛虹	9,200	75,532.00	0.05
670	002301	齐心集团	10,600	75,366.00	0.05
671	001283	豪鹏科技	1,300	75,257.00	0.05
672	688002	睿创微纳	1,600	75,216.00	0.05
672	600699	均胜电子	4,800	75,216.00	0.05
673	600295	鄂尔多斯	7,700	75,152.00	0.05
674	300239	东宝生物	12,000	75,120.00	0.05
675	600509	天富能源	11,600	75,052.00	0.05
676	301239	普瑞眼科	1,600	75,040.00	0.05
677	000560	我爱我家	24,500	74,725.00	0.05
678	300771	智莱科技	7,100	74,692.00	0.05
679	600036	招商银行	1,900	74,670.00	0.05
680	603598	引力传媒	4,400	74,316.00	0.05
681	002459	晶澳科技	5,400	74,250.00	0.05
682	000897	津滨发展	31,300	74,181.00	0.05
683	002690	美亚光电	5,000	74,100.00	0.05
684	002238	天威视讯	9,200	73,876.00	0.05
685	300515	三德科技	6,200	73,842.00	0.05
686	605003	众望布艺	3,900	73,710.00	0.05
687	600015	华夏银行	9,200	73,692.00	0.05
688	000736	中交地产	8,500	73,100.00	0.05
689	002666	德联集团	16,700	72,812.00	0.05
690	002617	露笑科技	9,500	72,675.00	0.05
691	300058	蓝色光标	7,800	72,384.00	0.05
692	600487	亨通光电	4,200	72,324.00	0.05
693	300919	中伟股份	2,000	72,240.00	0.05

694	601226	华电科工	10,600	71,656.00	0.05
695	300395	菲利华	1,900	71,459.00	0.04
696	000930	中粮科技	12,700	70,485.00	0.04
697	300369	绿盟科技	9,800	70,462.00	0.04
698	000858	五粮液	500	70,020.00	0.04
699	600566	济川药业	2,400	69,792.00	0.04
700	603230	内蒙新华	5,500	69,630.00	0.04
701	688777	中控技术	1,400	69,538.00	0.04
702	002429	兆驰股份	12,000	69,360.00	0.04
703	300408	三环集团	1,800	69,318.00	0.04
704	300790	宇瞳光学	3,600	68,724.00	0.04
705	002662	京威股份	17,600	68,112.00	0.04
706	688029	南微医学	1,000	67,590.00	0.04
707	002679	福建金森	8,300	67,396.00	0.04
708	600885	宏发股份	2,100	66,822.00	0.04
709	600935	华塑股份	26,500	66,780.00	0.04
710	600493	凤竹纺织	12,800	66,176.00	0.04
711	600031	三一重工	4,000	65,920.00	0.04
712	688016	心脉医疗	600	65,910.00	0.04
713	301025	读客文化	6,900	65,757.00	0.04
714	002579	中京电子	8,300	65,570.00	0.04
715	002078	太阳纸业	4,400	65,428.00	0.04
716	002714	牧原股份	1,700	65,348.00	0.04
717	688120	华海清科	400	65,196.00	0.04
718	600483	福能股份	6,500	64,805.00	0.04
719	603195	公牛集团	920	64,620.80	0.04
720	600758	辽宁能源	18,700	64,328.00	0.04
721	600285	羚锐制药	2,900	64,264.00	0.04
722	002391	长青股份	12,800	64,128.00	0.04
723	688598	金博股份	3,025	63,706.50	0.04
724	002966	苏州银行	7,800	63,258.00	0.04

725	605319	无锡振华	3,000	63,150.00	0.04
726	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.04
727	300748	金力永磁	3,500	62,580.00	0.04
728	300999	金龙鱼	1,900	61,959.00	0.04
729	605299	舒华体育	7,800	61,542.00	0.04
730	603379	三美股份	1,600	61,408.00	0.04
731	688223	晶科能源	8,600	61,146.00	0.04
732	002577	雷柏科技	3,200	60,576.00	0.04
733	000426	兴业银锡	5,400	60,048.00	0.04
734	001289	龙源电力	3,800	59,698.00	0.04
735	600170	上海建工	22,000	58,300.00	0.04
736	603612	索通发展	4,300	58,093.00	0.04
737	300079	数码视讯	10,600	57,346.00	0.04
738	688301	奕瑞科技	600	57,342.00	0.04
739	300832	新产业	800	56,680.00	0.04
740	000090	天健集团	13,700	56,307.00	0.04
741	002218	拓日新能	14,000	55,580.00	0.03
742	301123	奕东电子	2,700	55,215.00	0.03
743	601577	长沙银行	6,200	55,118.00	0.03
744	688658	悦康药业	3,783	54,513.03	0.03
745	000541	佛山照明	8,700	53,940.00	0.03
746	300053	航宇微	4,100	53,669.00	0.03
747	301389	隆扬电子	3,200	53,504.00	0.03
748	603599	广信股份	4,400	53,020.00	0.03
749	603989	艾华集团	3,500	52,780.00	0.03
750	601326	秦港股份	15,700	52,595.00	0.03
751	002552	宝鼎科技	4,000	52,480.00	0.03
752	603816	顾家家居	1,900	52,402.00	0.03
753	000596	古井贡酒	300	51,990.00	0.03
754	601298	青岛港	5,700	51,927.00	0.03
755	002635	安洁科技	3,200	50,944.00	0.03

756	301028	东亚机械	4,700	50,713.00	0.03
757	000957	中通客车	4,600	50,600.00	0.03
758	605188	国光连锁	6,600	50,424.00	0.03
759	600023	浙能电力	8,900	50,374.00	0.03
760	000603	盛达资源	4,200	50,358.00	0.03
761	601101	昊华能源	6,100	50,203.00	0.03
762	605398	新炬网络	2,300	49,956.00	0.03
763	600999	招商证券	2,600	49,816.00	0.03
764	300193	佳士科技	5,600	49,784.00	0.03
765	300787	海能实业	3,700	49,654.00	0.03
766	300533	冰川网络	2,500	49,400.00	0.03
767	000551	创元科技	4,100	49,036.00	0.03
768	601077	渝农商行	8,100	49,005.00	0.03
769	300145	中金环境	13,200	48,972.00	0.03
770	601015	陕西黑猫	14,600	48,764.00	0.03
771	603055	台华新材	4,400	48,752.00	0.03
772	000931	中关村	10,200	48,552.00	0.03
773	601928	凤凰传媒	4,200	48,468.00	0.03
774	000153	丰原药业	7,900	48,427.00	0.03
775	002284	亚太股份	6,200	47,988.00	0.03
776	601985	中国核电	4,600	47,978.00	0.03
777	002430	杭氧股份	2,200	47,960.00	0.03
778	601187	厦门银行	8,500	47,940.00	0.03
779	300048	合康新能	9,500	47,880.00	0.03
780	000561	烽火电子	5,400	47,736.00	0.03
781	688586	江航装备	4,984	47,696.88	0.03
782	600362	江西铜业	2,300	47,472.00	0.03
783	002223	鱼跃医疗	1,300	47,437.00	0.03
784	002634	棒杰股份	12,600	47,376.00	0.03
785	600315	上海家化	2,800	47,348.00	0.03
786	301332	德尔玛	4,700	47,094.00	0.03

787	688571	杭华股份	7,000	46,970.00	0.03
788	603321	梅轮电梯	6,700	46,900.00	0.03
789	000677	恒天海龙	11,400	46,740.00	0.03
790	600061	国投资本	6,200	46,624.00	0.03
791	002378	章源钨业	7,200	46,584.00	0.03
792	000565	渝三峡 A	8,600	46,526.00	0.03
793	600329	达仁堂	1,500	46,200.00	0.03
794	601567	三星医疗	1,500	46,140.00	0.03
795	600792	云煤能源	12,300	46,002.00	0.03
796	600997	开滦股份	6,800	45,968.00	0.03
797	601008	连云港	12,000	45,960.00	0.03
798	002446	盛路通信	7,000	45,850.00	0.03
799	300305	裕兴股份	8,400	45,780.00	0.03
800	600433	冠豪高新	14,400	45,648.00	0.03
801	002376	新北洋	7,000	45,640.00	0.03
802	301218	华是科技	2,100	45,633.00	0.03
803	300903	科翔股份	5,700	45,543.00	0.03
804	605599	菜百股份	4,000	45,400.00	0.03
805	002343	慈文传媒	7,300	45,260.00	0.03
806	002293	罗莱生活	5,800	45,240.00	0.03
807	002476	宝莫股份	10,700	45,154.00	0.03
808	600180	瑞茂通	10,500	45,150.00	0.03
809	600798	宁波海运	14,900	45,147.00	0.03
810	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.03
811	301056	森赫股份	5,500	44,990.00	0.03
812	000963	华东医药	1,300	44,980.00	0.03
813	002034	旺能环境	2,900	44,950.00	0.03
814	600525	长园集团	9,200	44,896.00	0.03
815	300021	大禹节水	11,000	44,770.00	0.03
816	688432	有研硅	3,960	44,748.00	0.03
817	605388	均瑶健康	7,100	44,659.00	0.03

818	601188	龙江交通	12,400	44,640.00	0.03
819	605358	立昂微	1,800	44,586.00	0.03
820	002233	塔牌集团	5,800	44,486.00	0.03
821	002412	汉森制药	7,400	44,474.00	0.03
822	603056	德邦股份	3,100	44,423.00	0.03
823	600478	科力远	10,700	44,191.00	0.03
824	002548	金新农	11,100	44,067.00	0.03
825	300070	碧水源	8,700	44,022.00	0.03
826	688169	石头科技	200	43,858.00	0.03
827	002445	中南文化	17,900	43,855.00	0.03
828	000782	恒申新材	9,600	43,776.00	0.03
829	002758	浙农股份	5,000	43,750.00	0.03
830	600617	国新能源	16,200	43,740.00	0.03
831	603658	安图生物	1,000	43,640.00	0.03
832	601099	太平洋	10,200	43,452.00	0.03
833	002519	银河电子	7,300	43,362.00	0.03
834	300424	航新科技	2,400	43,344.00	0.03
835	603987	康德莱	6,000	43,080.00	0.03
836	000883	湖北能源	8,600	42,828.00	0.03
837	000517	荣安地产	19,200	42,816.00	0.03
838	300857	协创数据	400	42,756.00	0.03
839	600006	东风股份	5,800	42,746.00	0.03
840	603528	多伦科技	5,400	42,552.00	0.03
841	002206	海利得	9,900	42,471.00	0.03
842	600067	冠城新材	16,000	42,400.00	0.03
843	300493	润欣科技	1,500	42,195.00	0.03
844	600939	重庆建工	14,000	42,140.00	0.03
845	600815	厦工股份	15,900	42,135.00	0.03
846	002329	皇氏集团	11,600	42,108.00	0.03
847	600269	赣粤高速	7,500	42,075.00	0.03
848	603501	韦尔股份	400	41,764.00	0.03

849	002319	乐通股份	3,900	41,457.00	0.03
850	600875	东方电气	2,600	41,314.00	0.03
851	300434	金石亚药	5,000	41,250.00	0.03
852	688378	奥来德	1,800	41,058.00	0.03
853	600386	北巴传媒	9,100	40,677.00	0.03
854	688187	时代电气	841	40,300.72	0.03
855	688095	福昕软件	600	40,296.00	0.03
856	002599	盛通股份	5,400	40,122.00	0.03
857	002734	利民股份	5,000	39,850.00	0.03
858	000410	沈阳机床	5,600	39,816.00	0.03
859	300410	正业科技	7,400	39,812.00	0.03
860	000680	山推股份	4,100	39,770.00	0.02
861	603337	杰克股份	1,300	39,598.00	0.02
862	600694	大商股份	1,500	39,555.00	0.02
863	600621	华鑫股份	2,400	39,552.00	0.02
864	002468	申通快递	3,900	39,507.00	0.02
865	002755	奥赛康	3,100	39,401.00	0.02
866	002911	佛燃能源	3,100	39,184.00	0.02
867	301035	润丰股份	800	38,976.00	0.02
868	600161	天坛生物	1,900	38,950.00	0.02
869	002747	埃斯顿	2,100	38,850.00	0.02
870	688336	三生国健	1,800	38,556.00	0.02
871	603855	华荣股份	1,900	38,551.00	0.02
872	600312	平高电气	2,000	38,400.00	0.02
873	000875	吉电股份	7,300	38,398.00	0.02
874	605007	五洲特纸	3,000	38,370.00	0.02
875	600990	四创电子	1,800	38,304.00	0.02
876	002074	国轩高科	1,800	38,196.00	0.02
877	600076	康欣新材	18,300	38,064.00	0.02
877	000425	徐工机械	4,800	38,064.00	0.02
878	605338	巴比食品	2,200	37,994.00	0.02

879	301301	川宁生物	3,200	37,952.00	0.02
880	000969	安泰科技	3,400	37,910.00	0.02
881	002967	广电计量	2,300	37,720.00	0.02
882	601686	友发集团	6,900	37,674.00	0.02
883	600552	凯盛科技	3,300	37,653.00	0.02
884	000690	宝新能源	8,400	37,632.00	0.02
885	600027	华电国际	6,700	37,587.00	0.02
886	603301	振德医疗	1,700	37,383.00	0.02
887	688281	华秦科技	400	37,240.00	0.02
888	301039	中集车辆	4,100	37,105.00	0.02
889	600698	湖南天雁	8,200	37,064.00	0.02
890	300634	彩讯股份	1,700	37,060.00	0.02
891	003000	劲仔食品	2,700	36,990.00	0.02
892	002906	华阳集团	1,200	36,900.00	0.02
893	300783	三只松鼠	1,000	36,870.00	0.02
894	601633	长城汽车	1,400	36,862.00	0.02
895	600557	康缘药业	2,700	36,774.00	0.02
896	000887	中鼎股份	2,800	36,736.00	0.02
897	600276	恒瑞医药	800	36,720.00	0.02
898	600255	鑫科材料	10,700	36,594.00	0.02
899	300226	上海钢联	1,600	36,592.00	0.02
900	300252	金信诺	3,400	36,584.00	0.02
901	688132	邦彦技术	2,150	36,507.00	0.02
902	301376	致欧科技	1,900	36,328.00	0.02
903	300378	鼎捷数智	1,400	36,218.00	0.02
904	000938	紫光股份	1,300	36,179.00	0.02
905	688513	苑东生物	1,200	36,156.00	0.02
906	605337	李子园	3,200	36,128.00	0.02
907	601869	长飞光纤	1,200	35,868.00	0.02
907	300062	中能电气	6,100	35,868.00	0.02
908	300482	万孚生物	1,600	35,856.00	0.02

909	603713	密尔克卫	700	35,840.00	0.02
910	300662	科锐国际	1,700	35,802.00	0.02
911	600595	中孚实业	12,600	35,658.00	0.02
912	603087	甘李药业	800	35,280.00	0.02
913	300973	立高食品	900	35,127.00	0.02
914	000034	神州数码	1,000	35,050.00	0.02
915	603221	爱丽家居	3,800	34,694.00	0.02
916	603838	四通股份	6,200	34,658.00	0.02
917	688687	凯因科技	1,600	34,528.00	0.02
918	688351	微电生理	1,800	34,272.00	0.02
919	603236	移远通信	500	34,220.00	0.02
920	002829	星网宇达	1,800	34,128.00	0.02
921	603737	三棵树	800	34,080.00	0.02
922	002400	省广集团	4,200	33,558.00	0.02
923	600558	大西洋	8,200	33,374.00	0.02
924	300348	长亮科技	2,300	32,890.00	0.02
925	600229	城市传媒	4,700	32,759.00	0.02
926	605123	派克新材	600	32,256.00	0.02
927	603986	兆易创新	300	32,040.00	0.02
928	688117	圣诺生物	1,238	31,779.46	0.02
929	600863	内蒙华电	7,300	31,609.00	0.02
930	688521	芯原股份	600	31,458.00	0.02
931	002948	青岛银行	8,000	31,040.00	0.02
932	603499	翔港科技	1,200	31,020.00	0.02
933	002876	三利谱	1,200	30,792.00	0.02
934	688362	甬矽电子	895	30,143.60	0.02
935	002645	华宏科技	4,400	30,008.00	0.02
936	688726	拉普拉斯	904	29,886.24	0.02
937	601236	红塔证券	3,400	28,866.00	0.02
938	601163	三角轮胎	1,900	28,633.00	0.02
939	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.02

940	002497	雅化集团	2,400	28,080.00	0.02
941	002195	岩山科技	6,900	27,393.00	0.02
942	600995	南网储能	2,700	27,324.00	0.02
943	605138	盛泰集团	4,900	27,048.00	0.02
944	688615	合合信息	161	26,690.58	0.02
945	002004	华邦健康	5,900	26,668.00	0.02
946	601368	绿城水务	5,600	26,656.00	0.02
947	688047	龙芯中科	200	26,456.00	0.02
948	002105	信隆健康	5,300	26,447.00	0.02
949	002407	多氟多	2,200	26,400.00	0.02
950	002456	欧菲光	2,200	26,356.00	0.02
951	301291	明阳电气	600	26,352.00	0.02
952	300383	光环新网	1,800	26,262.00	0.02
953	688332	中科蓝讯	200	26,100.00	0.02
954	600330	天通股份	3,600	25,560.00	0.02
955	688579	山大地纬	2,600	23,894.00	0.02
956	600938	中国海油	800	23,608.00	0.01
957	601599	浙文影业	6,500	23,270.00	0.01
958	603551	奥普科技	2,100	22,428.00	0.01
959	600200	江苏吴中	2,400	22,368.00	0.01
960	002237	恒邦股份	2,200	22,220.00	0.01
961	300274	阳光电源	300	22,149.00	0.01
962	688017	绿的谐波	200	21,612.00	0.01
963	002905	金逸影视	2,600	20,488.00	0.01
964	301522	上大股份	816	20,269.44	0.01
965	002813	路畅科技	900	20,097.00	0.01
966	603072	天和磁材	1,533	18,855.90	0.01
967	002120	韵达股份	2,500	18,800.00	0.01
968	601068	中铝国际	4,200	18,522.00	0.01
969	688536	思瑞浦	200	18,500.00	0.01
970	601698	中国卫通	900	18,360.00	0.01

971	002451	摩恩电气	2,900	18,212.00	0.01
972	001208	华菱线缆	2,000	18,160.00	0.01
973	600495	晋西车轴	4,700	17,860.00	0.01
974	600642	申能股份	1,800	17,082.00	0.01
975	600468	百利电气	3,600	16,920.00	0.01
976	002567	唐人神	3,200	16,320.00	0.01
977	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.01
978	301556	托普云农	267	15,766.35	0.01
979	000631	顺发恒业	5,200	15,288.00	0.01
980	600760	中航沈飞	300	15,216.00	0.01
981	603101	汇嘉时代	1,600	14,928.00	0.01
982	300762	上海瀚讯	700	14,721.00	0.01
983	600841	动力新科	2,900	14,703.00	0.01
984	002198	嘉应制药	2,000	14,640.00	0.01
985	002236	大华股份	900	14,400.00	0.01
986	301571	国科天成	350	14,290.50	0.01
987	301606	绿联科技	357	13,026.93	0.01
988	000042	中洲控股	2,800	12,516.00	0.01
989	603998	方盛制药	1,200	12,504.00	0.01
990	000063	中兴通讯	300	12,120.00	0.01
991	301608	博实结	178	11,637.64	0.01
992	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.01
993	688710	益诺思	332	11,148.56	0.01
994	301613	新铝时代	266	11,110.82	0.01
995	603728	鸣志电器	200	10,800.00	0.01
996	000031	大悦城	3,400	10,336.00	0.01
997	001696	宗申动力	400	9,960.00	0.01
998	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.01
999	001391	国货航	1,406	9,560.80	0.01
1000	301607	富特科技	257	9,287.98	0.01

100 1	301552	科力装备	143	8,132.41	0.01
100 2	301578	辰奕智能	154	7,522.90	0.00
100 3	301585	蓝宇股份	207	7,420.95	0.00
100 4	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
100 5	688196	卓越新能	200	6,718.00	0.00
100 6	301539	宏鑫科技	361	6,682.11	0.00
100 7	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
100 8	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
100 9	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
101 0	603004	鼎龙科技	195	4,018.95	0.00
101 1	603194	中力股份	141	3,966.33	0.00
101 2	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
101 3	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
101 4	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
101 5	603310	巍华新材	148	2,656.60	0.00
101 6	400237	天通5	118,400	-	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	000725	京东方 A	6,585,145.00	1.59
2	600887	伊利股份	6,140,386.65	1.48
3	601319	中国人保	5,904,448.00	1.42
4	603993	洛阳钼业	5,519,080.00	1.33
5	300274	阳光电源	5,471,567.00	1.32
6	000933	神火股份	5,422,951.77	1.31
7	688111	金山办公	5,255,052.27	1.27
8	000651	格力电器	5,250,248.00	1.27
9	002128	电投能源	5,202,854.00	1.25
10	600050	中国联通	5,147,122.00	1.24
11	603501	韦尔股份	4,947,635.00	1.19
12	600919	江苏银行	4,840,834.00	1.17
13	601168	西部矿业	4,804,287.00	1.16
14	300502	新易盛	4,772,132.00	1.15
15	300896	爱美客	4,689,114.00	1.13
16	000100	TCL科技	4,625,909.00	1.11
17	300308	中际旭创	4,504,476.00	1.09
18	002996	顺博合金	4,251,455.90	1.02
19	603392	万泰生物	4,138,800.00	1.00
20	603986	兆易创新	4,134,452.00	1.00

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	300308	中际旭创	7,743,963.00	1.87
2	300502	新易盛	7,342,596.00	1.77

3	000725	京东方 A	7,232,032.00	1.74
4	002371	北方华创	6,506,829.00	1.57
5	600828	茂业商业	6,466,975.00	1.56
6	002594	比亚迪	6,451,691.00	1.55
7	601319	中国人保	6,220,444.00	1.50
8	300750	宁德时代	6,155,264.00	1.48
9	603993	洛阳钼业	6,054,857.00	1.46
10	300394	天孚通信	5,992,541.00	1.44
11	300274	阳光电源	5,944,157.88	1.43
12	600887	伊利股份	5,830,410.00	1.40
13	601899	紫金矿业	5,824,321.00	1.40
14	000933	神火股份	5,810,600.00	1.40
15	603501	韦尔股份	5,747,043.68	1.38
16	600900	长江电力	5,636,236.00	1.36
17	000651	格力电器	5,493,863.00	1.32
18	600519	贵州茅台	5,493,196.00	1.32
19	300760	迈瑞医疗	5,487,461.00	1.32
20	300512	中亚股份	5,451,082.00	1.31

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	2,255,431,374.21
卖出股票收入（成交）总额	2,490,756,811.53

注：本项中8.4.1、8.4.2、8.4.3表中的"买入金额"（或"买入股票成本"）、"卖出金额"（或"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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,239,090.41	6.43
	其中：政策性金融债	10,239,090.41	6.43
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	15,000.46	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,254,090.87	6.44

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	220403	22农发03	100,000	10,239,090.41	6.43
2	110098	南药转债	150	15,000.46	0.01

注：本基金本报告期末仅持有两只债券。

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

无。

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

无。

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

无。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内本基金投资的前十名证券除中信证券（证券代码：600030）外，其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2024年12月20日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因经纪业务管理存在不足、场外衍生品业务管理存在不足被中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函。

2024年08月23日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的公司选取的上市标准含净利润标准但上市当年即亏损被北京证券交易所采取出具警示函并记入证券期货市场诚信档案。

2024年08月05日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的公司选取的上市标准含净利润标准但上市当年即亏损被中国证券监督管理委员会贵州监管局出具警示函的措施并记入证券期货市场诚信档案。

2024年05月08日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因在持续督导履职过程中对关联关系核查不充分、对真实性核查不充分、对业务单据审核中未关注到运输合同与船舱计量报告对应的船运公司存在明显差异等被广东证监局出具警示函。

2024年04月30日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因未对发行人关联交易情况进行充分核查、发表的核查意见不准确被深圳证券交易所采取书面警示的自律监管措施。

2024年04月30日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因配合客户以定增套利为目的提供融券服务被中国证券监督管理委员会合计没收违法所得1,910,680.83元并处以23,250,000元罚款。

2024年04月12日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因相关主体违反限制性规定转让中核钛白2023年非公开发行股票过程中涉嫌违法违规被中国证券监督管理委员会立案。

2024年01月05日，中信证券（证券代码：600030）发行人中信证券股份有限公司因保荐的可转债项目发行人证券发行上市当年即亏损、营业利润比上年下滑50%以上被中国证券监督管理委员会采取出具警示函的行政监督管理措施。

在上述公告公布后，本基金管理人对上述公司进行了进一步了解和他分析，认为上述处罚不会对投资价值构成实质性负面影响，因此本基金管理人对上述公司的投资判断未

发生改变。本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合本基金管理人投资管理制度的规定。

8.12.2 基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	68,150.74
2	应收清算款	1,159,716.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	41,452.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,269,319.58

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能存在尾差。

§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

持有人户	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

数(户)		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
13,048	8,380.17	83,785,996.85	76.63%	25,558,445.61	23.37%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,402,936.54	1.28%

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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年06月01日)基金份额总额	847,544,853.76
本报告期期初基金份额总额	304,635,503.75
本报告期基金总申购份额	182,315,249.00
减：本报告期基金总赎回份额	377,606,310.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	109,344,442.46

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

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) 基金管理人的重大人事变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(2) 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内改聘容诚会计师事务所（特殊普通合伙），报告期内本基金应支付给会计师事务所的报酬为48,000.00元，目前事务所已为本基金提供审计服务的连续年限为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

本报告期未发生公司及其高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所施以重大处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
华金证券	2	4,223,692,110.80	89.05%	785,189.25	89.05%	-
东莞证券	1	318,938,475.75	6.72%	59,293.97	6.72%	-
恒泰	2	200,517,815.63	4.23%	37,279.55	4.23%	-

证券						
渤海 证券	1	-	-	-	-	-
长江 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	1	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-
长城 证券	2	-	-	-	-	-
第一 创业 证券	2	-	-	-	-	-
东北 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国金 证券	2	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国信 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
华西 证券	2	-	-	-	-	-

开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
甬兴证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- （1）该证券机构经营行为规范，内控制度健全；
- （2）财务状况良好，公司经营状况稳定；
- （3）具有基金投资运作所需的证券服务能力和水平。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- （1）本基金管理人根据上述标准考察后选定证券经营机构；
- （2）基金管理人和被选中的证券经营机构签订协议。

3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

(1) 本基金报告期内新增租用交易单元：甬兴证券、东莞证券、恒泰证券。

(2) 本基金报告期内停止租用交易单元：中泰证券、太平洋证券、华安证券、国投证券、首创证券、信达证券、中信建投证券、招商证券。

4、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《泓德基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年度）》的报告期为2024年7月1日至2024年12月31日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华金证券	1,266,407.88	97.22%	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	36,233.75	2.78%	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
甬兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	泓德基金管理有限公司关于泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金增加广发证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-10
2	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海大智慧基金销售有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-01-11
3	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-05-29
4	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金所持股票估值方法调整的提示性公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-22
5	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加方正证券股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-06-25
6	泓德基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-06

7	泓德基金管理有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-08-30
8	泓德基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-11-07
9	泓德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	公司官网、上海证券报、中国证监会基金电子披露网站	2024-12-31

§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

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	2024/05/16,2024/06/24-2024/09/29	30,809,733.01	26,120,961.55	50,406,325.80	6,524,368.76	5.97%
	2	2024/11/05-2024/12/31	29,790,564.55	-	3,900,000.00	25,890,564.55	23.68%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

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、中国证监会批准泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金设立的文件；

- 2、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《泓德泓信灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

地点为管理人地址：北京市西城区德胜门外大街125号

13.3 查阅方式

- 1、投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- 2、投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泓德基金管理有限公司，客户服务电话：4009-100-888
- 3、投资者可访问本基金管理人公司网站，网址：www.hongdefund.com

泓德基金管理有限公司
二〇二五年三月二十八日