

华商量化进取灵活配置混合型
证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：华商基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1. 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，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 08 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 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 | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金经理及基金经理情况 | 7 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 8 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 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 | 9 |
| 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 | 10 |
| 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遵规守信情况声明 | 11 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 13 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 36 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 55 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 56 |
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |

| | |
|---|-----------|
| 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 | 56 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 56 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 57 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 57 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 58 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 58 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 59 |
| 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 | 59 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 59 |
| § 10 重大事件揭示 | 59 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 59 |
| 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 | 59 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 60 |
| 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 | 60 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 60 |
| 10.8 其他重大事件 | 62 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| 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 | 63 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| § 12 备查文件目录 | 63 |
| 12.1 备查文件目录 | 63 |
| 12.2 存放地点 | 63 |
| 12.3 查阅方式 | 63 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|---------------------|
| 基金名称 | 华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 华商量化进取混合 |
| 基金主代码 | 001143 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 4 月 9 日 |
| 基金管理人 | 华商基金管理有限公司 |
| 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 | 342,973,808.97 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要以数量化投资技术为基础，并辅以基本面研究，严格控制下行风险，实现基金资产的持续稳健增长。 |
| 投资策略 | 本基金管理人采用自主开发的量化系统风险判定模型对中短期市场的系统性风险进行判断，从而决定本基金在股票、债券和现金等金融工具上的投资比例，并充分利用股指期货作为对冲工具；在股票选择方面，本基金采用量化择股系统和基本面研究相结合的方式进行股票选择和投资，多维度地分析股票的投资价值，精选具有较高投资价值的上市公司构建本基金的多头组合。 具体投资策略详见基金合同。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率 × 60% + 上证国债指数收益率 × 40% |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高风险和中高预期收益产品。 |

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 | 华商基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 高敏 |
| | 联系电话 | 010-58573600 |
| | 电子邮箱 | gaom@hsfund.com |
| 客户服务电话 | 4007008880 | 95588 |
| 传真 | 010-58573520 | 010-66105798 |
| 注册地址 | 北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | 北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | 100035 | 100140 |
| 法定代表人 | 苏金奎 | 廖林 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hsfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的办公场所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|----------------------------|
| 注册登记机构 | 华商基金管理有限公司 | 北京市西城区平安里西大街 28 号楼 19 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期内(2025年1月1日-2025年6月30日) |
| 本期已实现收益 | 13,082,874.59 |
| 本期利润 | 38,619,352.05 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1104 |
| 本期加权平均净值利润率 | 11.55% |
| 本期基金份额净值增长率 | 12.00% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 5,848,737.78 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0171 |
| 期末基金资产净值 | 348,822,546.75 |
| 期末基金份额净值 | 1.017 |
| 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 | 1.70% |

注：1. 上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。

3. 对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分余额的孰低数。

3.2 基金净值表现

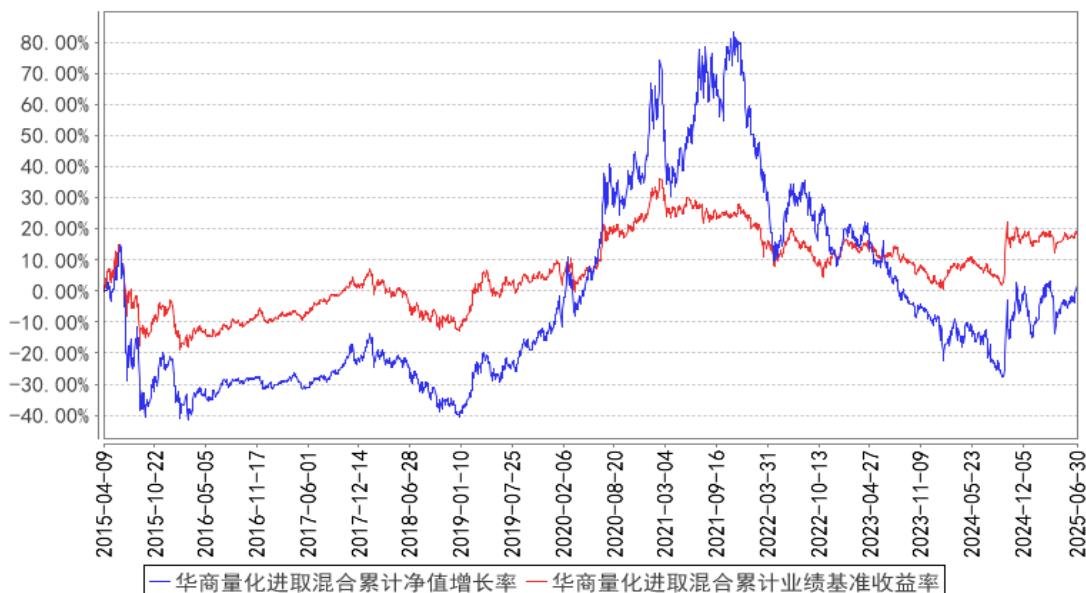
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|--------|-------|---------|-------|
| 过去一个月 | 6.27% | 0.87% | 1.70% | 0.34% | 4.57% | 0.53% |
| 过去三个月 | 4.20% | 1.78% | 1.34% | 0.64% | 2.86% | 1.14% |
| 过去六个月 | 12.00% | 1.59% | 0.71% | 0.60% | 11.29% | 0.99% |
| 过去一年 | 19.23% | 2.01% | 10.93% | 0.82% | 8.30% | 1.19% |
| 过去三年 | -22.60% | 1.53% | -1.00% | 0.66% | -21.60% | 0.87% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.70% | 1.65% | 18.84% | 0.82% | -17.14% | 0.83% |

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

华商量化进取混合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本基金合同生效日为 2015 年 4 月 9 日。

②根据基金合同的规定，自基金合同生效之日起 6 个月内基金各项资产配置比例需符合基金合同要求。本基金在建仓期结束时，各项资产配置比例符合基金合同有关投资比例的约定。

§ 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

华商基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]160号文批准设立，成立于2005年12月20日，注册资本为10000万元人民币，注册地为北京市，经营范围为基金募集，基金销售，资产管理和中国证监会许可的其他业务。

华商基金管理有限公司在主动权益、固定收益、量化投资、FOF 投资等领域全面布局，为投资者提供专业的资产管理服务。

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 | | |
| 邓默 | 基金 经理，公司 量化投资 总监，量 化投资部 总经理， 公司投 资决策委 员会委员， 公司公募 业务权益 投资决策 委员会委员 | 2015 年 9 月 9 日 | - | 14.1 年 | 男，中国籍，数学博士，具有基金从业资格。2011 年 6 月加入华商基金管理有限公司，曾任公司量化投资部总经理助理、产品创新部副总经理；2015 年 9 月 9 日至 2017 年 4 月 26 日担任华商大盘量化精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 9 月 9 日起至今担任华商新量化灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2015 年 9 月 9 日起至今担任华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2018 年 2 月 23 日起至今担任华商动态阿尔法灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 3 月 8 日起至今担任华商红利优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2019 年 9 月 17 日至 2020 年 12 月 15 日担任华商电子行业量化股票型发起式证券投资基金的基金经理；2019 年 10 月 30 日至 2020 年 12 月 15 日担任华商计算机行业量化股票型发起式证券投资基金的基金经理；2020 年 10 月 28 日至 2024 年 1 月 23 日担任华商量化优质精选混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 3 月 8 日起至今担任华商品质慧选混合型证券投资基金的基金经理；2024 年 11 月 1 日起至今担任华商中证 A500 指数增强型证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月 17 日起至今担任华商中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。 |

注：①“任职日期”和“离职日期”分别指根据公司对外披露的聘任日期和解聘日期。

②证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、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 公平交易制度的执行情况

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》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策、交易执行等各个环节，公平对待旗下所有投资组合。

公司建立投研管理平台并定期举行投研晨会、投研联席会等，建立健全投资授权制度，确保各投资组合公平获得研究资源，享有公平的投资决策机会。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配，报告期内，系统的公平交易程序运作良好，未出现异常情况。针对场外网下交易业务，公司依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。本报告期内，场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1 日、3 日、5 日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了 T 检验，统计了溢价率占优比例。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利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，公平对待投资组合，公司制定了《异常交易管理办法》，对包括可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等异常交易行为做出了界定及相应的防范、控制措施。

报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 2 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年 4 月份的中美贸易摩擦缓和后，全球金融资产波动下降，市场风险偏好逐步恢复，A 股呈现震荡上行的走势。大盘指数在突破今年 3 月高点这一关键阻力位后，短期内或仍存在震荡，在内外部宏观环境持续改善的背景下，宽松的市场流动性叠加美联储提前释放降息信号，为市场

上行建立一定的支撑基础，同时证监会表态稳定资本市场，为市场进一步注入信心，当前均线系统呈多头排列，也预示着市场在充分蓄势之后大概率将进入上行趋势行情。中长期来看，随着全球资金开启新一轮再平衡进程，国际资本将持续增配估值合理、增长确定性强的中国资产。展望下半年，外资持续回流带来的估值修复以及产业政策红利催生的结构性机会，也会进一步强化中国资产重估的趋势。总之，我们对于今年下半年的 A 股市场持有相对乐观的观点。

今年上半年我们的量化模型维持稳健运行，组合仍然是以中证 1000 成分股为主的中小盘风格方向，这也使得组合整体呈现相比大盘指数更高的波动性。经历了 4 月初的下跌后，市场企稳并带动小盘股活跃度逐渐回升，增量资金推动小盘股反弹的同时，也加剧了其交易拥挤度与波动性，我们通过量化模型交易被低估的资产，在上半年获得了较好的表现。进入下半年，我们仍然围绕低估值高成长进行选股并构建投资组合，同时我们适当调降了小盘股中绩差股的权重以规避回撤风险。组合在行业配置上超配电子、计算机、通信以及医药板块，我们选择了行业中估值不高，同时业绩有望高增长的个股进行配置。随着中报的披露，我们也会根据最新业绩数据情况进行调仓，积极寻找优质个股低位布局的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金份额净值为 1.017 元，份额累计净值为 1.017 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.00%，同期基金业绩比较基准的收益率为 0.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前市场流动性继续维持宽松的状态，全市场成交额还在不断增加，小盘股也保持着较强的上行趋势，目前我们没有看到明显的风格切换的信号，所以我们会保持产品的高仓位运行。考虑到小盘股已经积累了一定的收益，场内持仓筹码可能有止盈需求，如果小盘股整体波动率开始上升，或者市场成交额出现短期高点，我们会考虑通过对冲做一些防守，但量化策略本身仍然可以在市场调整中提供持续的超额收益。我们持续看好小盘成长板块在新质生产力浪潮下中长期的投资价值。

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，根据中国证监会相关规定及本基金合同约定，基金管理人严格按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定及基金合同中关于估值的约定，对基金所持投资品种进行估值。基金管理人制定了证券投资估值政策与估值程序，设立基金估值小组，参考行业协会估值意见和第三方估值基准服务机构估值数据，确保基金估值的公平、合理。

基金管理人设立的估值小组，负责组织制定、审核及适时修订基金估值政策和程序，研究、

指导基金估值业务。估值小组成员包括总经理、督察长、分管基金运营部的高级管理人员、分管投研部门的高级管理人员、多资产投资部负责人、研究发展部负责人、基金运营部负责人、风险控制部负责人、监察稽核部负责人或上述部门负责人指定人员，具体人员名单由总经理办公会确定。总经理任估值小组组长，基金运营部负责人任估值小组秘书。估值小组决议需经估值小组成员 1/2 以上（包括本数）同意方可作出。小组成员均具有多年证券、基金从业经验，具备基金估值运作、行业研究、风险管理或法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理可参与估值方法的讨论，但不参与估值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基金托管人和会计师事务所。基金托管人审阅基金管理人采用的估值原则及技术，复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格，当对估值原则及技术有异议时，基金托管人有义务要求基金管理人作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。会计师事务所在对基金年度财务报告出具审计报告时，对报告期内基金的估值技术及其重大变化，特别是对估值的适当性，采用外部信息进行估值的客观性和可靠性程度，以及相关披露的充分性和及时性等发表意见。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

基金管理人已与第三方估值基准服务机构签署服务协议，由其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的债券品种的估值数据，以及流通受限股票的流动性折扣数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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——华商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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华商基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金

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 | 上年度末 2024年12月31日 |
|------------|---------|-------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 21,089,987.23 | 50,602,649.59 |
| 结算备付金 | | 5,084,417.95 | 4,142,081.89 |
| 存出保证金 | | 65,707.32 | 131,381.51 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 323,498,885.80 | 265,762,355.78 |
| 其中：股票投资 | | 323,498,885.80 | 265,762,355.78 |
| 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 | | — | — |
| 其中：债券投资 | | — | — |
| 资产支持证券投资 | | — | — |
| 其他投资 | | — | — |
| 其他债权投资 | | — | — |
| 其他权益工具投资 | | — | — |
| 应收清算款 | | 13,640.21 | 7,603,011.53 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | 17,694.83 | 2,325.89 |

| 递延所得税资产 | | - | - |
|-------------|------------|------------------------|--------------------------|
| 其他资产 | 6. 4. 7. 5 | - | - |
| 资产总计 | | 349, 770, 333. 34 | 328, 243, 806. 19 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6. 4. 7. 3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 3, 177, 277. 85 |
| 应付赎回款 | | 324, 300. 83 | 37, 371. 85 |
| 应付管理人报酬 | | 331, 602. 74 | 352, 998. 94 |
| 应付托管费 | | 55, 267. 11 | 58, 833. 17 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 58, 816. 31 | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6. 4. 7. 6 | 177, 799. 60 | 545, 296. 31 |
| 负债合计 | | 947, 786. 59 | 4, 171, 778. 12 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6. 4. 7. 7 | 342, 973, 808. 97 | 356, 950, 080. 39 |
| 其他综合收益 | 6. 4. 7. 8 | - | - |
| 未分配利润 | 6. 4. 7. 9 | 5, 848, 737. 78 | -32, 878, 052. 32 |
| 净资产合计 | | 348, 822, 546. 75 | 324, 072, 028. 07 |
| 负债和净资产总计 | | 349, 770, 333. 34 | 328, 243, 806. 19 |

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.017 元，基金份额总额 342, 973, 808. 97 份。

6.2 利润表

会计主体：华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|-------------|--|---|
| 一、营业收入 | | 41, 031, 323. 52 | -19, 255, 879. 45 |
| 1. 利息收入 | | 58, 854. 59 | 95, 062. 95 |
| 其中：存款利息收入 | 6. 4. 7. 10 | 58, 854. 59 | 95, 062. 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“-”号填列） | | 15,431,594.38 | -27,775,328.46 |
| 其中：股票投资收益 | 6. 4. 7. 11 | 11,392,235.45 | -30,417,220.30 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6. 4. 7. 12 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6. 4. 7. 13 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6. 4. 7. 14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6. 4. 7. 15 | 1,749,788.47 | - |
| 股利收益 | 6. 4. 7. 16 | 2,289,570.46 | 2,641,891.84 |
| 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. 17 | 25,536,477.46 | 8,423,882.80 |
| 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. 18 | 4,397.09 | 503.26 |
| 减：二、营业总支出 | | 2,411,971.47 | 2,319,713.46 |
| 1. 管理人报酬 | 6. 4. 10. 2. 1 | 1,984,870.34 | 1,901,759.43 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 6. 4. 10. 2. 2 | 330,811.71 | 316,959.93 |
| 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 | 6. 4. 7. 19 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 6,301.75 | - |
| 8. 其他费用 | 6. 4. 7. 20 | 89,987.67 | 100,994.10 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 38,619,352.05 | -21,575,592.91 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 38,619,352.05 | -21,575,592.91 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 38,619,352.05 | -21,575,592.91 |

6.3 净资产变动表

会计主体：华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 356,950,080.39 | -32,878,052.32 | 324,072,028.07 |
| 二、本期期初净资产 | 356,950,080.39 | -32,878,052.32 | 324,072,028.07 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -13,976,271.42 | 38,726,790.10 | 24,750,518.68 |
| (一)、综合收益总额 | - | 38,619,352.05 | 38,619,352.05 |
| (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) | -13,976,271.42 | 107,438.05 | -13,868,833.37 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,763,475.71 | -71,744.02 | 1,691,731.69 |
| 2. 基金赎回款 | -15,739,747.13 | 179,182.07 | -15,560,565.06 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 342,973,808.97 | 5,848,737.78 | 348,822,546.75 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 372,008,594.59 | -32,870,410.34 | 339,138,184.25 |
| 二、本期期初净资产 | 372,008,594.59 | -32,870,410.34 | 339,138,184.25 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | -8,547,206.67 | -20,461,988.96 | -29,009,195.63 |
| (一)、综合收益总额 | - | -21,575,592.91 | -21,575,592.91 |
| (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) | -8,547,206.67 | 1,113,603.95 | -7,433,602.72 |

| | | | |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|
| 产变动数（净资产减少以“-”号填列） | | | |
| 其中：1. 基金申购款 | 1, 654, 096. 29 | -220, 229. 52 | 1, 433, 866. 77 |
| 2. 基金赎回款 | -10, 201, 302. 96 | 1, 333, 833. 47 | -8, 867, 469. 49 |
| (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 | 363, 461, 387. 92 | -53, 332, 399. 30 | 310, 128, 988. 62 |

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：

王小刚

程蕾

程蕾

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华商量化进取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[2015]278 号《关于准予华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》注册，由华商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《华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金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(2015)第 292 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 9 日生效，基金合同生效日的基金份额总额为 8, 097, 969, 485. 94 份基金份额。本基金的基金管理人为华商基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券

取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让2017年12月31日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、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股票收盘价（2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，暂不征收企业所得税。

(4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资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；持股期限超过1年的，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资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。

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 | 21,089,987.23 |
| 等于：本金 | 21,087,474.98 |
| 加：应计利息 | 2,512.25 |
| 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 | 21,089,987.23 |

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 | 305,070,528.30 | - | 323,498,885.80 | 18,428,357.50 |
| 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 | 305,070,528.30 | - | 323,498,885.80 | 18,428,357.50 |

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 26.25 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 93,930.19 |
| 其中：交易所市场 | 93,930.19 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |

| | | |
|------|--|------------|
| 预提费用 | | 83,843.16 |
| 合计 | | 177,799.60 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|---------------|----------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 356,950,080.39 | 356,950,080.39 |
| 本期申购 | 1,763,475.71 | 1,763,475.71 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -15,739,747.13 | -15,739,747.13 |
| - 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 | 342,973,808.97 | 342,973,808.97 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 其他综合收益

本基金本报告期内未发生其他综合收益。

6.4.7.9 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 | 93,443,339.46 | -126,321,391.78 | -32,878,052.32 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | 93,443,339.46 | -126,321,391.78 | -32,878,052.32 |
| 本期利润 | 13,082,874.59 | 25,536,477.46 | 38,619,352.05 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -3,695,242.71 | 3,802,680.76 | 107,438.05 |
| 其中：基金申购款 | 455,892.57 | -527,636.59 | -71,744.02 |
| 基金赎回款 | -4,151,135.28 | 4,330,317.35 | 179,182.07 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 102,830,971.34 | -96,982,233.56 | 5,848,737.78 |

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|----------|----------------------|-----------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | | 48,023.10 |
| 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 | 10,637.50 |
| 其他 | 193.99 |
| 合计 | 58,854.59 |

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 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1月1日至2025年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 476,582,584.22 |
| 减：卖出股票成本总额 | 464,456,655.47 |
| 减：交易费用 | 733,693.30 |
| 买卖股票差价收入 | 11,392,235.45 |

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内未发生债券投资收益。

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内未发生买卖债券差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内未发生资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内未发生贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未发生权证投资收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|----------------------|
| | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
| 股指期货投资收益 | 1,749,788.47 |

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 2,289,570.46 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | — |
| 基金投资产生的股利收益 | — |
| 合计 | 2,289,570.46 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 25,536,477.46 |
| 股票投资 | 25,536,477.46 |
| 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 | 25,536,477.46 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 4,397.09 |
| 合计 | 4,397.09 |

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 19,835.79 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | — |
| 银行费用 | 1,644.51 |
| 账户维护费 | 9,000.00 |
| 合计 | 89,987.67 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------------------|---------------------|
| 华商基金管理有限公司（“华商基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”） | 基金托管人、基金销售机构 |
| 华龙证券股份有限公司（“华龙证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|-------|----------------------------|--------------------------|---------------------------------|----------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的 比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) |
| 华龙证券 | 84,925,714.28 | 8.74 | - | - |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 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1月1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 (%) |
| | | | | |

| | | | | |
|---------------------------------|-----------|--------------------|--------------|-------------------------|
| 华龙证券 | 37,868.14 | 8.74 | - | - |
| 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | | | | |
| 关联方名称 | 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 (%) |
| - | - | - | - | - |

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。
 2. 该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果。
 3. 根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金管理费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6 月30日 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日 |
|----------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 1,984,870.34 | 1,901,759.43 |
| 其中：应支付销售机构的客户维 护费 | 954,505.30 | 913,991.47 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,030,365.04 | 987,767.96 |

注：支付基金管理人华商基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6 月30日 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 330,811.71 | 316,959.93 |

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内均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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人在本报告期内与上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方没有投资本基金的情况。

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1月1日至2025年6月 30日 | | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 | |
|--------|--------------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 21,089,987.23 | 48,023.10 | 26,072,696.45 | 64,028.63 |

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内均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

本基金本报告期内及上年度可比期间内均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

金额单位：人民币元

| |
|----------------------|
| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |
|----------------------|

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
|--------|------|------------|---------|--------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 688411 | 海博思创 | 2025年1月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.38 | 83.49 | 469 | 9,089.22 | 39,156.81 | - |
| 688775 | 影石创新 | 2025年6月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 47.27 | 124.16 | 221 | 10,446.67 | 27,439.36 | - |
| 301458 | 钧威电子 | 2025年1月2日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.40 | 34.11 | 701 | 7,290.40 | 23,911.11 | - |
| 688545 | 兴福电子 | 2025年1月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.68 | 26.95 | 796 | 9,297.28 | 21,452.20 | - |
| 688583 | 思看科技 | 2025年1月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 33.46 | 79.68 | 227 | 5,855.50 | 18,087.36 | - |
| 301602 | 超研股份 | 2025年1月15日 | 6个月 | 新股流通受限 | 6.70 | 24.80 | 658 | 4,408.60 | 16,318.40 | - |
| 301479 | 弘景光电 | 2025年3月6日 | 6个月 | 新股流通受限 | 41.90 | 77.87 | 182 | 5,447.00 | 14,172.34 | - |
| 688757 | 胜科纳米 | 2025年3月18日 | 6个月 | 新股流通受限 | 9.08 | 25.94 | 536 | 4,866.88 | 13,903.84 | - |
| 001388 | 信通电子 | 2025年6月24日 | 1个月内(含) | 新股流通受限 | 16.42 | 16.42 | 843 | 13,842.06 | 13,842.06 | - |
| 688758 | 赛分科技 | 2025年1月2日 | 6个月 | 新股流通受限 | 4.32 | 16.97 | 777 | 3,356.64 | 13,185.69 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-------------|-----|--------|-------|--------|-----|----------|-----------|---|
| 603072 | 天和磁材 | 2024年12月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 12.30 | 54.45 | 225 | 2,767.50 | 12,251.25 | - |
| 301662 | 宏工科技 | 2025年4月10日 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.60 | 82.50 | 143 | 3,803.80 | 11,797.50 | - |
| 301601 | 惠通科技 | 2025年1月8日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.80 | 33.85 | 342 | 4,035.60 | 11,576.70 | - |
| 301658 | 首航新能 | 2025年3月26日 | 6个月 | 新股流通受限 | 11.80 | 22.98 | 437 | 5,156.60 | 10,042.26 | - |
| 301501 | 恒鑫生活 | 2025年3月11日 | 6个月 | 新股流通受限 | 39.92 | 45.22 | 222 | 6,107.76 | 10,038.84 | - |
| 001356 | 富岭股份 | 2025年1月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 5.30 | 14.44 | 663 | 3,513.90 | 9,573.72 | - |
| 301665 | 泰禾股份 | 2025年4月2日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.27 | 22.39 | 393 | 4,036.11 | 8,799.27 | - |
| 301590 | 优优绿能 | 2025年5月28日 | 6个月 | 新股流通受限 | 89.60 | 139.48 | 61 | 5,465.60 | 8,508.28 | - |
| 688755 | 汉邦科技 | 2025年5月9日 | 6个月 | 新股流通受限 | 22.77 | 39.33 | 203 | 4,622.31 | 7,983.99 | - |
| 301173 | 毓恬冠佳 | 2025年2月24日 | 6个月 | 新股流通受限 | 28.33 | 44.98 | 173 | 4,901.09 | 7,781.54 | - |
| 001382 | 新亚电缆 | 2025年3月13日 | 6个月 | 新股流通受限 | 7.40 | 20.21 | 366 | 2,708.40 | 7,396.86 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301636 | 泽润新能 | 2025年4月30日 | 6个月 | 新股流通受限 | 33.06 | 47.46 | 128 | 4,231.68 | 6,074.88 | - |
| 301595 | 太力科技 | 2025年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 17.05 | 29.10 | 196 | 3,341.80 | 5,703.60 | - |
| 301560 | 众捷汽车 | 2025年4月17日 | 6个月 | 新股流通受限 | 16.50 | 27.45 | 190 | 3,135.00 | 5,215.50 | - |
| 603049 | 中策橡胶 | 2025年5月27日 | 6个月 | 新股流通受限 | 46.50 | 42.85 | 121 | 5,626.50 | 5,184.85 | - |
| 603210 | 泰鸿万立 | 2025年4月1日 | 6个月 | 新股流通受限 | 8.60 | 15.61 | 286 | 2,459.60 | 4,464.46 | - |
| 603014 | 威高血净 | 2025年5月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 26.50 | 32.68 | 134 | 3,551.00 | 4,379.12 | - |
| 603271 | 永杰新材 | 2025年3月4日 | 6个月 | 新股流通受限 | 20.60 | 35.08 | 123 | 2,533.80 | 4,314.84 | - |
| 603124 | 江南新材 | 2025年3月12日 | 6个月 | 新股流通受限 | 10.54 | 46.31 | 88 | 927.52 | 4,075.28 | - |
| 001395 | 亚联机械 | 2025年1月20日 | 6个月 | 新股流通受限 | 19.08 | 47.25 | 80 | 1,526.40 | 3,780.00 | - |
| 603202 | 天有为 | 2025年4月16日 | 6个月 | 新股流通受限 | 93.50 | 90.66 | 41 | 3,833.50 | 3,717.06 | - |
| 603409 | 汇通控股 | 2025年2月25日 | 6个月 | 新股流通受限 | 24.18 | 33.32 | 98 | 2,369.64 | 3,265.36 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 001390 | 古麒绒材 | 2025 年 5 月 21 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.08 | 18.12 | 178 | 2,150.24 | 3,225.36 | - |
| 603400 | 华之杰 | 2025 年 6 月 12 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 19.88 | 43.81 | 57 | 1,133.16 | 2,497.17 | - |
| 603382 | 海阳科技 | 2025 年 6 月 5 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 11.50 | 22.39 | 105 | 1,207.50 | 2,350.95 | - |
| 001335 | 信凯科技 | 2025 年 4 月 2 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 12.80 | 28.05 | 80 | 1,024.00 | 2,244.00 | - |
| 603120 | 肯特催化 | 2025 年 4 月 9 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 15.00 | 33.43 | 65 | 975.00 | 2,172.95 | - |
| 001388 | 信通电子 | 2025 年 6 月 24 日 | 6 个月 | 新股流通受限 | 16.42 | 16.42 | 94 | 1,543.48 | 1,543.48 | - |

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及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

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内部控制组织体系包括四个层次：(1)公司一级风险防范由董事会构成。董事会根据公司章程和《华商基金管理有限公司全面风险管理制度》的规定履行风险管理职责。董事会下设专业委员会，各专业委员会根据董事会授权和相关议事规则履行相应风险管理监督职责。(2)公司二级风险防范由公司管理层构成。公司管理层负责在决策和执行过程中全面把控各类风险，并根据董事会的决议和《华商基金管理有限公司全面风险管理制度》的规定履行风险管理职责。各高级管理人员负责监督分管业务条线的员工的风险控制质量和执行情况，评价分管业务条线的风险管理水平和效果。(3)公司的三级风险防范由风险管理小组等职能机构构成。风险管理小组对公司经营过程和基金运作过程中的重大风险进行分析、评估，全面、及时防范公司在经营过程和基金运作过程中面临的各种风险；其他职能机构(如各级投资决策委员会等)在职能范围内依据各职能机构的议事规则对相关业务进行集体决策和风险控制。(4)公司四级风险防范由公司各部门及公司员工构成。公司各部门及公司员工对自身业务工作中的风险进行自我检查和控制，并根据公司经营计划、部门或岗位职责以及《华商基金管理有限公司全面风险管理制度》的规定承担相应风险管理责任。各部门、岗位之间相互监督、制衡。

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。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人通过信用评级团队和中央交易室建立了内部评级体系和交易对手库，对债券发行主体及债券进行内部评级并跟踪进行评级调整，对交易对手实行准入和分级管理，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。

此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合约约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况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。

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年内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|---------------|------|------|-----|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 21,089,987.23 | - | - | - | 21,089,987.23 |
| 结算备付金 | 5,084,417.95 | - | - | - | 5,084,417.95 |

| | | | | | |
|---------------------|---------------|------|------|----------------|----------------|
| 存出保证金 | 65,707.32 | - | - | - | 65,707.32 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 323,498,885.80 | 323,498,885.80 |
| 应收清算款 | - | - | - | 13,640.21 | 13,640.21 |
| 应收申购款 | - | - | - | 17,694.83 | 17,694.83 |
| 资产总计 | 26,240,112.50 | - | - | 323,530,220.84 | 349,770,333.34 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 324,300.83 | 324,300.83 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 331,602.74 | 331,602.74 |
| 应付托管费 | - | - | - | 55,267.11 | 55,267.11 |
| 应交税费 | - | - | - | 58,816.31 | 58,816.31 |
| 其他负债 | - | - | - | 177,799.60 | 177,799.60 |
| 负债总计 | - | - | - | 947,786.59 | 947,786.59 |
| 利率敏感度缺口 | 26,240,112.50 | - | - | 322,582,434.25 | 348,822,546.75 |
| 上年度末 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 | 50,602,649.59 | - | - | - | 50,602,649.59 |
| 结算备付金 | 4,142,081.89 | - | - | - | 4,142,081.89 |
| 存出保证金 | 131,381.51 | - | - | - | 131,381.51 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 265,762,355.78 | 265,762,355.78 |
| 应收清算款 | - | - | - | 7,603,011.53 | 7,603,011.53 |
| 应收申购款 | - | - | - | 2,325.89 | 2,325.89 |
| 资产总计 | 54,876,112.99 | - | - | 273,367,693.20 | 328,243,806.19 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 3,177,277.85 | 3,177,277.85 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 37,371.85 | 37,371.85 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 352,998.94 | 352,998.94 |
| 应付托管费 | - | - | - | 58,833.17 | 58,833.17 |
| 其他负债 | - | - | - | 545,296.31 | 545,296.31 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,171,778.12 | 4,171,778.12 |
| 利率敏感度缺口 | 54,876,112.99 | - | - | 269,195,915.08 | 324,072,028.07 |

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

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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或

证券市场整体波动)发生变动时导致基金资产发生损失的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人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进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

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 | | 上年度末 2024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 | 323,498,885.80 | 92.74 | 265,762,355.78 | 82.01 |
| 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 | 323,498,885.80 | 92.74 | 265,762,355.78 | 82.01 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深300指数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) | 上年度末(2024年12月31日) |
| 1. 沪深300指数上升5% | 1. 沪深300指数上升5% | 23,844,681.48 | 18,666,086.10 |
| | 2. 沪深300指数下降5% | -23,844,681.48 | -18,666,086.10 |

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 | 上年度末 2024年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 323,127,457.56 | 265,260,657.18 |
| 第二层次 | 15,385.54 | 27,588.90 |
| 第三层次 | 356,042.70 | 474,109.70 |
| 合计 | 323,498,885.80 | 265,762,355.78 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的金融工具，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停、基金处于封闭期等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债（上年度末：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具账面价值与公允价值差异很小。

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 | 323,498,885.80 | 92.49 |
| | 其中：股票 | 323,498,885.80 | 92.49 |
| 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 | 26,174,405.18 | 7.48 |
| 8 | 其他各项资产 | 97,042.36 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 349,770,333.34 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 1,103,907.00 | 0.32 |
| B | 采矿业 | 4,530,621.00 | 1.30 |
| C | 制造业 | 199,772,908.53 | 57.27 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,017,337.00 | 1.44 |
| E | 建筑业 | 3,297,451.00 | 0.95 |
| F | 批发和零售业 | 5,575,539.00 | 1.60 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,096,459.00 | 1.75 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 68,558,318.26 | 19.65 |
| J | 金融业 | 5,989,667.00 | 1.72 |
| K | 房地产业 | 3,492,697.00 | 1.00 |
| L | 租赁和商务服务业 | 7,032,626.92 | 2.02 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 2,780,975.09 | 0.80 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 1,883,222.00 | 0.54 |

| | | | |
|---|---------------|----------------|-------|
| 0 | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 210,100.00 | 0.06 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,157,057.00 | 2.34 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 323,498,885.80 | 92.74 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 003040 | 楚天龙 | 79,400 | 1,925,450.00 | 0.55 |
| 2 | 002396 | 星网锐捷 | 74,200 | 1,665,790.00 | 0.48 |
| 3 | 002456 | 欧菲光 | 134,700 | 1,596,195.00 | 0.46 |
| 4 | 000917 | 电广传媒 | 208,100 | 1,573,236.00 | 0.45 |
| 5 | 300166 | 东方国信 | 142,300 | 1,551,070.00 | 0.44 |
| 6 | 002036 | 联创电子 | 141,600 | 1,530,696.00 | 0.44 |
| 7 | 300079 | 数码视讯 | 258,200 | 1,510,470.00 | 0.43 |
| 8 | 600728 | 佳都科技 | 276,500 | 1,506,925.00 | 0.43 |
| 9 | 301205 | 联特科技 | 15,500 | 1,485,830.00 | 0.43 |
| 10 | 300327 | 中颖电子 | 60,460 | 1,464,341.20 | 0.42 |
| 11 | 300687 | 赛意信息 | 52,400 | 1,455,672.00 | 0.42 |
| 12 | 600718 | 东软集团 | 147,854 | 1,441,576.50 | 0.41 |
| 13 | 002654 | 万润科技 | 115,200 | 1,436,544.00 | 0.41 |
| 14 | 002649 | 博彦科技 | 98,800 | 1,435,564.00 | 0.41 |
| 15 | 600037 | 歌华有线 | 186,500 | 1,424,860.00 | 0.41 |
| 16 | 300579 | 数字认证 | 41,100 | 1,418,361.00 | 0.41 |
| 17 | 300303 | 聚飞光电 | 223,300 | 1,415,722.00 | 0.41 |
| 18 | 002063 | 远光软件 | 237,700 | 1,414,315.00 | 0.41 |
| 19 | 300602 | 飞荣达 | 66,500 | 1,410,465.00 | 0.40 |
| 20 | 300620 | 光库科技 | 29,700 | 1,399,167.00 | 0.40 |
| 21 | 002212 | 天融信 | 180,100 | 1,386,770.00 | 0.40 |
| 22 | 300323 | 华灿光电 | 180,200 | 1,378,530.00 | 0.40 |
| 23 | 688270 | 臻镭科技 | 29,600 | 1,378,176.00 | 0.40 |
| 24 | 688388 | 嘉元科技 | 68,500 | 1,375,480.00 | 0.39 |
| 25 | 603118 | 共进股份 | 121,600 | 1,370,432.00 | 0.39 |
| 26 | 603533 | 掌阅科技 | 61,300 | 1,367,603.00 | 0.39 |
| 27 | 688127 | 蓝特光学 | 53,100 | 1,365,201.00 | 0.39 |
| 28 | 600556 | 天下秀 | 267,100 | 1,362,210.00 | 0.39 |
| 29 | 688766 | 普冉股份 | 21,540 | 1,361,328.00 | 0.39 |

| | | | | | |
|----|--------|------|----------|-----------------|-------|
| 30 | 600552 | 凯盛科技 | 120, 300 | 1, 359, 390. 00 | 0. 39 |
| 31 | 002815 | 崇达技术 | 119, 500 | 1, 353, 935. 00 | 0. 39 |
| 32 | 688403 | 汇成股份 | 130, 300 | 1, 353, 817. 00 | 0. 39 |
| 33 | 688362 | 甬矽电子 | 45, 400 | 1, 352, 012. 00 | 0. 39 |
| 34 | 688167 | 炬光科技 | 16, 700 | 1, 348, 525. 00 | 0. 39 |
| 35 | 600158 | 中体产业 | 159, 700 | 1, 346, 271. 00 | 0. 39 |
| 36 | 688630 | 芯碁微装 | 16, 900 | 1, 341, 353. 00 | 0. 38 |
| 37 | 600775 | 南京熊猫 | 123, 100 | 1, 340, 559. 00 | 0. 38 |
| 38 | 600757 | 长江传媒 | 144, 200 | 1, 338, 176. 00 | 0. 38 |
| 39 | 300232 | 洲明科技 | 184, 200 | 1, 333, 608. 00 | 0. 38 |
| 40 | 002993 | 奥海科技 | 32, 100 | 1, 331, 187. 00 | 0. 38 |
| 41 | 300188 | 国投智能 | 96, 400 | 1, 330, 320. 00 | 0. 38 |
| 42 | 300525 | 博思软件 | 91, 000 | 1, 324, 960. 00 | 0. 38 |
| 43 | 301511 | 德福科技 | 63, 800 | 1, 320, 660. 00 | 0. 38 |
| 44 | 300036 | 超图软件 | 86, 500 | 1, 319, 990. 00 | 0. 38 |
| 45 | 688048 | 长光华芯 | 22, 800 | 1, 316, 472. 00 | 0. 38 |
| 46 | 300319 | 麦捷科技 | 121, 800 | 1, 308, 132. 00 | 0. 38 |
| 47 | 000727 | 冠捷科技 | 534, 400 | 1, 298, 592. 00 | 0. 37 |
| 48 | 002913 | 奥士康 | 44, 100 | 1, 296, 981. 00 | 0. 37 |
| 49 | 300455 | 航天智装 | 89, 800 | 1, 293, 120. 00 | 0. 37 |
| 50 | 603328 | 依顿电子 | 131, 500 | 1, 290, 015. 00 | 0. 37 |
| 51 | 688066 | 航天宏图 | 65, 800 | 1, 288, 364. 00 | 0. 37 |
| 52 | 300451 | 创业慧康 | 227, 600 | 1, 285, 940. 00 | 0. 37 |
| 53 | 603083 | 剑桥科技 | 27, 100 | 1, 281, 830. 00 | 0. 37 |
| 54 | 002421 | 达实智能 | 380, 400 | 1, 278, 144. 00 | 0. 37 |
| 55 | 002351 | 漫步者 | 97, 400 | 1, 277, 888. 00 | 0. 37 |
| 56 | 300226 | 上海钢联 | 55, 903 | 1, 276, 824. 52 | 0. 37 |
| 57 | 300598 | 诚迈科技 | 30, 000 | 1, 276, 500. 00 | 0. 37 |
| 58 | 603496 | 恒为科技 | 49, 500 | 1, 274, 130. 00 | 0. 37 |
| 59 | 300770 | 新媒股份 | 31, 600 | 1, 263, 684. 00 | 0. 36 |
| 60 | 300678 | 中科信息 | 36, 300 | 1, 255, 254. 00 | 0. 36 |
| 61 | 603383 | 顶点软件 | 29, 600 | 1, 255, 040. 00 | 0. 36 |
| 62 | 688262 | 国芯科技 | 47, 000 | 1, 253, 490. 00 | 0. 36 |
| 63 | 688007 | 光峰科技 | 86, 500 | 1, 250, 790. 00 | 0. 36 |
| 64 | 002079 | 苏州固锝 | 128, 100 | 1, 248, 975. 00 | 0. 36 |
| 65 | 301095 | 广立微 | 22, 200 | 1, 248, 528. 00 | 0. 36 |
| 66 | 600640 | 国脉文化 | 103, 001 | 1, 248, 372. 12 | 0. 36 |
| 67 | 000049 | 德赛电池 | 54, 800 | 1, 247, 248. 00 | 0. 36 |
| 68 | 300613 | 富瀚微 | 25, 500 | 1, 246, 440. 00 | 0. 36 |
| 69 | 301217 | 铜冠铜箔 | 99, 200 | 1, 240, 992. 00 | 0. 36 |
| 70 | 002777 | 久远银海 | 67, 500 | 1, 232, 550. 00 | 0. 35 |
| 71 | 600996 | 贵广网络 | 146, 900 | 1, 225, 146. 00 | 0. 35 |
| 72 | 688083 | 中望软件 | 18, 900 | 1, 217, 349. 00 | 0. 35 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 73 | 603636 | 南威软件 | 95,900 | 1,212,176.00 | 0.35 |
| 74 | 605168 | 三人行 | 41,180 | 1,211,927.40 | 0.35 |
| 75 | 688150 | 莱特光电 | 48,800 | 1,206,336.00 | 0.35 |
| 76 | 002859 | 洁美科技 | 60,500 | 1,204,555.00 | 0.35 |
| 77 | 688686 | 奥普特 | 12,500 | 1,195,250.00 | 0.34 |
| 78 | 301031 | 中熔电气 | 14,904 | 1,187,103.60 | 0.34 |
| 79 | 301153 | 中科江南 | 45,200 | 1,184,240.00 | 0.34 |
| 80 | 002635 | 安洁科技 | 87,200 | 1,180,688.00 | 0.34 |
| 81 | 688372 | 伟测科技 | 19,500 | 1,177,800.00 | 0.34 |
| 82 | 688380 | 中微半导 | 43,200 | 1,170,720.00 | 0.34 |
| 83 | 688107 | 安路科技 | 41,300 | 1,166,312.00 | 0.33 |
| 84 | 301180 | 万祥科技 | 78,900 | 1,162,197.00 | 0.33 |
| 85 | 301348 | 蓝箭电子 | 49,300 | 1,160,029.00 | 0.33 |
| 86 | 300768 | 迪普科技 | 67,400 | 1,155,910.00 | 0.33 |
| 87 | 301262 | 海看股份 | 43,600 | 1,149,296.00 | 0.33 |
| 88 | 688515 | 裕太微 | 12,500 | 1,145,000.00 | 0.33 |
| 89 | 688209 | 英集芯 | 61,200 | 1,130,364.00 | 0.32 |
| 90 | 603297 | 永新光学 | 12,900 | 1,126,815.00 | 0.32 |
| 91 | 603327 | 福蓉科技 | 121,719 | 1,125,900.75 | 0.32 |
| 92 | 688332 | 中科蓝讯 | 10,800 | 1,113,264.00 | 0.32 |
| 93 | 688232 | 新点软件 | 36,800 | 1,105,472.00 | 0.32 |
| 94 | 603989 | 艾华集团 | 71,600 | 1,102,640.00 | 0.32 |
| 95 | 603466 | 风语筑 | 108,600 | 1,095,774.00 | 0.31 |
| 96 | 300663 | 科蓝软件 | 55,400 | 1,086,948.00 | 0.31 |
| 97 | 002123 | 梦网科技 | 72,500 | 1,083,875.00 | 0.31 |
| 98 | 603103 | 横店影视 | 66,300 | 1,064,115.00 | 0.31 |
| 99 | 605577 | 龙版传媒 | 81,900 | 1,053,234.00 | 0.30 |
| 100 | 688608 | 恒玄科技 | 3,000 | 1,043,940.00 | 0.30 |
| 101 | 688383 | 新益昌 | 20,500 | 1,042,630.00 | 0.30 |
| 102 | 301339 | 通行宝 | 60,480 | 1,036,022.40 | 0.30 |
| 103 | 002174 | 游族网络 | 84,900 | 1,029,837.00 | 0.30 |
| 104 | 300031 | 宝通科技 | 40,600 | 1,016,218.00 | 0.29 |
| 105 | 002990 | 盛视科技 | 34,500 | 1,011,195.00 | 0.29 |
| 106 | 002291 | 遥望科技 | 152,500 | 995,825.00 | 0.29 |
| 107 | 300779 | 惠城环保 | 5,400 | 963,846.00 | 0.28 |
| 108 | 300366 | 创意信息 | 117,300 | 945,438.00 | 0.27 |
| 109 | 300346 | 南大光电 | 29,700 | 939,708.00 | 0.27 |
| 110 | 600363 | 联创光电 | 15,700 | 915,781.00 | 0.26 |
| 111 | 688266 | 泽璟制药 | 8,200 | 881,582.00 | 0.25 |
| 112 | 605589 | 圣泉集团 | 31,200 | 865,800.00 | 0.25 |
| 113 | 600171 | 上海贝岭 | 25,000 | 856,250.00 | 0.25 |
| 114 | 688019 | 安集科技 | 5,590 | 848,562.00 | 0.24 |
| 115 | 002405 | 四维图新 | 97,100 | 829,234.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 116 | 300568 | 星源材质 | 62,600 | 793,768.00 | 0.23 |
| 117 | 300253 | 卫宁健康 | 72,900 | 772,740.00 | 0.22 |
| 118 | 300857 | 协创数据 | 8,820 | 759,049.20 | 0.22 |
| 119 | 603005 | 晶方科技 | 26,500 | 752,335.00 | 0.22 |
| 120 | 002837 | 英维克 | 25,090 | 745,423.90 | 0.21 |
| 121 | 688347 | 华虹公司 | 13,500 | 741,285.00 | 0.21 |
| 122 | 002139 | 拓邦股份 | 52,700 | 727,787.00 | 0.21 |
| 123 | 688166 | 博瑞医药 | 13,300 | 714,343.00 | 0.20 |
| 124 | 601777 | 千里科技 | 83,800 | 711,462.00 | 0.20 |
| 125 | 300627 | 华测导航 | 20,160 | 705,600.00 | 0.20 |
| 126 | 600100 | 同方股份 | 96,500 | 698,660.00 | 0.20 |
| 127 | 688037 | 芯源微 | 6,500 | 696,800.00 | 0.20 |
| 128 | 603619 | 中曼石油 | 34,300 | 688,401.00 | 0.20 |
| 129 | 300674 | 宇信科技 | 22,700 | 687,583.00 | 0.20 |
| 130 | 688027 | 国盾量子 | 2,500 | 687,525.00 | 0.20 |
| 131 | 300130 | 新国都 | 19,100 | 678,623.00 | 0.19 |
| 132 | 603236 | 移远通信 | 7,900 | 677,820.00 | 0.19 |
| 133 | 002400 | 省广集团 | 88,500 | 676,140.00 | 0.19 |
| 134 | 600967 | 内蒙一机 | 33,700 | 652,095.00 | 0.19 |
| 135 | 000528 | 柳工 | 65,500 | 629,455.00 | 0.18 |
| 136 | 002506 | 协鑫集成 | 235,500 | 628,785.00 | 0.18 |
| 137 | 600961 | 株冶集团 | 56,200 | 628,316.00 | 0.18 |
| 138 | 688116 | 天奈科技 | 13,600 | 622,472.00 | 0.18 |
| 139 | 688568 | 中科星图 | 17,284 | 622,396.84 | 0.18 |
| 140 | 601677 | 明泰铝业 | 50,000 | 621,000.00 | 0.18 |
| 141 | 300638 | 广和通 | 21,500 | 615,545.00 | 0.18 |
| 142 | 002583 | 海能达 | 49,900 | 614,269.00 | 0.18 |
| 143 | 600562 | 国睿科技 | 19,500 | 614,055.00 | 0.18 |
| 144 | 300623 | 捷捷微电 | 20,600 | 613,880.00 | 0.18 |
| 145 | 600577 | 精达股份 | 82,400 | 613,056.00 | 0.18 |
| 146 | 603766 | 隆鑫通用 | 48,000 | 612,480.00 | 0.18 |
| 147 | 002176 | 江特电机 | 84,200 | 611,292.00 | 0.18 |
| 148 | 000415 | 渤海租赁 | 181,300 | 603,729.00 | 0.17 |
| 149 | 300088 | 长信科技 | 99,500 | 593,020.00 | 0.17 |
| 150 | 002312 | 川发龙蟒 | 51,400 | 590,072.00 | 0.17 |
| 151 | 300296 | 利亚德 | 95,400 | 581,940.00 | 0.17 |
| 152 | 600120 | 浙江东方 | 95,800 | 579,590.00 | 0.17 |
| 153 | 688183 | 生益电子 | 11,200 | 573,440.00 | 0.16 |
| 154 | 300666 | 江丰电子 | 7,700 | 570,570.00 | 0.16 |
| 155 | 300182 | 捷成股份 | 102,400 | 564,224.00 | 0.16 |
| 156 | 688333 | 铂力特 | 9,400 | 559,864.00 | 0.16 |
| 157 | 300682 | 朗新集团 | 23,800 | 559,300.00 | 0.16 |
| 158 | 300762 | 上海瀚讯 | 24,600 | 556,698.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 159 | 002015 | 协鑫能科 | 39,800 | 554,414.00 | 0.16 |
| 160 | 600601 | 方正科技 | 102,000 | 544,680.00 | 0.16 |
| 161 | 002222 | 福晶科技 | 15,700 | 536,940.00 | 0.15 |
| 162 | 300181 | 佐力药业 | 30,900 | 535,497.00 | 0.15 |
| 163 | 688018 | 乐鑫科技 | 3,640 | 531,804.00 | 0.15 |
| 164 | 600602 | 云赛智联 | 26,300 | 530,471.00 | 0.15 |
| 165 | 600633 | 浙数文化 | 38,200 | 528,688.00 | 0.15 |
| 166 | 688200 | 华峰测控 | 3,600 | 519,120.00 | 0.15 |
| 167 | 600110 | 诺德股份 | 73,600 | 514,464.00 | 0.15 |
| 168 | 600559 | 老白干酒 | 30,700 | 514,225.00 | 0.15 |
| 169 | 688208 | 道通科技 | 16,778 | 513,406.80 | 0.15 |
| 170 | 002145 | 中核钛白 | 123,200 | 511,280.00 | 0.15 |
| 171 | 600446 | 金证股份 | 26,800 | 508,396.00 | 0.15 |
| 172 | 688088 | 虹软科技 | 10,500 | 506,625.00 | 0.15 |
| 173 | 000951 | 中国重汽 | 28,700 | 504,546.00 | 0.14 |
| 174 | 600072 | 中船科技 | 38,900 | 504,144.00 | 0.14 |
| 175 | 600064 | 南京高科 | 65,200 | 502,692.00 | 0.14 |
| 176 | 000581 | 威孚高科 | 26,500 | 501,910.00 | 0.14 |
| 177 | 688322 | 奥比中光 | 8,500 | 501,585.00 | 0.14 |
| 178 | 300777 | 中简科技 | 13,800 | 500,250.00 | 0.14 |
| 179 | 601375 | 中原证券 | 119,500 | 497,120.00 | 0.14 |
| 180 | 002497 | 雅化集团 | 43,500 | 495,900.00 | 0.14 |
| 181 | 002151 | 北斗星通 | 17,000 | 487,730.00 | 0.14 |
| 182 | 300679 | 电连技术 | 10,700 | 485,566.00 | 0.14 |
| 183 | 300133 | 华策影视 | 64,400 | 483,644.00 | 0.14 |
| 184 | 002484 | 江海股份 | 23,600 | 483,564.00 | 0.14 |
| 185 | 300113 | 顺网科技 | 24,300 | 480,168.00 | 0.14 |
| 186 | 300229 | 拓尔思 | 25,800 | 475,752.00 | 0.14 |
| 187 | 600323 | 瀚蓝环境 | 19,500 | 474,825.00 | 0.14 |
| 188 | 000970 | 中科三环 | 40,100 | 471,977.00 | 0.14 |
| 189 | 600761 | 安徽合力 | 26,600 | 471,884.00 | 0.14 |
| 190 | 600595 | 中孚实业 | 107,400 | 470,412.00 | 0.13 |
| 191 | 300438 | 鹏辉能源 | 17,000 | 469,370.00 | 0.13 |
| 192 | 002544 | 普天科技 | 19,900 | 466,655.00 | 0.13 |
| 193 | 002773 | 康弘药业 | 16,100 | 466,417.00 | 0.13 |
| 194 | 600641 | 万业企业 | 33,500 | 464,980.00 | 0.13 |
| 195 | 688327 | 云从科技 | 33,500 | 461,965.00 | 0.13 |
| 196 | 603308 | 应流股份 | 19,700 | 454,676.00 | 0.13 |
| 197 | 300348 | 长亮科技 | 26,100 | 453,879.00 | 0.13 |
| 198 | 600285 | 羚锐制药 | 20,000 | 453,400.00 | 0.13 |
| 199 | 300101 | 振芯科技 | 19,800 | 448,074.00 | 0.13 |
| 200 | 000686 | 东北证券 | 58,700 | 447,881.00 | 0.13 |
| 201 | 000099 | 中信海直 | 20,400 | 444,312.00 | 0.13 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 202 | 002315 | 焦点科技 | 9,700 | 443,193.00 | 0.13 |
| 203 | 600388 | 龙净环保 | 36,800 | 441,600.00 | 0.13 |
| 204 | 000682 | 东方电子 | 42,900 | 439,296.00 | 0.13 |
| 205 | 301050 | 雷电微力 | 8,200 | 437,060.00 | 0.13 |
| 206 | 688582 | 芯动联科 | 6,500 | 436,800.00 | 0.13 |
| 207 | 002488 | 金固股份 | 31,600 | 436,080.00 | 0.13 |
| 208 | 600273 | 嘉化能源 | 51,400 | 434,844.00 | 0.12 |
| 209 | 002270 | 华明装备 | 25,900 | 433,566.00 | 0.12 |
| 210 | 688110 | 东芯股份 | 14,100 | 432,306.00 | 0.12 |
| 211 | 000875 | 吉电股份 | 85,400 | 432,124.00 | 0.12 |
| 212 | 600478 | 科力远 | 68,600 | 428,750.00 | 0.12 |
| 213 | 300660 | 江苏雷利 | 9,660 | 427,358.40 | 0.12 |
| 214 | 600114 | 东睦股份 | 21,000 | 427,140.00 | 0.12 |
| 215 | 002747 | 埃斯顿 | 21,100 | 427,064.00 | 0.12 |
| 216 | 601975 | 招商南油 | 146,000 | 426,320.00 | 0.12 |
| 217 | 600850 | 电科数字 | 17,500 | 423,325.00 | 0.12 |
| 218 | 300185 | 通裕重工 | 146,900 | 420,134.00 | 0.12 |
| 219 | 002698 | 博实股份 | 27,000 | 419,580.00 | 0.12 |
| 220 | 300315 | 掌趣科技 | 69,100 | 419,437.00 | 0.12 |
| 221 | 300475 | 香农芯创 | 11,700 | 416,871.00 | 0.12 |
| 222 | 002428 | 云南锗业 | 20,900 | 415,910.00 | 0.12 |
| 223 | 002706 | 良信股份 | 46,600 | 415,206.00 | 0.12 |
| 224 | 600667 | 太极实业 | 62,500 | 411,250.00 | 0.12 |
| 225 | 603678 | 火炬电子 | 10,800 | 410,724.00 | 0.12 |
| 226 | 300735 | 光弘科技 | 16,300 | 409,130.00 | 0.12 |
| 227 | 688279 | 峰岹科技 | 2,200 | 408,100.00 | 0.12 |
| 228 | 002171 | 楚江新材 | 41,800 | 406,714.00 | 0.12 |
| 229 | 605111 | 新洁能 | 13,200 | 405,768.00 | 0.12 |
| 230 | 300775 | 三角防务 | 15,100 | 405,586.00 | 0.12 |
| 231 | 601333 | 广深铁路 | 140,300 | 405,467.00 | 0.12 |
| 232 | 600908 | 无锡银行 | 64,200 | 405,102.00 | 0.12 |
| 233 | 601222 | 林洋能源 | 70,800 | 403,560.00 | 0.12 |
| 234 | 300045 | 华力创通 | 21,100 | 402,799.00 | 0.12 |
| 235 | 688050 | 爱博医疗 | 5,800 | 399,330.00 | 0.11 |
| 236 | 002675 | 东诚药业 | 27,700 | 398,603.00 | 0.11 |
| 237 | 688676 | 金盘科技 | 11,900 | 398,055.00 | 0.11 |
| 238 | 688484 | 南芯科技 | 10,000 | 395,500.00 | 0.11 |
| 239 | 600151 | 航天机电 | 53,800 | 392,202.00 | 0.11 |
| 240 | 002807 | 江阴银行 | 82,400 | 391,400.00 | 0.11 |
| 241 | 688141 | 杰华特 | 12,000 | 390,960.00 | 0.11 |
| 242 | 600621 | 华鑫股份 | 25,500 | 390,405.00 | 0.11 |
| 243 | 002906 | 华阳集团 | 12,000 | 390,120.00 | 0.11 |
| 244 | 601528 | 瑞丰银行 | 67,300 | 389,667.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 245 | 601126 | 四方股份 | 23,900 | 388,853.00 | 0.11 |
| 246 | 601678 | 滨化股份 | 93,800 | 388,332.00 | 0.11 |
| 247 | 688063 | 派能科技 | 8,600 | 387,688.00 | 0.11 |
| 248 | 000690 | 宝新能源 | 85,200 | 387,660.00 | 0.11 |
| 249 | 000902 | 新洋丰 | 28,000 | 387,240.00 | 0.11 |
| 250 | 688409 | 富创精密 | 7,000 | 385,070.00 | 0.11 |
| 251 | 002701 | 奥瑞金 | 64,600 | 384,370.00 | 0.11 |
| 252 | 600338 | 西藏珠峰 | 34,600 | 383,714.00 | 0.11 |
| 253 | 600993 | 马应龙 | 13,500 | 381,780.00 | 0.11 |
| 254 | 603997 | 继峰股份 | 29,100 | 379,464.00 | 0.11 |
| 255 | 002597 | 金禾实业 | 16,100 | 379,155.00 | 0.11 |
| 256 | 300456 | 赛微电子 | 22,000 | 378,180.00 | 0.11 |
| 257 | 600201 | 生物股份 | 47,100 | 377,742.00 | 0.11 |
| 258 | 603699 | 纽威股份 | 12,100 | 377,157.00 | 0.11 |
| 259 | 300236 | 上海新阳 | 9,700 | 376,360.00 | 0.11 |
| 260 | 600452 | 涪陵电力 | 40,800 | 375,360.00 | 0.11 |
| 261 | 600320 | 振华重工 | 85,700 | 374,509.00 | 0.11 |
| 262 | 600645 | 中源协和 | 16,100 | 373,520.00 | 0.11 |
| 263 | 603123 | 翠微股份 | 21,900 | 373,395.00 | 0.11 |
| 264 | 688123 | 聚辰股份 | 4,600 | 372,554.00 | 0.11 |
| 265 | 002745 | 木林森 | 47,100 | 371,148.00 | 0.11 |
| 266 | 688318 | 财富趋势 | 3,220 | 370,042.40 | 0.11 |
| 267 | 603662 | 柯力传感 | 5,700 | 364,401.00 | 0.10 |
| 268 | 300457 | 赢合科技 | 15,800 | 363,400.00 | 0.10 |
| 269 | 002239 | 奥特佳 | 125,300 | 363,370.00 | 0.10 |
| 270 | 300049 | 福瑞股份 | 11,200 | 363,216.00 | 0.10 |
| 271 | 300593 | 新雷能 | 27,000 | 361,800.00 | 0.10 |
| 272 | 601519 | 大智慧 | 35,500 | 361,745.00 | 0.10 |
| 273 | 300109 | 新开源 | 21,800 | 361,662.00 | 0.10 |
| 274 | 600596 | 新安股份 | 44,600 | 361,260.00 | 0.10 |
| 275 | 603920 | 世运电路 | 11,800 | 360,018.00 | 0.10 |
| 276 | 000503 | 国新健康 | 34,000 | 359,380.00 | 0.10 |
| 277 | 002020 | 京新药业 | 27,500 | 358,875.00 | 0.10 |
| 278 | 600572 | 康恩贝 | 81,800 | 358,284.00 | 0.10 |
| 279 | 600750 | 江中药业 | 16,100 | 351,463.00 | 0.10 |
| 280 | 300294 | 博雅生物 | 13,500 | 350,865.00 | 0.10 |
| 281 | 600267 | 海正药业 | 37,900 | 350,575.00 | 0.10 |
| 282 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 27,300 | 350,259.00 | 0.10 |
| 283 | 000555 | 神州信息 | 24,600 | 349,812.00 | 0.10 |
| 284 | 600315 | 上海家化 | 16,600 | 349,762.00 | 0.10 |
| 285 | 002539 | 云图控股 | 37,200 | 348,936.00 | 0.10 |
| 286 | 600456 | 宝钛股份 | 11,100 | 348,873.00 | 0.10 |
| 287 | 601311 | 骆驼股份 | 38,600 | 348,558.00 | 0.10 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 288 | 000811 | 冰轮环境 | 35,360 | 346,528.00 | 0.10 |
| 289 | 603218 | 日月股份 | 27,300 | 346,437.00 | 0.10 |
| 290 | 003021 | 兆威机电 | 3,200 | 346,080.00 | 0.10 |
| 291 | 300298 | 三诺生物 | 15,300 | 345,627.00 | 0.10 |
| 292 | 601718 | 际华集团 | 88,100 | 345,352.00 | 0.10 |
| 293 | 688029 | 南微医学 | 5,100 | 344,505.00 | 0.10 |
| 294 | 002948 | 青岛银行 | 69,100 | 344,118.00 | 0.10 |
| 295 | 300747 | 锐科激光 | 14,500 | 343,360.00 | 0.10 |
| 296 | 000543 | 皖能电力 | 48,700 | 340,900.00 | 0.10 |
| 297 | 000968 | 蓝焰控股 | 47,000 | 340,750.00 | 0.10 |
| 298 | 605090 | 九丰能源 | 13,200 | 340,692.00 | 0.10 |
| 299 | 000860 | 顺鑫农业 | 21,900 | 340,545.00 | 0.10 |
| 300 | 600399 | 抚顺特钢 | 65,100 | 339,822.00 | 0.10 |
| 301 | 600330 | 天通股份 | 47,300 | 339,141.00 | 0.10 |
| 302 | 002324 | 普利特 | 31,800 | 338,034.00 | 0.10 |
| 303 | 002183 | 怡亚通 | 73,300 | 337,913.00 | 0.10 |
| 304 | 600422 | 昆药集团 | 23,600 | 337,716.00 | 0.10 |
| 305 | 600821 | 金开新能 | 61,900 | 336,117.00 | 0.10 |
| 306 | 688289 | 圣湘生物 | 16,400 | 335,872.00 | 0.10 |
| 307 | 002936 | 郑州银行 | 162,900 | 335,574.00 | 0.10 |
| 308 | 688192 | 迪哲医药 | 5,600 | 334,880.00 | 0.10 |
| 309 | 000680 | 山推股份 | 37,300 | 334,581.00 | 0.10 |
| 310 | 301078 | 孩子王 | 25,500 | 333,285.00 | 0.10 |
| 311 | 002839 | 张家港行 | 73,600 | 331,200.00 | 0.09 |
| 312 | 601137 | 博威合金 | 18,600 | 330,894.00 | 0.09 |
| 313 | 600055 | 万东医疗 | 19,100 | 330,048.00 | 0.09 |
| 314 | 601778 | 晶科科技 | 111,000 | 329,670.00 | 0.09 |
| 315 | 002847 | 盐津铺子 | 4,100 | 329,640.00 | 0.09 |
| 316 | 300850 | 新强联 | 9,200 | 329,544.00 | 0.09 |
| 317 | 600328 | 中盐化工 | 42,900 | 328,185.00 | 0.09 |
| 318 | 688503 | 聚和材料 | 7,900 | 326,981.00 | 0.09 |
| 319 | 688596 | 正帆科技 | 9,600 | 325,632.00 | 0.09 |
| 320 | 002182 | 宝武镁业 | 26,600 | 325,584.00 | 0.09 |
| 321 | 603267 | 鸿远电子 | 6,400 | 321,728.00 | 0.09 |
| 322 | 002010 | 传化智联 | 57,500 | 320,850.00 | 0.09 |
| 323 | 002003 | 伟星股份 | 29,400 | 320,754.00 | 0.09 |
| 324 | 300811 | 铂科新材 | 6,900 | 320,229.00 | 0.09 |
| 325 | 600057 | 厦门象屿 | 45,400 | 319,162.00 | 0.09 |
| 326 | 300284 | 苏交科 | 35,000 | 318,500.00 | 0.09 |
| 327 | 600366 | 宁波韵升 | 29,300 | 318,198.00 | 0.09 |
| 328 | 603565 | 中谷物流 | 33,200 | 317,060.00 | 0.09 |
| 329 | 300685 | 艾德生物 | 14,700 | 316,491.00 | 0.09 |
| 330 | 002332 | 仙琚制药 | 34,500 | 316,365.00 | 0.09 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 331 | 601860 | 紫金银行 | 105,400 | 316,200.00 | 0.09 |
| 332 | 002254 | 泰和新材 | 29,300 | 315,854.00 | 0.09 |
| 333 | 000737 | 北方铜业 | 29,000 | 314,940.00 | 0.09 |
| 334 | 301035 | 润丰股份 | 5,300 | 314,502.00 | 0.09 |
| 335 | 600266 | 城建发展 | 68,600 | 311,444.00 | 0.09 |
| 336 | 002416 | 爱施德 | 25,900 | 311,318.00 | 0.09 |
| 337 | 600420 | 国药现代 | 29,200 | 310,980.00 | 0.09 |
| 338 | 600210 | 紫江企业 | 45,500 | 310,765.00 | 0.09 |
| 339 | 600461 | 洪城环境 | 32,100 | 309,444.00 | 0.09 |
| 340 | 603612 | 索通发展 | 16,800 | 308,784.00 | 0.09 |
| 341 | 600179 | 安通控股 | 111,600 | 308,016.00 | 0.09 |
| 342 | 600933 | 爱柯迪 | 19,200 | 307,392.00 | 0.09 |
| 343 | 600587 | 新华医疗 | 20,300 | 307,342.00 | 0.09 |
| 344 | 000035 | 中国天楹 | 71,600 | 307,164.00 | 0.09 |
| 345 | 000762 | 西藏矿业 | 16,000 | 306,880.00 | 0.09 |
| 346 | 603505 | 金石资源 | 14,100 | 306,252.00 | 0.09 |
| 347 | 601187 | 厦门银行 | 45,100 | 306,229.00 | 0.09 |
| 348 | 603583 | 捷昌驱动 | 8,300 | 303,116.00 | 0.09 |
| 349 | 002929 | 润建股份 | 6,400 | 302,464.00 | 0.09 |
| 350 | 300415 | 伊之密 | 15,000 | 302,250.00 | 0.09 |
| 351 | 600882 | 妙可蓝多 | 9,900 | 302,247.00 | 0.09 |
| 352 | 600649 | 城投控股 | 70,400 | 302,016.00 | 0.09 |
| 353 | 600063 | 皖维高新 | 65,800 | 301,364.00 | 0.09 |
| 354 | 603039 | 泛微网络 | 5,400 | 300,780.00 | 0.09 |
| 355 | 688016 | 心脉医疗 | 3,400 | 300,628.00 | 0.09 |
| 356 | 002011 | 盾安环境 | 25,900 | 300,440.00 | 0.09 |
| 357 | 002716 | 湖南白银 | 77,000 | 300,300.00 | 0.09 |
| 358 | 300618 | 寒锐钴业 | 8,400 | 300,048.00 | 0.09 |
| 359 | 300827 | 上能电气 | 9,800 | 299,390.00 | 0.09 |
| 360 | 002226 | 江南化工 | 51,600 | 299,280.00 | 0.09 |
| 361 | 300776 | 帝尔激光 | 5,600 | 297,976.00 | 0.09 |
| 362 | 688548 | 广钢气体 | 29,700 | 297,594.00 | 0.09 |
| 363 | 300360 | 炬华科技 | 18,800 | 296,100.00 | 0.08 |
| 364 | 002643 | 万润股份 | 25,700 | 295,807.00 | 0.08 |
| 365 | 603393 | 新天然气 | 10,200 | 295,290.00 | 0.08 |
| 366 | 601963 | 重庆银行 | 27,100 | 294,306.00 | 0.08 |
| 367 | 000758 | 中色股份 | 58,300 | 293,249.00 | 0.08 |
| 368 | 002541 | 鸿路钢构 | 17,500 | 292,950.00 | 0.08 |
| 369 | 600269 | 赣粤高速 | 57,600 | 291,456.00 | 0.08 |
| 370 | 002567 | 唐人神 | 61,200 | 291,312.00 | 0.08 |
| 371 | 300034 | 钢研高纳 | 17,500 | 291,025.00 | 0.08 |
| 372 | 601900 | 南方传媒 | 18,600 | 290,904.00 | 0.08 |
| 373 | 300224 | 正海磁材 | 20,400 | 288,660.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 374 | 301039 | 中集车辆 | 35,500 | 288,615.00 | 0.08 |
| 375 | 600459 | 贵研铂业 | 18,600 | 288,486.00 | 0.08 |
| 376 | 001301 | 尚太科技 | 5,900 | 287,684.00 | 0.08 |
| 377 | 301155 | 海力风电 | 4,000 | 287,600.00 | 0.08 |
| 378 | 688076 | 诺泰生物 | 7,700 | 286,594.00 | 0.08 |
| 379 | 600389 | 江山股份 | 15,400 | 286,440.00 | 0.08 |
| 380 | 600094 | 大名城 | 92,200 | 285,820.00 | 0.08 |
| 381 | 000089 | 深圳机场 | 41,400 | 285,660.00 | 0.08 |
| 382 | 600502 | 安徽建工 | 60,700 | 285,290.00 | 0.08 |
| 383 | 600782 | 新钢股份 | 80,400 | 284,616.00 | 0.08 |
| 384 | 002545 | 东方铁塔 | 31,800 | 282,702.00 | 0.08 |
| 385 | 300772 | 运达股份 | 21,900 | 282,072.00 | 0.08 |
| 386 | 002061 | 浙江交科 | 71,200 | 281,952.00 | 0.08 |
| 387 | 603871 | 嘉友国际 | 26,040 | 279,930.00 | 0.08 |
| 388 | 603337 | 杰克股份 | 7,800 | 279,864.00 | 0.08 |
| 389 | 688798 | 艾为电子 | 4,100 | 279,620.00 | 0.08 |
| 390 | 000810 | 创维数字 | 23,700 | 279,186.00 | 0.08 |
| 391 | 600458 | 时代新材 | 20,300 | 278,516.00 | 0.08 |
| 392 | 600835 | 上海机电 | 13,100 | 278,375.00 | 0.08 |
| 393 | 688612 | 威迈斯 | 10,400 | 278,096.00 | 0.08 |
| 394 | 002895 | 川恒股份 | 12,300 | 277,488.00 | 0.08 |
| 395 | 000923 | 河钢资源 | 20,000 | 276,800.00 | 0.08 |
| 396 | 600116 | 三峡水利 | 40,400 | 276,740.00 | 0.08 |
| 397 | 603100 | 川仪股份 | 13,400 | 276,442.00 | 0.08 |
| 398 | 300633 | 开立医疗 | 9,300 | 276,396.00 | 0.08 |
| 399 | 600428 | 中远海特 | 44,200 | 276,250.00 | 0.08 |
| 400 | 002125 | 湘潭电化 | 19,000 | 276,070.00 | 0.08 |
| 401 | 600643 | 爱建集团 | 37,200 | 276,024.00 | 0.08 |
| 402 | 688321 | 微芯生物 | 11,600 | 275,848.00 | 0.08 |
| 403 | 600866 | 星湖科技 | 39,900 | 275,709.00 | 0.08 |
| 404 | 002518 | 科士达 | 12,200 | 275,598.00 | 0.08 |
| 405 | 600248 | 陕建股份 | 72,200 | 275,082.00 | 0.08 |
| 406 | 300357 | 我武生物 | 13,300 | 274,512.00 | 0.08 |
| 407 | 002100 | 天康生物 | 44,300 | 274,217.00 | 0.08 |
| 408 | 000821 | 京山轻机 | 23,600 | 273,524.00 | 0.08 |
| 409 | 300482 | 万孚生物 | 12,800 | 273,280.00 | 0.08 |
| 410 | 001914 | 招商积余 | 22,000 | 272,140.00 | 0.08 |
| 411 | 603588 | 高能环境 | 48,100 | 271,284.00 | 0.08 |
| 412 | 002192 | 融捷股份 | 8,800 | 269,632.00 | 0.08 |
| 413 | 000603 | 盛达资源 | 18,100 | 269,509.00 | 0.08 |
| 414 | 600717 | 天津港 | 59,100 | 269,496.00 | 0.08 |
| 415 | 000429 | 粤高速 A | 20,200 | 269,266.00 | 0.08 |
| 416 | 002468 | 申通快递 | 25,100 | 268,319.00 | 0.08 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|--------|------------|------|
| 417 | 600507 | 方大特钢 | 61,700 | 267,778.00 | 0.08 |
| 418 | 301029 | 怡合达 | 11,700 | 267,462.00 | 0.08 |
| 419 | 000650 | 仁和药业 | 49,300 | 267,206.00 | 0.08 |
| 420 | 688789 | 宏华数科 | 3,658 | 267,180.32 | 0.08 |
| 421 | 600675 | 中华企业 | 92,700 | 266,976.00 | 0.08 |
| 422 | 603599 | 广信股份 | 25,000 | 266,750.00 | 0.08 |
| 423 | 002237 | 恒邦股份 | 22,600 | 266,680.00 | 0.08 |
| 424 | 601208 | 东材科技 | 28,000 | 265,440.00 | 0.08 |
| 425 | 600409 | 三友化工 | 54,600 | 265,356.00 | 0.08 |
| 426 | 600664 | 哈药股份 | 72,000 | 264,960.00 | 0.08 |
| 427 | 300470 | 中密控股 | 7,200 | 264,744.00 | 0.08 |
| 428 | 000829 | 天音控股 | 25,900 | 264,439.00 | 0.08 |
| 429 | 000065 | 北方国际 | 22,400 | 264,320.00 | 0.08 |
| 430 | 301291 | 明阳电气 | 6,400 | 263,360.00 | 0.08 |
| 431 | 000719 | 中原传媒 | 20,900 | 259,369.00 | 0.07 |
| 432 | 688131 | 皓元医药 | 5,357 | 259,010.95 | 0.07 |
| 433 | 002668 | TCL 智家 | 26,500 | 258,905.00 | 0.07 |
| 434 | 688739 | 成大生物 | 9,800 | 258,720.00 | 0.07 |
| 435 | 603358 | 华达科技 | 7,800 | 258,258.00 | 0.07 |
| 436 | 000029 | 深深房 A | 13,700 | 257,834.00 | 0.07 |
| 437 | 600773 | 西藏城投 | 25,600 | 257,536.00 | 0.07 |
| 438 | 603026 | 石大胜华 | 6,900 | 257,301.00 | 0.07 |
| 439 | 688091 | 上海谊众 | 5,500 | 257,290.00 | 0.07 |
| 440 | 002985 | 北摩高科 | 8,500 | 257,125.00 | 0.07 |
| 441 | 688779 | 五矿新能 | 47,200 | 256,768.00 | 0.07 |
| 442 | 688408 | 中信博 | 5,500 | 256,740.00 | 0.07 |
| 443 | 600623 | 华谊集团 | 33,700 | 255,109.00 | 0.07 |
| 444 | 601595 | 上海电影 | 8,600 | 254,904.00 | 0.07 |
| 445 | 002091 | 江苏国泰 | 34,800 | 252,996.00 | 0.07 |
| 446 | 605376 | 博迁新材 | 6,600 | 252,978.00 | 0.07 |
| 447 | 688700 | 东威科技 | 6,400 | 252,480.00 | 0.07 |
| 448 | 000012 | 南玻 A | 54,500 | 251,790.00 | 0.07 |
| 449 | 688696 | 极米科技 | 2,200 | 251,592.00 | 0.07 |
| 450 | 600211 | 西藏药业 | 6,800 | 250,376.00 | 0.07 |
| 451 | 688139 | 海尔生物 | 8,100 | 250,209.00 | 0.07 |
| 452 | 688326 | 经纬恒润 | 2,800 | 249,872.00 | 0.07 |
| 453 | 002081 | 金螳螂 | 72,400 | 248,332.00 | 0.07 |
| 454 | 300761 | 立华股份 | 13,200 | 248,028.00 | 0.07 |
| 455 | 603027 | 千禾味业 | 21,300 | 247,293.00 | 0.07 |
| 456 | 605507 | 国邦医药 | 12,500 | 247,125.00 | 0.07 |
| 457 | 603283 | 赛腾股份 | 7,280 | 247,083.20 | 0.07 |
| 458 | 002127 | 南极电商 | 62,200 | 246,934.00 | 0.07 |
| 459 | 600557 | 康缘药业 | 16,600 | 245,348.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 460 | 603281 | 江瀚新材 | 9,780 | 245,086.80 | 0.07 |
| 461 | 600888 | 新疆众和 | 35,500 | 242,110.00 | 0.07 |
| 462 | 300393 | 中来股份 | 41,900 | 241,344.00 | 0.07 |
| 463 | 002705 | 新宝股份 | 16,400 | 241,080.00 | 0.07 |
| 464 | 601369 | 陕鼓动力 | 27,400 | 240,298.00 | 0.07 |
| 465 | 600509 | 天富能源 | 37,000 | 238,650.00 | 0.07 |
| 466 | 603888 | 新华网 | 9,900 | 237,006.00 | 0.07 |
| 467 | 688522 | 纳睿雷达 | 4,620 | 236,636.40 | 0.07 |
| 468 | 600916 | 中国黄金 | 28,900 | 236,113.00 | 0.07 |
| 469 | 300580 | 贝斯特 | 9,600 | 235,872.00 | 0.07 |
| 470 | 300443 | 金雷股份 | 10,400 | 235,040.00 | 0.07 |
| 471 | 300171 | 东富龙 | 17,600 | 233,904.00 | 0.07 |
| 472 | 688598 | 金博股份 | 9,200 | 233,864.00 | 0.07 |
| 473 | 301219 | 腾远钴业 | 4,400 | 233,728.00 | 0.07 |
| 474 | 002925 | 盈趣科技 | 12,900 | 231,942.00 | 0.07 |
| 475 | 603171 | 税友股份 | 5,400 | 231,714.00 | 0.07 |
| 476 | 603279 | 景津装备 | 15,500 | 231,415.00 | 0.07 |
| 477 | 300463 | 迈克生物 | 19,400 | 230,860.00 | 0.07 |
| 478 | 688100 | 威胜信息 | 6,200 | 229,710.00 | 0.07 |
| 479 | 600531 | 豫光金铅 | 29,500 | 228,330.00 | 0.07 |
| 480 | 600751 | 海航科技 | 69,600 | 228,288.00 | 0.07 |
| 481 | 002434 | 万里扬 | 31,100 | 227,963.00 | 0.07 |
| 482 | 000735 | 罗牛山 | 36,900 | 227,673.00 | 0.07 |
| 483 | 600827 | 百联股份 | 24,900 | 227,586.00 | 0.07 |
| 484 | 603368 | 柳药集团 | 13,400 | 226,594.00 | 0.06 |
| 485 | 000913 | 钱江摩托 | 15,100 | 226,500.00 | 0.06 |
| 486 | 002588 | 史丹利 | 25,600 | 225,536.00 | 0.06 |
| 487 | 000848 | 承德露露 | 24,700 | 225,511.00 | 0.06 |
| 488 | 688106 | 金宏气体 | 12,600 | 225,414.00 | 0.06 |
| 489 | 688639 | 华恒生物 | 7,100 | 225,070.00 | 0.06 |
| 490 | 601952 | 苏垦农发 | 22,800 | 225,036.00 | 0.06 |
| 491 | 600012 | 皖通高速 | 13,200 | 224,136.00 | 0.06 |
| 492 | 002458 | 益生股份 | 27,400 | 223,858.00 | 0.06 |
| 493 | 000928 | 中钢国际 | 35,600 | 223,568.00 | 0.06 |
| 494 | 300416 | 苏试试验 | 15,600 | 223,548.00 | 0.06 |
| 495 | 603033 | 三维股份 | 19,900 | 223,079.00 | 0.06 |
| 496 | 688352 | 颀中科技 | 19,800 | 222,354.00 | 0.06 |
| 497 | 688531 | 日联科技 | 3,100 | 221,960.00 | 0.06 |
| 498 | 300596 | 利安隆 | 7,700 | 221,529.00 | 0.06 |
| 499 | 002108 | 沧州明珠 | 57,300 | 221,178.00 | 0.06 |
| 500 | 600648 | 外高桥 | 20,200 | 220,786.00 | 0.06 |
| 501 | 601200 | 上海环境 | 27,700 | 219,938.00 | 0.06 |
| 502 | 000028 | 国药一致 | 8,800 | 219,384.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 503 | 600123 | 兰花科创 | 33,500 | 218,420.00 | 0.06 |
| 504 | 600597 | 光明乳业 | 25,900 | 217,819.00 | 0.06 |
| 505 | 300129 | 泰胜风能 | 30,600 | 217,566.00 | 0.06 |
| 506 | 000090 | 天健集团 | 61,400 | 217,356.00 | 0.06 |
| 507 | 600305 | 恒顺醋业 | 27,900 | 215,667.00 | 0.06 |
| 508 | 600125 | 铁龙物流 | 38,100 | 215,646.00 | 0.06 |
| 509 | 002461 | 珠江啤酒 | 19,100 | 215,639.00 | 0.06 |
| 510 | 601949 | 中国出版 | 32,200 | 213,808.00 | 0.06 |
| 511 | 688575 | 亚辉龙 | 14,600 | 213,014.00 | 0.06 |
| 512 | 688006 | 杭可科技 | 10,900 | 212,550.00 | 0.06 |
| 513 | 600729 | 重庆百货 | 7,100 | 211,793.00 | 0.06 |
| 514 | 301071 | 力量钻石 | 7,100 | 211,651.00 | 0.06 |
| 515 | 603305 | 旭升集团 | 16,200 | 211,410.00 | 0.06 |
| 516 | 600313 | 农发种业 | 33,700 | 210,962.00 | 0.06 |
| 517 | 688559 | 海目星 | 6,400 | 210,560.00 | 0.06 |
| 518 | 002219 | 新里程 | 95,500 | 210,100.00 | 0.06 |
| 519 | 002967 | 广电计量 | 11,900 | 209,321.00 | 0.06 |
| 520 | 002274 | 华昌化工 | 28,700 | 208,936.00 | 0.06 |
| 521 | 000950 | 重药控股 | 41,800 | 208,582.00 | 0.06 |
| 522 | 688556 | 高测股份 | 28,980 | 208,076.40 | 0.06 |
| 523 | 601163 | 三角轮胎 | 14,800 | 207,940.00 | 0.06 |
| 524 | 600976 | 健民集团 | 5,300 | 207,813.00 | 0.06 |
| 525 | 601869 | 长飞光纤 | 5,100 | 207,672.00 | 0.06 |
| 525 | 688702 | 盛科通信 | 3,400 | 207,672.00 | 0.06 |
| 526 | 002928 | 华夏航空 | 24,900 | 206,919.00 | 0.06 |
| 527 | 603995 | 甬金股份 | 11,700 | 206,856.00 | 0.06 |
| 528 | 600395 | 盘江股份 | 43,700 | 206,701.00 | 0.06 |
| 529 | 002051 | 中工国际 | 23,900 | 206,257.00 | 0.06 |
| 530 | 000930 | 中粮科技 | 36,400 | 203,112.00 | 0.06 |
| 531 | 603713 | 密尔克卫 | 3,800 | 202,616.00 | 0.06 |
| 532 | 600033 | 福建高速 | 57,000 | 201,780.00 | 0.06 |
| 533 | 603638 | 艾迪精密 | 11,500 | 201,135.00 | 0.06 |
| 534 | 688300 | 联瑞新材 | 4,300 | 200,165.00 | 0.06 |
| 535 | 002101 | 广东鸿图 | 16,000 | 200,160.00 | 0.06 |
| 536 | 688146 | 中船特气 | 6,900 | 199,479.00 | 0.06 |
| 537 | 002960 | 青鸟消防 | 20,400 | 199,308.00 | 0.06 |
| 538 | 600073 | 光明肉业 | 27,000 | 199,260.00 | 0.06 |
| 539 | 601969 | 海南矿业 | 27,400 | 198,650.00 | 0.06 |
| 540 | 688690 | 纳微科技 | 8,700 | 198,621.00 | 0.06 |
| 541 | 000552 | 甘肃能化 | 80,300 | 198,341.00 | 0.06 |
| 542 | 301510 | 固高科技 | 6,600 | 198,330.00 | 0.06 |
| 543 | 002585 | 双星新材 | 36,300 | 198,198.00 | 0.06 |
| 544 | 603008 | 喜临门 | 11,300 | 197,524.00 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 545 | 600335 | 国机汽车 | 30,600 | 197,370.00 | 0.06 |
| 546 | 601500 | 通用股份 | 42,800 | 197,308.00 | 0.06 |
| 547 | 600477 | 杭萧钢构 | 74,400 | 197,160.00 | 0.06 |
| 548 | 600710 | 苏美达 | 20,500 | 197,005.00 | 0.06 |
| 549 | 600639 | 浦东金桥 | 18,600 | 196,974.00 | 0.06 |
| 550 | 000718 | 苏宁环球 | 90,200 | 195,734.00 | 0.06 |
| 551 | 600586 | 金晶科技 | 40,000 | 193,200.00 | 0.06 |
| 552 | 000498 | 山东路桥 | 32,800 | 192,864.00 | 0.06 |
| 553 | 601921 | 浙版传媒 | 23,900 | 192,634.00 | 0.06 |
| 554 | 601619 | 嘉泽新能 | 53,800 | 192,604.00 | 0.06 |
| 555 | 601702 | 华峰铝业 | 12,100 | 192,269.00 | 0.06 |
| 556 | 002987 | 京北方 | 9,200 | 191,820.00 | 0.05 |
| 557 | 002737 | 葵花药业 | 12,200 | 191,784.00 | 0.05 |
| 558 | 601609 | 金田股份 | 27,200 | 190,672.00 | 0.05 |
| 559 | 002755 | 奥赛康 | 11,900 | 190,162.00 | 0.05 |
| 560 | 688366 | 昊海生科 | 3,700 | 189,588.00 | 0.05 |
| 561 | 603866 | 桃李面包 | 34,800 | 187,920.00 | 0.05 |
| 562 | 600475 | 华光环能 | 18,000 | 187,560.00 | 0.05 |
| 563 | 688147 | 微导纳米 | 6,200 | 187,116.00 | 0.05 |
| 564 | 000550 | 江铃汽车 | 9,200 | 187,036.00 | 0.05 |
| 565 | 605333 | 沪光股份 | 6,800 | 186,660.00 | 0.05 |
| 566 | 601326 | 秦港股份 | 57,700 | 186,371.00 | 0.05 |
| 567 | 002043 | 兔宝宝 | 18,900 | 185,220.00 | 0.05 |
| 568 | 688190 | 云路股份 | 2,000 | 185,120.00 | 0.05 |
| 569 | 601096 | 宏盛华源 | 44,400 | 183,816.00 | 0.05 |
| 570 | 600810 | 神马股份 | 19,600 | 183,652.00 | 0.05 |
| 571 | 002233 | 塔牌集团 | 24,800 | 183,520.00 | 0.05 |
| 572 | 003006 | 百亚股份 | 6,700 | 183,446.00 | 0.05 |
| 573 | 600138 | 中青旅 | 18,600 | 183,210.00 | 0.05 |
| 574 | 603093 | 南华期货 | 8,200 | 183,106.00 | 0.05 |
| 575 | 002060 | 广东建工 | 52,500 | 182,700.00 | 0.05 |
| 576 | 603733 | 仙鹤股份 | 8,800 | 182,512.00 | 0.05 |
| 577 | 300913 | 兆龙互连 | 3,840 | 179,788.80 | 0.05 |
| 578 | 002832 | 比音勒芬 | 11,200 | 179,760.00 | 0.05 |
| 579 | 300257 | 开山股份 | 17,800 | 179,246.00 | 0.05 |
| 580 | 605123 | 派克新材 | 2,300 | 179,170.00 | 0.05 |
| 581 | 600740 | 山西焦化 | 48,200 | 178,822.00 | 0.05 |
| 582 | 300428 | 立中集团 | 9,800 | 178,556.00 | 0.05 |
| 583 | 600657 | 信达地产 | 45,900 | 178,551.00 | 0.05 |
| 584 | 002390 | 信邦制药 | 51,300 | 178,524.00 | 0.05 |
| 585 | 688631 | 莱斯信息 | 2,000 | 178,400.00 | 0.05 |
| 586 | 300855 | 图南股份 | 7,500 | 178,350.00 | 0.05 |
| 587 | 603915 | 国茂股份 | 12,200 | 177,388.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 588 | 002158 | 汉钟精机 | 10,200 | 177,276.00 | 0.05 |
| 589 | 001287 | 中电港 | 9,600 | 175,776.00 | 0.05 |
| 590 | 603919 | 金徽酒 | 9,700 | 175,570.00 | 0.05 |
| 591 | 300861 | 美畅股份 | 8,600 | 174,838.00 | 0.05 |
| 592 | 603025 | 大豪科技 | 12,400 | 173,848.00 | 0.05 |
| 593 | 603229 | 奥翔药业 | 19,900 | 173,528.00 | 0.05 |
| 594 | 605599 | 菜百股份 | 10,600 | 173,310.00 | 0.05 |
| 595 | 688097 | 博众精工 | 6,200 | 173,042.00 | 0.05 |
| 596 | 600195 | 中牧股份 | 23,600 | 172,988.00 | 0.05 |
| 597 | 000048 | 京基智农 | 10,800 | 171,720.00 | 0.05 |
| 598 | 002034 | 旺能环境 | 10,200 | 171,258.00 | 0.05 |
| 599 | 000061 | 农产品 | 26,800 | 171,252.00 | 0.05 |
| 600 | 300492 | 华图山鼎 | 2,520 | 171,057.60 | 0.05 |
| 601 | 601827 | 三峰环境 | 20,200 | 169,680.00 | 0.05 |
| 602 | 002320 | 海峡股份 | 25,900 | 169,386.00 | 0.05 |
| 603 | 601101 | 昊华能源 | 23,200 | 167,968.00 | 0.05 |
| 604 | 002243 | 力合科创 | 20,500 | 167,280.00 | 0.05 |
| 605 | 600197 | 伊力特 | 11,100 | 165,612.00 | 0.05 |
| 606 | 600163 | 中闽能源 | 32,300 | 165,376.00 | 0.05 |
| 607 | 688432 | 有研硅 | 14,900 | 164,496.00 | 0.05 |
| 608 | 300926 | 博俊科技 | 6,200 | 164,114.00 | 0.05 |
| 609 | 603876 | 鼎胜新材 | 18,000 | 163,620.00 | 0.05 |
| 610 | 605020 | 永和股份 | 7,100 | 163,584.00 | 0.05 |
| 611 | 688392 | 骄成超声 | 2,400 | 163,512.00 | 0.05 |
| 612 | 002941 | 新疆交建 | 14,400 | 160,416.00 | 0.05 |
| 613 | 603983 | 丸美生物 | 3,800 | 160,094.00 | 0.05 |
| 614 | 600971 | 恒源煤电 | 24,000 | 158,400.00 | 0.05 |
| 615 | 001213 | 中铁特货 | 38,700 | 157,122.00 | 0.05 |
| 616 | 300856 | 科思股份 | 10,360 | 156,954.00 | 0.04 |
| 617 | 600020 | 中原高速 | 32,800 | 156,784.00 | 0.04 |
| 618 | 688261 | 东微半导 | 3,800 | 156,750.00 | 0.04 |
| 619 | 300151 | 昌红科技 | 12,700 | 156,337.00 | 0.04 |
| 620 | 002833 | 弘亚数控 | 9,500 | 155,420.00 | 0.04 |
| 621 | 301216 | 万凯新材 | 12,400 | 154,628.00 | 0.04 |
| 622 | 002511 | 中顺洁柔 | 22,900 | 153,888.00 | 0.04 |
| 623 | 600217 | 中再资环 | 34,300 | 153,664.00 | 0.04 |
| 624 | 688586 | 江航装备 | 13,600 | 153,000.00 | 0.04 |
| 625 | 002053 | 云南能投 | 13,700 | 150,837.00 | 0.04 |
| 626 | 600861 | 北京人力 | 7,800 | 150,540.00 | 0.04 |
| 627 | 688298 | 东方生物 | 5,500 | 150,425.00 | 0.04 |
| 628 | 688348 | 昱能科技 | 3,500 | 150,395.00 | 0.04 |
| 629 | 000088 | 盐田港 | 33,100 | 149,943.00 | 0.04 |
| 630 | 000935 | 四川双马 | 8,200 | 149,404.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 631 | 301087 | 可孚医疗 | 4,500 | 149,400.00 | 0.04 |
| 632 | 002901 | 大博医疗 | 4,100 | 148,584.00 | 0.04 |
| 633 | 000915 | 华特达因 | 4,200 | 148,470.00 | 0.04 |
| 634 | 000030 | 富奥股份 | 25,100 | 147,839.00 | 0.04 |
| 635 | 688549 | 中巨芯 | 19,100 | 147,834.00 | 0.04 |
| 636 | 600963 | 岳阳林纸 | 33,300 | 147,519.00 | 0.04 |
| 637 | 002191 | 劲嘉股份 | 36,100 | 147,288.00 | 0.04 |
| 638 | 600987 | 航民股份 | 20,800 | 147,056.00 | 0.04 |
| 639 | 601107 | 四川成渝 | 24,400 | 146,888.00 | 0.04 |
| 640 | 605368 | 蓝天燃气 | 14,800 | 145,632.00 | 0.04 |
| 641 | 688439 | 振华风光 | 2,500 | 145,625.00 | 0.04 |
| 642 | 603043 | 广州酒家 | 9,300 | 144,894.00 | 0.04 |
| 643 | 301047 | 义翘神州 | 2,100 | 143,010.00 | 0.04 |
| 644 | 002216 | 三全食品 | 12,900 | 142,803.00 | 0.04 |
| 645 | 600508 | 上海能源 | 12,200 | 142,740.00 | 0.04 |
| 646 | 601038 | 一拖股份 | 10,900 | 142,463.00 | 0.04 |
| 647 | 002446 | 盛路通信 | 19,300 | 142,434.00 | 0.04 |
| 648 | 601882 | 海天精工 | 7,400 | 141,340.00 | 0.04 |
| 649 | 600997 | 开滦股份 | 23,900 | 140,771.00 | 0.04 |
| 650 | 600783 | 鲁信创投 | 11,200 | 140,000.00 | 0.04 |
| 651 | 301327 | 华宝新能 | 2,700 | 138,672.00 | 0.04 |
| 652 | 688389 | 普门科技 | 10,700 | 138,244.00 | 0.04 |
| 653 | 300741 | 华宝股份 | 7,300 | 137,897.00 | 0.04 |
| 654 | 603317 | 天味食品 | 12,400 | 137,888.00 | 0.04 |
| 655 | 600966 | 博汇纸业 | 31,000 | 137,020.00 | 0.04 |
| 656 | 603566 | 普莱柯 | 10,000 | 136,100.00 | 0.04 |
| 657 | 000589 | 贵州轮胎 | 29,100 | 132,987.00 | 0.04 |
| 658 | 000672 | 上峰水泥 | 16,800 | 132,720.00 | 0.04 |
| 659 | 300702 | 天宇股份 | 5,700 | 132,582.00 | 0.04 |
| 660 | 300841 | 康华生物 | 2,000 | 131,940.00 | 0.04 |
| 661 | 600449 | 宁夏建材 | 10,000 | 131,600.00 | 0.04 |
| 662 | 002096 | 易普力 | 10,600 | 131,546.00 | 0.04 |
| 663 | 002041 | 登海种业 | 13,400 | 131,186.00 | 0.04 |
| 664 | 002959 | 小熊电器 | 2,800 | 130,032.00 | 0.04 |
| 665 | 301207 | 华兰疫苗 | 7,700 | 129,822.00 | 0.04 |
| 666 | 002534 | 西子洁能 | 11,500 | 129,260.00 | 0.04 |
| 667 | 688105 | 诺唯赞 | 5,700 | 128,991.00 | 0.04 |
| 668 | 688337 | 普源精电 | 3,600 | 128,412.00 | 0.04 |
| 669 | 000885 | 城发环境 | 9,600 | 127,872.00 | 0.04 |
| 670 | 002840 | 华统股份 | 12,100 | 125,961.00 | 0.04 |
| 671 | 601033 | 永兴股份 | 7,900 | 124,899.00 | 0.04 |
| 672 | 300363 | 博腾股份 | 7,300 | 124,684.00 | 0.04 |
| 673 | 688315 | 诺禾致源 | 8,800 | 124,256.00 | 0.04 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 674 | 601515 | 东峰集团 | 32,500 | 124,150.00 | 0.04 |
| 675 | 600548 | 深高速 | 11,800 | 123,546.00 | 0.04 |
| 676 | 300737 | 科顺股份 | 25,600 | 123,392.00 | 0.04 |
| 677 | 002154 | 报喜鸟 | 32,800 | 123,328.00 | 0.04 |
| 678 | 603355 | 莱克电气 | 5,500 | 123,310.00 | 0.04 |
| 679 | 603227 | 雪峰科技 | 14,700 | 123,186.00 | 0.04 |
| 680 | 688177 | 百奥泰 | 4,900 | 122,794.00 | 0.04 |
| 681 | 603301 | 振德医疗 | 5,800 | 122,438.00 | 0.04 |
| 682 | 603609 | 禾丰股份 | 14,800 | 122,248.00 | 0.04 |
| 683 | 003009 | 中天火箭 | 2,400 | 121,416.00 | 0.03 |
| 684 | 002946 | 新乳业 | 6,400 | 120,128.00 | 0.03 |
| 685 | 603730 | 岱美股份 | 21,060 | 119,831.40 | 0.03 |
| 686 | 688185 | 康希诺 | 2,000 | 119,260.00 | 0.03 |
| 687 | 688001 | 华兴源创 | 4,700 | 118,769.00 | 0.03 |
| 688 | 300726 | 宏达电子 | 3,300 | 117,975.00 | 0.03 |
| 689 | 002242 | 九阳股份 | 12,400 | 117,800.00 | 0.03 |
| 690 | 603439 | 贵州三力 | 10,100 | 117,766.00 | 0.03 |
| 691 | 688433 | 华曙高科 | 3,200 | 117,600.00 | 0.03 |
| 692 | 000869 | 张裕 A | 5,500 | 116,765.00 | 0.03 |
| 693 | 600017 | 日照港 | 36,700 | 113,770.00 | 0.03 |
| 694 | 002302 | 西部建设 | 19,600 | 113,680.00 | 0.03 |
| 695 | 301268 | 铭利达 | 6,000 | 111,300.00 | 0.03 |
| 696 | 301004 | 嘉益股份 | 1,680 | 111,266.40 | 0.03 |
| 697 | 603013 | 亚普股份 | 6,400 | 110,592.00 | 0.03 |
| 698 | 002327 | 富安娜 | 14,900 | 110,558.00 | 0.03 |
| 699 | 601015 | 陕西黑猫 | 33,600 | 110,208.00 | 0.03 |
| 700 | 603489 | 八方股份 | 4,000 | 108,560.00 | 0.03 |
| 701 | 601886 | 江河集团 | 17,600 | 108,240.00 | 0.03 |
| 702 | 000761 | 本钢板材 | 29,700 | 106,920.00 | 0.03 |
| 703 | 688526 | 科前生物 | 6,800 | 105,944.00 | 0.03 |
| 704 | 603055 | 台华新材 | 11,600 | 105,908.00 | 0.03 |
| 705 | 003012 | 东鹏控股 | 18,400 | 105,248.00 | 0.03 |
| 706 | 301069 | 凯盛新材 | 6,500 | 104,715.00 | 0.03 |
| 707 | 002978 | 安宁股份 | 3,300 | 104,214.00 | 0.03 |
| 708 | 001308 | 康冠科技 | 4,600 | 104,052.00 | 0.03 |
| 709 | 600618 | 氯碱化工 | 10,800 | 104,004.00 | 0.03 |
| 710 | 603348 | 文灿股份 | 4,900 | 102,312.00 | 0.03 |
| 711 | 605296 | 神农集团 | 3,300 | 101,442.00 | 0.03 |
| 712 | 300869 | 康泰医学 | 6,900 | 98,946.00 | 0.03 |
| 713 | 600894 | 广日股份 | 9,400 | 98,606.00 | 0.03 |
| 714 | 301376 | 致欧科技 | 5,400 | 98,550.00 | 0.03 |
| 715 | 600662 | 外服控股 | 19,100 | 97,601.00 | 0.03 |
| 716 | 605116 | 奥锐特 | 4,600 | 96,140.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 717 | 603801 | 志邦家居 | 9,900 | 95,931.00 | 0.03 |
| 718 | 301590 | 优优绿能 | 608 | 95,924.35 | 0.03 |
| 719 | 002726 | 龙大美食 | 16,400 | 95,448.00 | 0.03 |
| 720 | 605222 | 起帆电缆 | 6,200 | 93,868.00 | 0.03 |
| 721 | 603530 | 神马电力 | 3,600 | 93,312.00 | 0.03 |
| 722 | 301589 | 诺瓦星云 | 600 | 87,198.00 | 0.02 |
| 723 | 001389 | 广合科技 | 1,300 | 76,401.00 | 0.02 |
| 724 | 300755 | 华致酒行 | 3,700 | 71,410.00 | 0.02 |
| 725 | 603719 | 良品铺子 | 5,500 | 66,825.00 | 0.02 |
| 726 | 605365 | 立达信 | 4,500 | 66,285.00 | 0.02 |
| 727 | 688128 | 中国电研 | 2,700 | 66,150.00 | 0.02 |
| 728 | 003039 | 顺控发展 | 4,800 | 65,088.00 | 0.02 |
| 729 | 603219 | 富佳股份 | 4,400 | 63,844.00 | 0.02 |
| 730 | 605011 | 杭州热电 | 2,700 | 60,318.00 | 0.02 |
| 731 | 603877 | 太平鸟 | 4,000 | 58,000.00 | 0.02 |
| 732 | 603049 | 中策橡胶 | 1,206 | 53,879.65 | 0.02 |
| 733 | 603271 | 永杰新材 | 1,226 | 44,166.23 | 0.01 |
| 734 | 688411 | 海博思创 | 469 | 39,156.81 | 0.01 |
| 735 | 688775 | 影石创新 | 221 | 27,439.36 | 0.01 |
| 736 | 301458 | 钧崴电子 | 701 | 23,911.11 | 0.01 |
| 737 | 688545 | 兴福电子 | 796 | 21,452.20 | 0.01 |
| 738 | 688583 | 思看科技 | 227 | 18,087.36 | 0.01 |
| 739 | 301602 | 超研股份 | 658 | 16,318.40 | 0.00 |
| 740 | 001388 | 信通电子 | 937 | 15,385.54 | 0.00 |
| 741 | 301479 | 弘景光电 | 182 | 14,172.34 | 0.00 |
| 742 | 688757 | 胜科纳米 | 536 | 13,903.84 | 0.00 |
| 743 | 688758 | 赛分科技 | 777 | 13,185.69 | 0.00 |
| 744 | 603072 | 天和磁材 | 225 | 12,251.25 | 0.00 |
| 745 | 301662 | 宏工科技 | 143 | 11,797.50 | 0.00 |
| 746 | 301601 | 惠通科技 | 342 | 11,576.70 | 0.00 |
| 747 | 301658 | 首航新能 | 437 | 10,042.26 | 0.00 |
| 748 | 301501 | 恒鑫生活 | 222 | 10,038.84 | 0.00 |
| 749 | 001356 | 富岭股份 | 663 | 9,573.72 | 0.00 |
| 750 | 301665 | 泰禾股份 | 393 | 8,799.27 | 0.00 |
| 751 | 688755 | 汉邦科技 | 203 | 7,983.99 | 0.00 |
| 752 | 301173 | 毓恬冠佳 | 173 | 7,781.54 | 0.00 |
| 753 | 001382 | 新亚电缆 | 366 | 7,396.86 | 0.00 |
| 754 | 301636 | 泽润新能 | 128 | 6,074.88 | 0.00 |
| 755 | 301595 | 太力科技 | 196 | 5,703.60 | 0.00 |
| 756 | 301560 | 众捷汽车 | 190 | 5,215.50 | 0.00 |
| 757 | 603210 | 泰鸿万立 | 286 | 4,464.46 | 0.00 |
| 758 | 603014 | 威高血净 | 134 | 4,379.12 | 0.00 |
| 759 | 603124 | 江南新材 | 88 | 4,075.28 | 0.00 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 760 | 001395 | 亚联机械 | 80 | 3,780.00 | 0.00 |
| 761 | 603202 | 天有为 | 41 | 3,717.06 | 0.00 |
| 762 | 603409 | 汇通控股 | 98 | 3,265.36 | 0.00 |
| 763 | 001390 | 古麒绒材 | 178 | 3,225.36 | 0.00 |
| 764 | 603400 | 华之杰 | 57 | 2,497.17 | 0.00 |
| 765 | 603382 | 海阳科技 | 105 | 2,350.95 | 0.00 |
| 766 | 001335 | 信凯科技 | 80 | 2,244.00 | 0.00 |
| 767 | 603120 | 肯特催化 | 65 | 2,172.95 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 002456 | 欧菲光 | 4,976,702.00 | 1.54 |
| 2 | 002123 | 梦网科技 | 3,894,051.00 | 1.20 |
| 3 | 600757 | 长江传媒 | 3,014,523.00 | 0.93 |
| 4 | 002036 | 联创电子 | 2,908,178.00 | 0.90 |
| 5 | 300525 | 博思软件 | 2,724,023.00 | 0.84 |
| 6 | 300687 | 赛意信息 | 2,491,124.00 | 0.77 |
| 7 | 300075 | 数字政通 | 2,452,594.00 | 0.76 |
| 8 | 002396 | 星网锐捷 | 2,414,682.00 | 0.75 |
| 9 | 300634 | 彩讯股份 | 2,399,172.00 | 0.74 |
| 10 | 002654 | 万润科技 | 2,354,046.00 | 0.73 |
| 11 | 002063 | 远光软件 | 2,326,761.00 | 0.72 |
| 12 | 300031 | 宝通科技 | 2,279,690.00 | 0.70 |
| 13 | 600996 | 贵广网络 | 2,257,207.00 | 0.70 |
| 14 | 688083 | 中望软件 | 2,248,771.59 | 0.69 |
| 15 | 688568 | 中科星图 | 2,227,945.40 | 0.69 |
| 16 | 301050 | 雷电微力 | 2,217,297.00 | 0.68 |
| 17 | 688206 | 概伦电子 | 2,189,390.80 | 0.68 |
| 18 | 300679 | 电连技术 | 2,075,006.00 | 0.64 |
| 19 | 603005 | 晶方科技 | 2,037,358.00 | 0.63 |
| 20 | 300568 | 星源材质 | 1,992,167.00 | 0.61 |

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 688426 | 康为世纪 | 5,175,268.65 | 1.60 |
| 2 | 001283 | 豪鹏科技 | 5,014,033.87 | 1.55 |
| 3 | 688307 | 中润光学 | 4,190,557.45 | 1.29 |
| 4 | 002123 | 梦网科技 | 4,059,081.00 | 1.25 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 5 | 688665 | 四方光电 | 4,035,649.32 | 1.25 |
| 6 | 300986 | 志特新材 | 3,994,131.78 | 1.23 |
| 7 | 688533 | 上声电子 | 3,956,489.13 | 1.22 |
| 8 | 603600 | 永艺股份 | 3,822,339.00 | 1.18 |
| 9 | 002768 | 国恩股份 | 3,734,550.00 | 1.15 |
| 10 | 688162 | 巨一科技 | 3,734,265.32 | 1.15 |
| 11 | 300515 | 三德科技 | 3,730,361.00 | 1.15 |
| 12 | 605166 | 聚合顺 | 3,702,808.74 | 1.14 |
| 13 | 603173 | 福斯达 | 3,676,714.65 | 1.13 |
| 14 | 002456 | 欧菲光 | 3,671,936.00 | 1.13 |
| 15 | 603890 | 春秋电子 | 3,558,072.00 | 1.10 |
| 16 | 688219 | 会通股份 | 3,500,980.75 | 1.08 |
| 17 | 688768 | 容知日新 | 3,433,427.70 | 1.06 |
| 18 | 688663 | 新风光 | 3,426,367.93 | 1.06 |
| 19 | 688369 | 致远互联 | 3,412,710.92 | 1.05 |
| 20 | 688045 | 必易微 | 3,410,645.71 | 1.05 |

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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 | 496,656,708.03 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 476,582,584.22 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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投资。

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投资。

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投资。

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投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在股指期货投资中将以控制风险为原则，以套期保值为目的，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，并按照中国金融期货交易所套期保值管理的有关规定执行。

本基金的股指期货投资基于市场系统风险模型的中短期风险判断，在预测市场风险较大时，应用择时对冲策略，即在保有股票头寸不变的情况下或者逐步降低仓位后，在市场面临下跌时择机卖出期指合约进行套期保值，当股市好转之后再将期指合约空单平仓。当市场向好时，管理人可择机在股指期货市场建立能够使得组合 β 值稳定的头寸从而避免现货快速建仓带来的流动性冲击，然后在保持组合风险敞口不变的前提下，在缓慢的现货市场建仓过程中有节奏地将期货头寸逐步平仓，充分利用股指期货提高资金使用效率。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金的基金合同约定，本基金的投资范围不包括国债期货。

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

电广传媒

于 2025 年 5 月 16 日收到湖南证监局[2025]13 号，在对湖南电广传媒股份有限公司现场检查中，发现公司存在如下问题：一是关联交易未披露。公司未披露 2021 年至 2024 年与控股股东湖南广播影视集团有限公司对深圳市达晨创鸿私募股权投资基金企业（合伙企业）、深圳市达晨创程私募股权投资基金企业（合伙企业）的共同投资行为。二是存货跌价准备计提不谨慎。子公司华丰达有线网络控股有限公司在 2021 年未审慎计提部分影片存货的跌价准备。对湖南电广传媒股份有限公司采取责令改正的行政监管措施，对王艳忠、付维刚、谭北京采取出具警示函的行政监管措施，并记入证券期货市场诚信档案。

东方国信

2024-09-24，北京证监局对管连平、霍卫平采取出具警示函的行政监管措施。作为北京东方国信科技股份有限公司(以下简称东方国信)的实控人，承诺在内蒙古数据中心项目建设完成正式运营之日或 2023 年 12 月 31 日二者孰早之日前，将持有的宁波梅山保税港区德昂投资合伙企业(有限合伙)和北京德昂世纪科技发展有限公司的合伙份额/股权及其他权益全部进行转让给东方国信或无关联第三方。截至 2023 年 12 月 31 日，上述承诺未履行完毕。上述行为构成《上市公司监管指引第 4 号——上市公司及其相关方承诺》第十五条规定的违反承诺的行为。

2024-08-26，北京证监局对北京东方国信科技股份有限公司、肖宝玉、刘彦斐采取出具警示

函监管措施的决定。2021 年 8 月 5 日,北京东方国信科技股份有限公司(以下简称公司)召开 2021 年第三次临时股东大会,审议通过《关于使用部分闲置募集资金和自有资金进行现金管理的议案》,同意公司在保证募集资金项目及资金安全的前提下,使用不超过人民币 5.5 亿元额度的闲置募集资金进行现金管理,决议有效期自股东大会审议通过之日起 24 个月。上述决议于 2021 年 8 月 5 日公告。经查,截至 2024 年 2 月 23 日,公司存在超授权期限对闲募集资金进行现金管理的情形。

本公司对以上证券的投资决策程序符合法律法规及公司制度的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为。除此之外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未被监管部门立案调查,且在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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

本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位: 人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 65,707.32 |
| 2 | 应收清算款 | 13,640.21 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 17,694.83 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 97,042.36 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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

| 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 (%) |
|-------|-----------|------|------------|----------------|------------|
| 7,892 | 43,458.41 | 0.00 | 0.00 | 342,973,808.97 | 100.00 |

8.2 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 | 0.00 | 0.0000 |

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

| 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 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2015年4月9日) | 8,097,969,485.94 |
| 基金份额总额 | |
| 本报告期期初基金份额总额 | 356,950,080.39 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,763,475.71 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 15,739,747.13 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 342,973,808.97 |

注：总申购份额包含红利再投、转换入份额，总赎回份额包含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管人基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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未发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

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 (%) | |
| 招商证券 | 1 | 304,043,816 .03 | 31.29 | 135,569.59 | 31.29 | — |
| 华安证券 | 2 | 275,383,475 .36 | 28.34 | 122,793.93 | 28.34 | — |
| 广发证券 | 2 | 241,362,653 .38 | 24.84 | 107,624.84 | 24.84 | — |
| 华龙证券 | 2 | 84,925,714. 28 | 8.74 | 37,868.14 | 8.74 | — |
| 中信建投 证券 | 3 | 56,752,304. 68 | 5.84 | 25,305.63 | 5.84 | — |
| 长江证券 | 2 | 9,086,960.3 3 | 0.94 | 4,051.89 | 0.94 | — |
| 东北证券 | 1 | — | — | — | — | — |
| 东方财富 证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 东吴证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 国联民生 | 2 | — | — | — | — | — |
| 国盛证券 | 1 | — | — | — | — | — |
| 国泰海通 | 3 | — | — | — | — | — |
| 国投证券 | 1 | — | — | — | — | — |
| 国元证券 | 1 | — | — | — | — | — |
| 华泰证券 | 1 | — | — | — | — | — |
| 华西证券 | 2 | — | — | — | — | — |
| 申万宏源 证券 | 1 | — | — | — | — | — |

| | | | | | | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 首创证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1. 交易单元的选择标准和程序：

- 1) 在资质上，要求证券公司财务状况良好，经营行为规范，具备较强的合规风控能力和交易、研究等服务能力；
- 2) 证券公司从基本情况、研究服务能力、综合服务能力等维度接受本基金管理人进行的服务评价；
- 3) 对于按照前述标准进行评价后达到本基金管理人要求的证券公司，本基金管理人可向其租用交易单元；
- 4) 租用交易单元前，本基金管理人将与证券公司签订交易单元租用协议，协议内容包括但不限于双方的权利义务、服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式等。

2. 本基金本报告期内新增西南证券 1 个交易单元，退租中银证券 2 个交易单元、万联证券 1 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(%) |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华安证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华龙证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国联民生 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|--------|---|---|---|---|---|---|
| 国泰海通 | - | - | - | - | - | - |
| 国投证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国元证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华西证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源证券 | - | - | - | - | - | - |
| 首创证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 华商基金管理有限公司旗下基金 2024年第四季度报告提示性公告 | 公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025年1月22日 |
| 2 | 华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 1 月 22 日 |
| 3 | 华商基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告 | 公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 4 | 华商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7月1日至2024年12月31日） | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 5 | 华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 3 月 31 日 |
| 6 | 华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025 年 4 月 8 日 |
| 7 | 华商基金管理有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告提示性公告 | 公司网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 8 | 华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站 | 2025 年 4 月 22 日 |
| 9 | 华商基金管理有限公司关于旗下部分基金参加麦高证券有限责任公司申购费率优惠活动的公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025 年 5 月 14 日 |

| | | | |
|----|----------------------------------|--|----------------|
| 10 | 华商基金管理有限公司关于旗下基金调整停牌股票估值方法的提示性公告 | 公司网站、中国证监会基金电子披露网站、上海证券报、中国证券报、证券时报、证券日报 | 2025 年 6 月 6 日 |
|----|----------------------------------|--|----------------|

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

本基金本报告期内未发生单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金设立的文件;
2. 《华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3. 《华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
4. 《华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》;
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照;
6. 报告期内华商量化进取灵活配置混合型证券投资基金在规定媒介上披露的各项公告的原稿。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

基金管理人地址：北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 19 层

基金托管人地址：中国北京市西城区复兴门内大街 55 号

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人华商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：4007008880，010—58573300

基金管理人网址：<http://www.hsfund.com>

中国证监会基金电子披露网站：<http://eid.csfc.gov.cn/fund>

华商基金管理有限公司

2025 年 8 月 29 日