

**华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式
证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59
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	59
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 市场中性策略执行情况	60
7.13 本报告期投资基金情况	60

7.14 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 盈利投资者数量占比	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	62
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	62
§9 开放式基金份额变动	62
§10 重大事件揭示	62
10.1 基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
§12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合
基金主代码	008856
交易代码	008856
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2020 年 6 月 5 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	189,189,269.46 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制系统性风险的基础上，运用量化模型建立投资组合，通过衍生工具对冲市场风险，力争实现长期稳健的绝对收益。
投资策略	主要投资策略包括资产配置策略、绝对收益策略、债券投资策略、股指期货和股票期权投资策略、国债期货投资策略、融资融券投资策略、存托凭证投资策略等。本基金所指的绝对收益策略包括 ALPHA 对冲策略、套利策略、衍生品交易策略、融资融券策略等。本基金以基金管理人自主开发的量化多因子模型为基础，灵活运用多种投资策略建立投资组合，在有效控制风险的前提下，通过金融衍生品工具对冲市场风险，力争实现长期稳健的绝对收益。
业绩比较基准	中国人民银行公布的同期一年期定期存款基准利率(税后)+2%。
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，因此相对股票型基金和一般的混合型基金其预期风险较小。而相对其业绩比较基准，由于绝对收益策略投资结果的不确定性，因此不能保证一定能获得超越业绩比较基准的绝对收益。

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		华夏基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-818-6666	95566

传真	010-63136700	010-66594942
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	北京市朝阳区北辰西路6号院北辰中心C座5层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	100101	100818
法定代表人	邹迎光	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华夏基金管理有限公司	北京市朝阳区北辰西路 6 号院北辰中心 C 座 5 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	7,388,287.64
本期利润	2,422,649.17
加权平均基金份额本期利润	0.0106
本期加权平均净值利润率	0.87%
本期基金份额净值增长率	0.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年6月30日）
期末可供分配利润	38,424,975.48
期末可供分配基金份额利润	0.2031
期末基金资产净值	233,310,765.80
期末基金份额净值	1.2332
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年6月30日）
基金份额累计净值增长率	23.32%

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期末可供分配利润为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。

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	0.26%	0.32%	0.87%	0.00%	-0.61%	0.32%
过去六个月	0.72%	0.32%	1.74%	0.00%	-1.02%	0.32%
过去一年	-0.08%	0.29%	3.50%	0.00%	-3.58%	0.29%
过去三年	5.58%	0.36%	10.50%	0.00%	-4.92%	0.36%
过去五年	13.83%	0.36%	17.50%	0.00%	-3.67%	0.36%
自基金合同生效起至今	23.32%	0.35%	21.24%	0.00%	2.08%	0.35%

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

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2020 年 6 月 5 日至 2026 年 6 月 30 日）



§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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉及沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海、北京设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人、首批浮动管理费基金管理人、首批公募 REITs 指数基金管理人，境内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖宽基指数、港股（QDII）指数、港股（港股通）指数、行业主题指数、策略指数、跨境指数、固收指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2026 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名靠前（基金排名不作为产品未来表现的保证）：

主动权益产品：在混合型 FOF(权益资产 30%-60%)(A 类)中，华夏聚源优选三个月持有混合（FOF）(A 类)排名第 1/25；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 1/10；在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中，华夏数字产业混合(A 类)排名第 2/64；在低碳环保偏股型基金(A 类)中，华夏低碳经济一年持有混合(A 类)排名第 3/32；在债券型 FOF(A 类)中，华夏聚顺优选六个月持有债券（FOF）(A 类)排名第 3/24；在养老目标日期 FOF(2045)(A 类)中，华夏养老 2045 三年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/18；在养老目标日期 FOF(2050)(A 类)中，华夏养老 2050 五年持有混合（FOF）(A 类)排名第 3/15；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏移动互联混合（QDII）排名第 3/56、华夏新时代混合（QDII）排名第 5/56、华夏全球科技先锋混合（QDII）排名第 7/56；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中，华夏成长混合排名第 13/149；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中，华夏乐享健康混合(A 类)排名第 15/89；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏线上经济主题精选混合排名第 25/220；在标准股票型基金(A 类)中，华夏创新前沿股票(A 类)排名第 43/354、华夏领先股票排名第 49/354、华夏经济转型股票排名第 57/354、华夏潜龙精选股票排名第 66/354；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏磐晟混合（LOF）排名第 35/397、华夏新锦程混合(A 类)排名第 62/397、华夏稳增混合排名第 79/397；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中，华夏高端制造混合(A 类)排名第 36/478；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏先进制造龙头混合(A 类)排名第 23/1941、华夏科技创新混合(A 类)排名第 78/1941、华夏成长先锋一年持有混合(A 类)排名第 116/1941、华夏核心科技 6 个月定开混合(A 类)排名第 191/1941、华夏产业升级混合(A 类)排名第 212/1941、华夏国企创新混合发起式（A 类）排名第 249/1941、华夏成长机会一年持有混合排名第 268/1941、华夏创业板两年定开混合排名第 276/1941、华夏盛世混合排名第 292/1941、华夏创新驱动混合(A 类)排名第 365/1941、华夏科技前沿 6 个月定开混合(A 类)排名第 372/1941、华夏行业景气混合(A 类)排名第 374/1941。

固收与固收+产品：在可转换债券型基金(A 类)中，华夏可转债增强债券 A 排名第 1/38；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中，华夏双债债券 A 排名第 1/280、华夏聚利债券 A 排名第 4/280、华夏债券 AB 排名第 74/280；在普通偏债型基金(股票上限不高于 30%)(A 类)中，华夏永康添福混合 A 排名第 2/307、华夏兴源稳健一年持有混合 A 排名第 17/307、华夏永顺一年持有混合 A 排名第 31/307；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏安益短债债券 A 排名第 7/133、华夏 30 天滚动短债债券发起式 A 排名第 8/133；在利率债纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎昭利率债债券 A 排名第 7/98；

在普通债券型基金(二级)(A 类)中, 华夏鼎沛债券 A 排名第 10/540、华夏鼎清债券 A 排名第 12/540、华夏鼎利债券 A 排名第 47/540; 在普通偏债型基金(股票上限高于 30%)(A 类)中, 华夏永鑫六个月持有混合 A 排名第 17/245、华夏永泓一年持有混合 A 排名第 28/245; 在长期纯债债券型基金(A 类)中, 华夏鼎富债券 A 排名第 61/1041、华夏鼎航债券 A 排名第 67/1041、华夏鼎信债券 A 排名第 115/1041、华夏纯债债券 A 排名第 234/1041、华夏鼎茂债券 A 排名第 268/1041; 在标准偏债型基金(股票上下限 10%-30%)(A 类)中, 华夏稳进增益一年持有混合 A 排名第 11/71。

在客户服务方面, 2026 年上半年, 华夏基金继续以客户需求为导向, 努力提高客户使用的便利性和服务体验: (1) 华夏基金管家客户端优化基金详情展示, 增强信息可读性, 从客户投资需求出发, 进一步提升使用体验; (2) 与国贸期货、新华信通等代销机构合作, 拓展更加丰富的客户理财渠道; (3) 开展“未来, 我们继续一起走过”、“选择难度大? 给你支个招”、“当前科技股的三国博弈”等活动, 为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

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		
孙蒙	本基金的基金经理、投委会成员	2020-06-05	-	12 年	硕士。曾任中信建投证券股份有限公司研究员、投资经理等。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理。
叶津佐	本基金的基金经理助理	2023-10-19	-	9 年	博士。2017 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究员、基金经理助理。

注: ①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的, 其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《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

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人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% 的交易共有 45 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

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

2026 年上半年，全球经济在地缘冲突扰动和 AI 基建加速两条主线影响下呈现 K 型分化。油价先扬后抑、上半年中枢较去年四季度整体上移，叠加地缘风险溢价，推高全球通胀压力并影响传统经济复苏；AI Agent 驱动下 AI 产业链投资构建增长核心动能。主要经济体受供给冲击和需求韧性差异表现分化，货币政策由前期宽松转向“按兵不动+紧缩预期”并明显分化。国内方面，十五五开局之年延续高质量发展趋势，上半年保持一定增长韧性，物价呈结构性复苏，输入型通胀特征显现；货币政策保持适度宽松，但 M2、社融增速边际回落；总体供强需弱矛盾突出、经济向好基础仍需巩固。

市场方面，2026 年上半年 A 股在科技主线引领下延续宽幅震荡上行、呈现标准 K 型结构性牛市特征，指数分层显著。行业层面呈现分化，31 个申万一级行业仅约 10 个上涨，电子、通信、建筑材料、机械设备等 AI 相关行业领涨，而商贸零售、农林牧渔、美容护理、食品饮料、医药生物等消费医药内需行业表现落后。市场风格方面，受成长板块基本面优势领先、AI/算力产业链远期景气

预期上修及流动性宽松环境等因素影响，成长风格相对价值风格的超额收益极为突出，期间量化策略整体表现出现分化。

基金投资运作方面，股票端以多因子量化投资策略为主，对冲端通过股指期货对冲市场风险，力争获取绝对收益表现。我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2332 元，本报告期份额净值增长率为 0.72%，同期业绩比较基准增长率为 1.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，A 股市场行情分化比较大，AI 科技相关主题上涨，而其他行业股票大部分下跌。不管是从基本面角度，还是从交易结构看，相关主题行情已经走向过热阶段。展望下半年，科技板块继续大幅上涨可能性较小，市场较大可能迎来行业或者风格上的再平衡，建议均衡配置。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	16,935,349.62	4,502,808.54
结算备付金		4,613,313.24	46,168,589.25
存出保证金		19,767,497.37	27,151,729.52
交易性金融资产	6.4.7.2	186,247,852.04	243,720,605.80
其中：股票投资		186,247,852.04	243,697,717.26
基金投资		-	-
债券投资		-	22,888.54
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	-	43,013,079.10
应收清算款		12,126,536.25	134,334.64
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		239,690,548.52	364,691,146.85
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,825,018.86	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		231,293.33	370,583.56
应付托管费		38,548.90	61,763.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	10.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	284,921.63	463,286.37
负债合计		6,379,782.72	895,644.21
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	189,189,269.46	297,114,730.18
未分配利润	6.4.7.8	44,121,496.34	66,680,772.46
净资产合计		233,310,765.80	363,795,502.64

负债和净资产总计		239,690,548.52	364,691,146.85
----------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2332 元，基金份额总额 189,189,269.46 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏安泰对冲策略3个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		4,475,278.37	13,679,531.16
1.利息收入		294,840.34	1,570,353.24
其中：存款利息收入	6.4.7.9	256,657.94	797,392.45
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		38,182.40	772,960.79
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,129,068.15	29,326,720.90
其中：股票投资收益	6.4.7.1 0	41,468,724.09	26,154,172.25
基金投资收益	6.4.7.1 1	-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	8,676.94	21,662.68
资产支持证券投资收益	6.4.7.1 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.1 4	-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 5	-33,723,989.22	-1,609,161.93
股利收益	6.4.7.1 6	1,375,656.34	4,760,047.90
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	-4,965,638.47	-17,450,485.40
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 8	17,008.35	232,942.42

减：二、营业总支出		2,052,629.20	5,983,112.35
1.管理人报酬		1,690,127.95	4,895,188.57
2.托管费		281,687.97	815,864.77
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	6.4.7.2 0	-	-
7.税金及附加		1.03	176,027.86
8.其他费用	6.4.7.2 1	80,812.25	96,031.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,422,649.17	7,696,418.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,422,649.17	7,696,418.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,422,649.17	7,696,418.81

6.3 净资产变动表

会计主体：华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	297,114,730.18	66,680,772.46	363,795,502.64
二、本期期初净资产	297,114,730.18	66,680,772.46	363,795,502.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-107,925,460.72	-22,559,276.12	-130,484,736.84
（一）、综合收益总额	-	2,422,649.17	2,422,649.17
（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）	-107,925,460.72	-24,981,925.29	-132,907,386.01

其中：1.基金申购款	36,927,931.86	8,523,424.01	45,451,355.87
2.基金赎回款	-144,853,392.58	-33,505,349.30	-178,358,741.88
（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	189,189,269.46	44,121,496.34	233,310,765.80
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	947,968,274.28	201,599,627.63	1,149,567,901.91
二、本期期初净资产	947,968,274.28	201,599,627.63	1,149,567,901.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-468,021,826.99	-89,183,127.25	-557,204,954.24
（一）、综合收益总额	-	7,696,418.81	7,696,418.81
（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）	-468,021,826.99	-96,879,546.06	-564,901,373.05
其中：1.基金申购款	39,870,586.77	9,098,837.16	48,969,423.93
2.基金赎回款	-507,892,413.76	-105,978,383.22	-613,870,796.98
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	479,946,447.29	112,416,500.38	592,362,947.67

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：

基金管理人负责人：邹迎光，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2892 号《关于准予华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为契约型定期开放式，存续期限为不

定期。本基金于 2020 年 5 月 13 日至 2020 年 6 月 2 日募集 1,153,584,795.34 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60739337_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 6 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,154,005,597.33 份基金份额，其中认购资金利息折合 420,801.99 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定：本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板、中小板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换公司债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、货币市场工具（含同业存单）、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权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)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则——基本准则》、各项具体会计准则(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、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《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》编制，同时在信息披露方面也参考了中国证监会、中国基金业协会发布的基金行业实务操作的其他有关规定。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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间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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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

根据财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关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交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

(2) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（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、债券取得的收入免征增值税；对证券投资基金从证券市场中取得的买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(3) 存款利息收入不征收增值税。

(4) 自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税。

(5) 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，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。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	16,935,349.62
等于：本金	16,934,221.74
加：应计利息	1,127.88
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	16,935,349.62

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	181,810,085.49	-	186,247,852.04	4,437,766.55
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	181,810,085.49	-	186,247,852.04	4,437,766.55

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	-154,299,200.00	-	-	-
其中：股指期货	-154,299,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-154,299,200.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2609	中证 500 期货 IC2609 合约	-1	-1,752,280.00	-22,960.00
IF2607	沪深 300 期货 IF2607 合约	-20	-29,532,000.00	-748,200.00
IM2607	中证 1000 期货 IM2607 合约	-35	-60,827,200.00	-2,729,480.00
IC2607	中证 500 期货 IC2607 合约	-40	-71,425,600.00	-5,737,240.00
合计	-	-	-	-9,237,880.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-9,237,880.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债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。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	164,098.92
其中：交易所市场	164,098.92
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	120,822.71
合计	284,921.63

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	297,114,730.18	297,114,730.18
本期申购	36,927,931.86	36,927,931.86
本期赎回（以“-”号填列）	-144,853,392.58	-144,853,392.58
本期末	189,189,269.46	189,189,269.46

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.8 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	46,513,884.04	20,166,888.42	66,680,772.46
本期期初	46,513,884.04	20,166,888.42	66,680,772.46
本期利润	7,388,287.64	-4,965,638.47	2,422,649.17
本期基金份额交易产生的变动数	-15,477,196.20	-9,504,729.09	-24,981,925.29
其中：基金申购款	5,447,144.70	3,076,279.31	8,523,424.01
基金赎回款	-20,924,340.90	-12,581,008.40	-33,505,349.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,424,975.48	5,696,520.86	44,121,496.34

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	13,473.43
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	242,924.93
其他	259.58
合计	256,657.94

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	903,627,868.31
减：卖出股票成本总额	861,433,367.19
减：交易费用	725,777.03
买卖股票差价收入	41,468,724.09

6.4.7.11 基金投资收益

无。

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	0.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,676.76
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	8,676.94

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,378.56
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,700.00
减：应计利息总额	0.82
减：交易费用	0.98
买卖债券差价收入	8,676.76

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

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

无。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股指期货投资收益	-33,723,989.22

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,375,656.34
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,375,656.34

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-4,960,898.47

——股票投资	-4,953,710.57
——债券投资	-7,187.90
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-4,740.00
——权证投资	-
——期货投资	-4,740.00
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	-4,965,638.47

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	17,008.35
合计	17,008.35

6.4.7.19 持有基金产生的费用

无。

6.4.7.20 信用减值损失

无。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	16,315.34
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,989.54
合计	80,812.25

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，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
中信期货有限公司（“中信期货”）	基金管理人第一大股东的子公司

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 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	336,048,914.65	19.64%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
-------	----------------------------	---------------------------------

	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	131,000,000.00	86.75%	-	-

6.4.10.1.5 基金交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	32,232.03	19.64%	32,232.03	19.64%
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。根据证监会公告[2024]3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,690,127.95	4,895,188.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	592,743.72	1,819,368.54
应支付基金管理人的净管理费	1,097,384.23	3,075,820.03

注：①支付基金管理人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。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 年费率 / 当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30 日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	281,687.97	815,864.77

注：①支付基金托管人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。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×年费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

无。

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
期初持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,900.09	10,000,900.09
期末持有的基金份额	5.29%	2.08%

占基金总份额比例		
----------	--	--

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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

无。

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行活期存款	16,935,349.62	13,473.43	9,590,050.40	53,866.64

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	001248	华润新能源	新股发行	11,662	117,902.82
中信证券	688785	恒运昌	新股发行	975	89,875.50
中信证券	688820	盛合晶微	新股发行	4,097	80,628.96
中信证券	688808	联讯仪器	新股发行	696	56,988.48
中信证券	688811	有研复材	新股发行	8,337	53,440.17
中信证券	301683	慧谷新材	新股发行	590	46,244.20
中信证券	688797	臻宝科技	新股发行	1,005	44,782.80
中信证券	301669	高特电子	新股发行	5,455	38,621.40
中信证券	001312	福恩股份	新股发行	1,028	18,894.64
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688775	影石创新	新股发行	5,549	262,301.23

中信证券	688583	思看科技	新股发行	1,742	58,287.32
中信证券	688755	汉邦科技	新股发行	2,023	46,063.71
中信证券	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40
中信证券	603257	中国瑞林	新股发行	780	16,005.60
中信证券	603124	江南新材	新股发行	879	9,264.66

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖期货成交额为 436,086,660.00 元（上年度可比期间：2,898,396,400.00 元），支付给中信期货的佣金为 10,330.88 元（上年度可比期间：68,663.03 元）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新发流通受限	46.08	463.33	418	19,261.44	193,671.94	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新发流通受限	81.88	1,584.33	70	5,731.60	110,903.10	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新发流通受限	10.11	10.11	8,164	82,538.04	82,538.04	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新发流通受限	9.47	70.14	1,162	11,004.14	81,502.68	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新发流通受限	19.68	141.49	410	8,068.80	58,010.90	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新发流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新发流通受限	44.56	468.67	101	4,500.56	47,335.67	-

688785	恒运 昌	2026-0 1-20	6 个月	新发 流通 受限	92.18	463.15	98	9,033.6 4	45,388. 70	-
301682	宏明 电子	2026-0 3-18	6 个月	新发 流通 受限	69.66	160.06	255	17,763. 30	40,815. 30	-
001399	惠科 股份	2026-0 6-16	6 个月	新发 流通 受限	10.12	27.73	1,336	13,520. 32	37,047. 28	-
688635	长进 光子	2026-0 5-20	6 个月	新发 流通 受限	40.98	308.19	120	4,917.6 0	36,982. 80	-
001248	华润 新能 源	2026-0 6-24	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	10.11	10.11	3,498	35,364. 78	35,364. 78	-
688813	泰金 新能	2026-0 3-24	6 个月	新发 流通 受限	26.28	172.09	204	5,361.1 2	35,106. 36	-
688781	视涯 科技	2026-0 3-18	6 个月	新发 流通 受限	22.68	47.61	511	11,589. 48	24,328. 71	-
001257	盛龙 股份	2026-0 3-24	6 个月	新发 流通 受限	7.82	20.74	1,119	8,750.5 8	23,208. 06	-
688811	有研 复材	2026-0 4-01	6 个月	新发 流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.9 4	20,124. 42	-
603459	红板 科技	2026-0 3-31	6 个月	新发 流通 受限	17.70	84.32	187	3,309.9 0	15,767. 84	-
301696	三瑞 智能	2026-0 3-31	6 个月	新发 流通 受限	24.68	86.80	180	4,442.4 0	15,624. 00	-
301669	高特 电子	2026-0 6-02	6 个月	新发 流通 受限	7.08	28.40	546	3,865.6 8	15,506. 40	-
301687	新广 益	2025-1 2-24	6 个月	新发 流通 受限	21.93	77.78	195	4,276.3 5	15,167. 10	-
301531	春光 集团	2026-0 4-28	6 个月	新发 流通 受限	13.30	51.56	290	3,857.0 0	14,952. 40	-
301680	固德 电材	2026-0 2-27	6 个月	新发 流通 受限	58.00	112.16	117	6,786.0 0	13,122. 72	-

301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新发流通受限	13.91	32.47	352	4,896.32	11,429.44	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6 个月	新发流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新发流通受限	27.19	31.31	297	8,075.43	9,299.07	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新发流通受限	55.95	57.10	162	9,063.90	9,250.20	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新发流通受限	30.38	38.99	209	6,349.42	8,148.91	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新发流通受限	78.38	121.77	59	4,624.42	7,184.43	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新发流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	53.26	58.74	119	6,337.94	6,990.06	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新发流通受限	11.18	17.59	363	4,058.34	6,385.17	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月内 (含)	新发流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新发流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新发流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1 个月内 (含)	新发流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新发流通受限	33.49	33.93	51	1,707.99	1,730.43	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新发流通受限	18.38	16.78	103	1,893.14	1,728.34	-

920189	康美特	2026-06-30	1 个月内 (含)	新发 流通 受限	8.14	8.14	200	1,628.0 0	1,628.0 0	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新发 流通 受限	37.88	34.87	46	1,742.4 8	1,604.0 2	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新发 流通 受限	28.00	27.78	57	1,596.0 0	1,583.4 6	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④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。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股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；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给

基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。除在“6.4.12 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制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 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，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构及比例，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

截至本期末，综合考虑利率债、信用债、同业存单、资产支持证券等资产占基金资产净值的比例，利率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。本基金持有的金融工具以人民币计价，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。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	186,247,852.04	79.83	243,697,717.26	66.99
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	22,888.54	0.01
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	186,247,852.04	79.83	243,720,605.80	66.99

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②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。

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	-5%	-12,199,685.21	-11,972,955.48
	+5%	12,199,685.21	11,972,955.48

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	185,146,555.83
第二层次	127,870.82
第三层次	973,425.39
合计	186,247,852.04

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等导致流通受限的情况，本基金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，确定相关投资的公允价值所属层次。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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，这些金融工具因其剩余期限较短，其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	186,247,852.04	77.70
	其中：股票	186,247,852.04	77.70
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	21,548,662.86	8.99
8	其他各项资产	31,894,033.62	13.31
9	合计	239,690,548.52	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

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	841,092.00	0.36
B	采矿业	5,780,150.06	2.48
C	制造业	138,988,439.54	59.57

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,429,702.82	0.61
E	建筑业	981,201.00	0.42
F	批发和零售业	2,472,974.00	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	4,606,990.70	1.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,316,575.56	5.71
J	金融业	8,746,777.76	3.75
K	房地产业	1,030,301.00	0.44
L	租赁和商务服务业	1,912,189.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	2,405,114.00	1.03
N	水利、环境和公共设施管理业	3,168,556.60	1.36
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	567,788.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	186,247,852.04	79.83

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
1	300308	中际旭创	2,200	2,794,000.00	1.20
2	688498	源杰科技	1,225	2,310,350.00	0.99
3	603986	兆易创新	2,200	1,793,000.00	0.77
4	300750	宁德时代	4,220	1,658,502.20	0.71
5	301377	鼎泰高科	2,700	1,487,430.00	0.64
6	002384	东山精密	5,600	1,469,160.00	0.63
7	300604	长川科技	4,300	1,468,106.00	0.63
8	688041	海光信息	3,900	1,444,170.00	0.62
9	688127	蓝特光学	14,700	1,434,720.00	0.61

10	603083	剑桥科技	5,600	1,427,272.00	0.61
11	300502	新易盛	2,320	1,408,240.00	0.60
12	300919	中伟新材	31,900	1,395,625.00	0.60
13	688025	杰普特	2,900	1,363,000.00	0.58
14	688778	厦钨新能	24,700	1,343,680.00	0.58
15	002484	江海股份	12,600	1,323,000.00	0.57
16	300953	震裕科技	9,040	1,208,648.00	0.52
17	688536	思瑞浦	3,200	1,165,088.00	0.50
18	002841	视源股份	33,600	1,160,208.00	0.50
19	002281	光迅科技	4,500	1,156,230.00	0.50
20	603588	高能环境	59,100	1,134,720.00	0.49
21	688388	嘉元科技	25,285	1,112,540.00	0.48
22	688981	中芯国际	6,900	1,095,858.00	0.47
23	000408	藏格矿业	15,700	1,088,324.00	0.47
24	600176	中国巨石	14,700	1,071,336.00	0.46
25	600801	华新建材	67,800	1,057,680.00	0.45
26	002497	雅化集团	50,500	1,028,685.00	0.44
27	300073	当升科技	21,100	1,013,644.00	0.43
28	002475	立讯精密	14,000	985,600.00	0.42
29	601318	中国平安	20,368	972,368.32	0.42
30	300223	北京君正	3,900	970,710.00	0.42
31	688256	寒武纪	596	950,947.80	0.41
32	002415	海康威视	27,200	930,240.00	0.40
33	002916	深南电路	2,000	915,800.00	0.39
34	688002	睿创微纳	5,800	897,202.00	0.38
35	002545	东方铁塔	54,000	875,880.00	0.38
36	000338	潍柴动力	31,900	869,275.00	0.37
37	001389	广合科技	3,600	854,100.00	0.37
38	001359	平安电工	6,800	851,700.00	0.37
39	601872	招商轮船	48,100	845,117.00	0.36

40	300775	三角防务	38,300	844,132.00	0.36
41	301371	敷尔佳	31,600	821,600.00	0.35
42	601869	长飞光纤	1,500	818,850.00	0.35
43	688059	华锐精密	4,100	818,811.00	0.35
44	301130	西点药业	34,100	817,718.00	0.35
45	300768	迪普科技	59,300	816,561.00	0.35
46	002487	大金重工	13,900	805,783.00	0.35
47	002371	北方华创	900	796,104.00	0.34
48	002353	杰瑞股份	5,200	793,000.00	0.34
49	603162	海通发展	88,392	792,876.24	0.34
50	600519	贵州茅台	665	788,350.85	0.34
51	300115	长盈精密	27,700	773,938.00	0.33
52	688182	灿勤科技	17,900	770,953.00	0.33
53	002436	兴森科技	14,900	759,155.00	0.33
54	300207	欣旺达	39,700	753,903.00	0.32
55	301391	卡莱特	13,100	748,010.00	0.32
56	600183	生益科技	4,300	745,620.00	0.32
57	301571	国科天成	11,200	730,016.00	0.31
58	002738	中矿资源	12,360	729,116.40	0.31
59	000967	盈峰环境	69,200	728,676.00	0.31
60	600113	浙江东日	21,900	726,642.00	0.31
61	601208	东材科技	10,200	722,058.00	0.31
62	000923	河钢资源	57,900	718,539.00	0.31
63	300037	新宙邦	7,700	714,945.00	0.31
64	688630	芯碁微装	1,300	714,207.00	0.31
65	688521	芯原股份	1,900	705,166.00	0.30
66	002532	天山铝业	65,100	698,523.00	0.30
67	603259	药明康德	5,600	697,256.00	0.30
68	300548	长芯博创	2,500	695,000.00	0.30
69	688063	派能科技	13,000	692,510.00	0.30

70	601601	中国太保	23,800	678,776.00	0.29
71	002028	思源电气	3,900	674,700.00	0.29
72	600773	西藏城投	51,900	667,953.00	0.29
73	002875	安奈儿	44,900	667,214.00	0.29
74	600309	万华化学	9,700	663,577.00	0.28
75	002008	大族激光	4,400	660,484.00	0.28
76	000776	广发证券	28,200	659,880.00	0.28
77	002544	普天科技	36,100	657,742.00	0.28
78	300408	三环集团	3,900	650,910.00	0.28
79	301200	大族数控	1,800	649,170.00	0.28
80	300442	润泽科技	7,800	647,946.00	0.28
81	301511	德福科技	4,500	647,325.00	0.28
82	688167	炬光科技	1,800	637,578.00	0.27
83	301358	湖南裕能	8,400	637,308.00	0.27
84	601398	工商银行	90,100	637,007.00	0.27
85	688372	伟测科技	3,400	632,400.00	0.27
86	688559	海目星	7,500	629,400.00	0.27
87	688700	东威科技	7,000	625,800.00	0.27
88	300055	万邦达	96,940	623,324.20	0.27
89	002126	银轮股份	12,400	617,520.00	0.26
90	000975	山金国际	36,300	617,100.00	0.26
91	300661	圣邦股份	4,300	616,964.00	0.26
92	600388	龙净环保	42,100	612,555.00	0.26
93	002130	沃尔核材	32,200	610,512.00	0.26
94	688313	仕佳光子	3,300	609,345.00	0.26
95	688279	峰岬科技	2,700	605,988.00	0.26
96	600919	江苏银行	55,800	601,524.00	0.26
97	603057	紫燕食品	26,900	599,870.00	0.26
98	000686	东北证券	71,300	598,920.00	0.26
99	688568	中科星图	14,400	597,168.00	0.26

100	688195	腾景科技	3,100	596,998.00	0.26
101	603290	斯达半导	3,900	596,466.00	0.26
102	000932	华菱钢铁	171,400	594,758.00	0.25
103	002001	新和成	20,800	591,136.00	0.25
104	300672	国科微	2,000	590,000.00	0.25
105	300409	道氏技术	29,600	589,928.00	0.25
106	600233	圆通速递	37,300	587,475.00	0.25
107	002922	伊戈尔	17,900	587,120.00	0.25
108	301002	崧盛股份	15,200	586,720.00	0.25
109	603737	三棵树	24,300	585,630.00	0.25
110	002518	科士达	10,800	578,772.00	0.25
111	300236	上海新阳	4,400	578,600.00	0.25
112	600026	中远海能	32,100	575,874.00	0.25
113	688311	盟升电子	21,700	568,323.00	0.24
114	300602	飞荣达	11,100	568,320.00	0.24
115	601995	中金公司	15,700	567,555.00	0.24
116	605056	咸亨国际	35,300	564,800.00	0.24
117	688658	悦康药业	43,900	564,554.00	0.24
118	601233	桐昆股份	25,900	560,735.00	0.24
119	002402	和而泰	21,700	560,511.00	0.24
120	688522	纳睿雷达	27,760	555,755.20	0.24
121	605196	华通线缆	21,200	553,320.00	0.24
122	300427	红相股份	82,100	550,891.00	0.24
123	688262	国芯科技	12,700	549,021.00	0.24
124	301662	宏工科技	5,400	547,128.00	0.23
125	002222	福晶科技	5,900	544,452.00	0.23
126	002745	木林森	43,300	543,415.00	0.23
127	301429	森泰股份	34,600	542,182.00	0.23
128	002947	恒铭达	7,100	539,955.00	0.23
129	688766	普冉股份	700	536,620.00	0.23

130	600331	宏达股份	48,500	533,015.00	0.23
131	002913	奥士康	8,100	517,914.00	0.22
132	300450	先导智能	12,700	517,144.00	0.22
133	300855	图南股份	16,500	515,790.00	0.22
134	688110	东芯股份	2,523	513,935.10	0.22
135	300416	苏试试验	25,200	513,576.00	0.22
136	601126	四方股份	8,100	511,920.00	0.22
137	600595	中孚实业	90,800	510,296.00	0.22
138	000657	中钨高新	5,300	507,316.00	0.22
139	603619	中曼石油	26,600	497,686.00	0.21
140	000990	诚志股份	60,500	494,890.00	0.21
141	000555	神州信息	48,000	494,400.00	0.21
142	002969	嘉美包装	34,800	489,984.00	0.21
143	002993	奥海科技	6,800	486,948.00	0.21
144	002941	新疆交建	51,500	486,160.00	0.21
145	301087	可孚医疗	10,200	486,030.00	0.21
146	002266	浙富控股	95,400	482,724.00	0.21
147	600645	中源协和	28,200	482,502.00	0.21
148	301086	鸿富瀚	2,300	481,344.00	0.21
149	600201	生物股份	41,200	479,980.00	0.21
150	688800	瑞可达	5,000	479,850.00	0.21
151	601857	中国石油	55,200	479,136.00	0.21
152	001339	智微智能	4,670	477,647.60	0.20
153	688691	灿芯股份	4,100	475,313.00	0.20
154	601156	东航物流	29,300	472,316.00	0.20
155	000807	云铝股份	21,200	469,368.00	0.20
156	601766	中国中车	90,100	468,520.00	0.20
157	300443	金雷股份	21,700	468,286.00	0.20
158	603124	江南新材	2,500	467,450.00	0.20
159	688008	澜起科技	1,500	464,850.00	0.20

160	000035	中国天楹	94,000	454,020.00	0.19
161	300580	贝斯特	22,500	452,475.00	0.19
162	300337	银邦股份	38,800	452,408.00	0.19
163	300075	数字政通	43,900	448,658.00	0.19
164	002270	华明装备	23,800	448,630.00	0.19
165	000001	平安银行	44,600	448,230.00	0.19
166	601939	建设银行	46,528	448,064.64	0.19
167	600075	新疆天业	110,900	448,036.00	0.19
168	600739	辽宁成大	44,300	447,873.00	0.19
169	002414	高德红外	33,700	446,862.00	0.19
170	002043	兔宝宝	40,300	446,524.00	0.19
171	301389	隆扬电子	5,100	442,629.00	0.19
172	002458	益生股份	56,900	442,113.00	0.19
173	301225	恒勃股份	5,600	441,224.00	0.19
174	300415	伊之密	22,100	440,011.00	0.19
175	688593	新相微	11,300	439,796.00	0.19
176	301606	绿联科技	7,200	439,344.00	0.19
177	002928	华夏航空	62,500	436,875.00	0.19
178	000858	五粮液	5,900	436,600.00	0.19
179	605118	力鼎光电	12,500	436,125.00	0.19
180	600875	东方电气	15,100	434,427.00	0.19
181	601033	永兴股份	32,400	434,160.00	0.19
182	688690	纳微科技	9,800	432,180.00	0.19
183	002716	湖南白银	53,200	430,388.00	0.18
184	603317	天味食品	32,800	426,728.00	0.18
185	301631	壹连科技	5,840	419,662.40	0.18
186	000534	万泽股份	15,300	418,608.00	0.18
187	601138	工业富联	5,800	418,470.00	0.18
188	301192	泰祥股份	22,000	415,800.00	0.18
189	300049	福瑞医科	10,600	412,128.00	0.18

190	301216	万凯新材	17,900	411,521.00	0.18
191	001337	四川黄金	11,200	410,592.00	0.18
192	300814	中富电路	2,000	409,000.00	0.18
193	688392	骄成超声	1,800	408,924.00	0.18
194	688061	灿瑞科技	8,200	407,294.00	0.17
195	002080	中材科技	4,500	405,000.00	0.17
196	688390	固德威	3,700	401,487.00	0.17
197	301353	普莱得	24,050	399,470.50	0.17
198	300947	德必集团	31,100	396,525.00	0.17
199	300171	东富龙	35,400	391,524.00	0.17
200	300127	银河磁体	14,000	391,300.00	0.17
201	600971	恒源煤电	56,500	389,850.00	0.17
202	301519	舜禹股份	35,900	389,515.00	0.17
203	600418	江淮汽车	15,000	387,450.00	0.17
204	300407	凯发电气	35,700	385,560.00	0.17
205	601088	中国神华	9,700	378,688.00	0.16
206	002241	歌尔股份	16,800	378,504.00	0.16
207	603699	纽威股份	7,400	372,220.00	0.16
208	601677	明泰铝业	22,400	371,840.00	0.16
209	300418	昆仑万维	9,200	371,312.00	0.16
210	002396	星网锐捷	19,290	369,789.30	0.16
211	600037	歌华有线	58,700	368,049.00	0.16
212	001203	大中矿业	12,200	365,390.00	0.16
213	600941	中国移动	4,200	361,746.00	0.16
214	601107	四川成渝	74,100	361,608.00	0.15
215	600266	城建发展	91,700	358,547.00	0.15
216	301345	涛涛车业	1,500	346,500.00	0.15
217	300680	隆盛科技	15,200	345,344.00	0.15
218	603926	铁流股份	19,300	341,417.00	0.15
219	000892	欢瑞世纪	101,800	338,994.00	0.15

220	300012	华测检测	24,300	336,798.00	0.14
221	688231	隆达股份	9,020	331,304.60	0.14
222	002131	利欧股份	69,700	331,075.00	0.14
223	688586	江航装备	28,200	329,658.00	0.14
224	688275	万润新能	2,500	318,875.00	0.14
225	001218	丽臣实业	14,400	317,664.00	0.14
226	688615	合合信息	2,800	316,680.00	0.14
227	002324	普利特	26,000	313,820.00	0.13
228	601998	中信银行	45,000	311,850.00	0.13
229	300136	信维通信	2,600	310,050.00	0.13
230	688503	聚和材料	2,300	305,210.00	0.13
231	601061	中信金属	28,200	303,714.00	0.13
232	002429	兆驰股份	29,000	301,310.00	0.13
233	688652	京仪装备	1,500	300,255.00	0.13
234	601059	信达证券	18,400	297,896.00	0.13
235	603013	亚普股份	18,700	295,273.00	0.13
236	688150	莱特光电	4,300	295,066.00	0.13
237	688698	伟创电气	5,600	293,720.00	0.13
238	688676	金盘科技	3,468	293,531.52	0.13
239	605599	菜百股份	21,100	289,070.00	0.12
240	300969	恒帅股份	3,080	288,780.80	0.12
241	301101	明月镜片	10,600	288,744.00	0.12
242	600900	长江电力	10,900	288,523.00	0.12
243	300405	科隆股份	55,100	285,418.00	0.12
244	603799	华友钴业	5,900	284,734.00	0.12
245	000935	四川双马	10,900	284,381.00	0.12
246	603345	安井食品	3,500	280,665.00	0.12
247	300837	浙矿股份	11,800	280,368.00	0.12
248	301268	铭利达	19,900	278,202.00	0.12
249	002093	国脉科技	44,100	277,830.00	0.12

250	300101	振芯科技	17,100	276,507.00	0.12
251	002290	禾盛新材	3,000	275,610.00	0.12
252	600018	上港集团	58,000	273,760.00	0.12
253	301165	锐捷网络	3,400	273,530.00	0.12
254	301095	广立微	2,300	271,515.00	0.12
255	603108	润达医疗	30,000	267,000.00	0.11
256	600426	华鲁恒升	11,100	265,512.00	0.11
257	688097	博众精工	4,200	264,810.00	0.11
258	300620	光库科技	700	264,740.00	0.11
259	001336	楚环科技	12,000	264,240.00	0.11
260	300517	海波重科	27,600	259,992.00	0.11
261	688208	道通科技	10,300	259,457.00	0.11
262	002320	海峡股份	41,100	257,697.00	0.11
263	002400	省广集团	40,500	255,555.00	0.11
264	003816	中国广核	64,600	252,586.00	0.11
265	688469	芯联集成	23,700	251,457.00	0.11
266	002379	宏桥控股	17,000	251,090.00	0.11
267	601077	渝农商行	40,900	249,899.00	0.11
268	601963	重庆银行	24,600	247,968.00	0.11
269	002077	大港股份	12,800	246,912.00	0.11
270	603887	城地香江	26,300	245,642.00	0.11
271	301113	雅艺科技	16,470	245,567.70	0.11
272	002979	雷赛智能	4,400	245,432.00	0.11
273	300970	华绿生物	13,250	242,210.00	0.10
274	600489	中金黄金	13,400	241,870.00	0.10
275	001376	百通能源	23,100	240,240.00	0.10
276	301515	港通医疗	13,400	234,902.00	0.10
277	301057	汇隆新材	10,200	234,600.00	0.10
278	601288	农业银行	38,600	234,302.00	0.10
279	300438	鹏辉能源	2,800	231,980.00	0.10

280	601899	紫金矿业	9,200	231,288.00	0.10
281	688531	日联科技	1,300	231,192.00	0.10
282	300371	汇中股份	23,600	230,808.00	0.10
283	002463	沪电股份	1,500	229,200.00	0.10
284	002961	瑞达期货	11,600	227,128.00	0.10
285	605122	四方新材	21,000	226,380.00	0.10
286	301166	优宁维	8,700	224,373.00	0.10
287	688515	裕太微	900	223,884.00	0.10
288	601328	交通银行	34,700	223,121.00	0.10
289	300658	延江股份	19,500	222,885.00	0.10
290	000060	中金岭南	29,200	221,044.00	0.09
291	300394	天孚通信	720	217,929.60	0.09
292	605376	博迁新材	800	217,040.00	0.09
293	603993	洛阳钼业	12,200	214,110.00	0.09
294	300395	菲利华	1,600	213,968.00	0.09
295	001287	中电港	6,700	208,705.00	0.09
296	301363	美好医疗	11,220	205,662.60	0.09
297	300490	华自科技	15,500	205,065.00	0.09
298	600601	方正科技	14,800	204,832.00	0.09
299	600549	厦门钨业	2,400	204,480.00	0.09
300	300417	南华仪器	19,900	204,174.00	0.09
301	000333	美的集团	2,700	203,931.00	0.09
302	688301	奕瑞科技	1,640	203,360.00	0.09
303	300642	透景生命	17,200	202,960.00	0.09
304	600338	西藏珠峰	13,200	201,168.00	0.09
305	002493	荣盛石化	18,600	199,950.00	0.09
306	002216	三全食品	17,200	198,316.00	0.09
307	000762	西藏矿业	7,300	194,910.00	0.08
308	002821	凯莱英	1,200	194,400.00	0.08
309	301666	大普微	418	193,671.94	0.08

310	601778	晶科科技	45,000	193,500.00	0.08
311	600036	招商银行	5,435	192,942.50	0.08
312	002158	汉钟精机	5,200	192,816.00	0.08
313	688779	五矿新能	23,700	192,207.00	0.08
314	002837	英维克	2,400	190,944.00	0.08
315	002144	宏达高科	19,100	188,135.00	0.08
316	301196	唯科科技	1,500	188,130.00	0.08
317	600986	浙文互联	26,600	185,668.00	0.08
318	601231	环旭电子	5,700	184,680.00	0.08
319	001326	联域股份	3,100	183,799.00	0.08
320	300457	赢合科技	8,700	183,396.00	0.08
321	600150	中国船舶	5,400	182,466.00	0.08
322	002246	北化股份	9,600	180,480.00	0.08
323	601916	浙商银行	68,400	179,892.00	0.08
324	601668	中国建筑	41,200	178,808.00	0.08
325	688326	经纬恒润	2,500	177,200.00	0.08
326	002839	张家港行	44,700	174,330.00	0.07
327	600938	中国海油	6,400	173,760.00	0.07
328	301600	慧翰股份	1,900	173,660.00	0.07
329	000157	中联重科	24,900	173,553.00	0.07
330	002064	华峰化学	18,000	170,820.00	0.07
331	300724	捷佳伟创	2,400	169,440.00	0.07
332	688173	希荻微	8,800	168,432.00	0.07
333	300098	高新兴	36,564	167,828.76	0.07
334	603283	赛腾股份	2,060	166,818.80	0.07
335	600158	中体产业	24,700	166,478.00	0.07
336	603511	爱慕股份	14,400	165,600.00	0.07
337	603127	昭衍新药	4,200	160,524.00	0.07
338	603200	上海洗霸	3,700	160,432.00	0.07
339	688486	龙迅股份	2,500	158,950.00	0.07

340	300373	扬杰科技	1,000	157,230.00	0.07
341	300823	建科智能	10,700	156,006.00	0.07
342	002882	金龙羽	8,200	154,898.00	0.07
343	300257	开山股份	5,400	154,872.00	0.07
344	002534	西子洁能	8,300	153,965.00	0.07
345	603556	海兴电力	6,800	149,600.00	0.06
345	300164	通源石油	18,700	149,600.00	0.06
346	600348	华阳股份	19,500	149,175.00	0.06
347	600000	浦发银行	17,000	146,370.00	0.06
348	002104	恒宝股份	14,000	144,340.00	0.06
349	601699	潞安环能	10,100	144,228.00	0.06
350	002563	森马服饰	28,200	142,128.00	0.06
351	002772	众兴菌业	12,500	142,000.00	0.06
352	002197	证通电子	24,500	140,630.00	0.06
353	603988	中电电机	8,600	139,492.00	0.06
354	600999	招商证券	6,500	137,150.00	0.06
355	300398	飞凯材料	2,200	135,850.00	0.06
356	603829	洛凯股份	8,200	134,234.00	0.06
357	601728	中国电信	25,700	133,383.00	0.06
358	601211	国泰海通	7,300	132,860.00	0.06
359	688717	艾罗能源	1,600	132,112.00	0.06
360	000930	中粮科技	30,500	129,625.00	0.06
361	001360	南矿集团	7,300	129,137.00	0.06
362	600104	上汽集团	13,200	128,832.00	0.06
363	002466	天齐锂业	2,100	128,772.00	0.06
364	301598	博科测试	2,600	128,752.00	0.06
365	002212	天融信	21,200	126,776.00	0.05
366	300850	新强联	4,700	125,960.00	0.05
367	300677	英科医疗	3,200	125,344.00	0.05
368	603663	三祥新材	1,300	125,190.00	0.05

369	300986	志特新材	7,200	123,480.00	0.05
370	002428	云南锗业	1,000	120,180.00	0.05
371	603300	海南华铁	26,100	118,755.00	0.05
372	688321	微芯生物	4,500	118,485.00	0.05
373	600640	国脉文化	12,200	117,974.00	0.05
374	001248	华润新能源	11,662	117,902.82	0.05
375	000636	风华高科	1,600	115,584.00	0.05
376	688099	晶晨股份	1,100	113,190.00	0.05
377	603105	芯能科技	16,400	111,684.00	0.05
378	688808	联讯仪器	70	110,903.10	0.05
379	000893	亚钾国际	2,700	110,403.00	0.05
380	002591	恒大高新	17,800	108,936.00	0.05
381	603638	艾迪精密	4,600	107,870.00	0.05
382	301037	保立佳	8,900	106,800.00	0.05
383	601882	海天精工	5,200	105,196.00	0.05
384	603059	倍加洁	4,300	104,275.00	0.04
385	301500	飞南资源	4,000	104,200.00	0.04
386	603305	旭升集团	8,300	100,596.00	0.04
387	605222	起帆电缆	4,200	97,944.00	0.04
388	301238	瑞泰新材	4,000	97,600.00	0.04
389	600710	苏美达	10,200	97,512.00	0.04
390	300074	华平股份	28,400	96,560.00	0.04
391	300843	胜蓝股份	600	93,750.00	0.04
392	688012	中微公司	200	93,700.00	0.04
393	300958	建工修复	8,800	93,632.00	0.04
394	603171	税友股份	2,300	91,655.00	0.04
395	603323	苏农银行	23,390	90,519.30	0.04
396	600908	无锡银行	17,600	89,408.00	0.04
397	301173	毓恬冠佳	3,000	89,130.00	0.04
398	600498	烽火通信	1,200	88,320.00	0.04

399	000301	东方盛虹	7,700	88,165.00	0.04
400	002017	东信和平	6,000	87,780.00	0.04
401	000810	创维数字	6,500	86,125.00	0.04
402	688361	中科飞测	200	86,000.00	0.04
403	603979	金诚信	1,400	82,642.00	0.04
404	601918	新集能源	9,600	82,464.00	0.04
405	300008	天海防务	13,500	81,810.00	0.04
406	688818	电科蓝天	1,162	81,502.68	0.03
407	601377	兴业证券	13,300	80,332.00	0.03
408	605155	西大门	6,200	73,408.00	0.03
409	603366	日出东方	9,900	71,973.00	0.03
410	600167	联美控股	12,800	71,552.00	0.03
411	688258	卓易信息	600	71,124.00	0.03
412	000959	首钢股份	20,100	70,551.00	0.03
413	300861	美畅股份	2,700	68,013.00	0.03
414	601607	上海医药	4,400	67,760.00	0.03
415	600390	五矿资本	14,800	67,488.00	0.03
416	301047	义翘神州	1,000	64,560.00	0.03
417	300800	力合科技	6,800	62,900.00	0.03
418	601858	中国科传	3,600	62,316.00	0.03
419	300285	国瓷材料	600	61,908.00	0.03
420	605011	杭州热电	4,000	61,840.00	0.03
421	002233	塔牌集团	8,800	61,336.00	0.03
422	688409	富创精密	200	61,250.00	0.03
423	002600	领益智造	3,500	60,690.00	0.03
424	301227	森鹰窗业	2,400	60,504.00	0.03
425	000933	神火股份	2,800	59,360.00	0.03
426	000619	海螺新材	13,400	58,960.00	0.03
427	002732	燕塘乳业	4,700	58,280.00	0.02
428	688820	盛合晶微	410	58,010.90	0.02

429	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.02
430	600585	海螺水泥	3,100	52,545.00	0.02
431	603225	新凤鸣	2,600	51,090.00	0.02
432	300876	蒙泰高新	3,440	49,295.20	0.02
433	688797	臻宝科技	101	47,335.67	0.02
434	002911	佛燃能源	4,800	45,552.00	0.02
435	688785	恒运昌	98	45,388.70	0.02
436	300811	铂科新材	460	43,649.40	0.02
437	000708	中信特钢	3,400	42,908.00	0.02
438	688385	复旦微电	600	42,774.00	0.02
439	300777	中简科技	1,600	42,048.00	0.02
440	688205	德科立	200	41,638.00	0.02
441	301682	宏明电子	255	40,815.30	0.02
442	300113	顺网科技	2,200	40,062.00	0.02
443	001399	惠科股份	1,336	37,047.28	0.02
444	688635	长进光子	120	36,982.80	0.02
445	002004	华邦健康	9,300	36,549.00	0.02
446	600740	山西焦化	11,400	36,366.00	0.02
447	001289	龙源电力	2,300	35,949.00	0.02
448	688813	泰金新能	204	35,106.36	0.02
449	301018	申菱环境	300	34,683.00	0.01
450	002115	三维通信	3,300	33,990.00	0.01
451	002812	恩捷股份	500	33,455.00	0.01
452	002539	云图控股	2,900	32,828.00	0.01
453	601225	陕西煤业	1,600	32,560.00	0.01
454	301158	德石股份	2,300	30,337.00	0.01
455	603297	永新光学	200	29,390.00	0.01
456	603382	海阳科技	1,700	29,155.00	0.01
457	002399	海普瑞	3,000	26,940.00	0.01
458	301551	无线传媒	1,300	25,649.00	0.01

459	002712	思美传媒	6,100	25,315.00	0.01
460	300651	金陵体育	1,400	24,990.00	0.01
461	603836	海程邦达	3,080	24,332.00	0.01
462	688781	视涯科技	511	24,328.71	0.01
463	601390	中国中铁	5,800	24,186.00	0.01
464	001257	盛龙股份	1,119	23,208.06	0.01
465	002478	常宝股份	3,500	21,630.00	0.01
466	601100	恒立液压	200	21,512.00	0.01
467	300054	鼎龙股份	200	21,194.00	0.01
468	605287	德才股份	500	20,745.00	0.01
469	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
470	001230	劲旅环境	1,260	19,353.60	0.01
471	601997	贵阳银行	3,700	18,981.00	0.01
472	000987	越秀资本	2,400	18,768.00	0.01
473	301526	国际复材	400	18,668.00	0.01
474	300593	新雷能	600	18,036.00	0.01
475	301031	中熔电气	148	17,678.60	0.01
476	603659	璞泰来	600	17,358.00	0.01
477	000059	华锦股份	4,600	17,250.00	0.01
478	605060	联德股份	300	17,022.00	0.01
479	301219	腾远钴业	300	16,440.00	0.01
480	603459	红板科技	187	15,767.84	0.01
481	301696	三瑞智能	180	15,624.00	0.01
482	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
483	301687	新广益	195	15,167.10	0.01
484	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
485	300761	立华股份	900	14,769.00	0.01
486	000786	北新建材	800	14,472.00	0.01
487	001209	洪兴股份	900	14,418.00	0.01
488	300030	阳普医疗	2,400	13,944.00	0.01

489	301042	安联锐视	200	13,340.00	0.01
490	601166	兴业银行	800	13,248.00	0.01
491	301680	固德电材	117	13,122.72	0.01
492	000725	京东方 A	1,400	12,152.00	0.01
493	000848	承德露露	1,600	11,840.00	0.01
494	301599	理奇智能	352	11,429.44	0.00
495	603041	美思德	1,100	11,407.00	0.00
496	600502	安徽建工	2,600	11,310.00	0.00
497	603706	东方环宇	600	10,374.00	0.00
498	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
499	300711	广哈通信	600	9,840.00	0.00
500	603920	世运电路	200	9,608.00	0.00
501	001365	天海电子	297	9,299.07	0.00
502	688816	易思维	162	9,250.20	0.00
503	603121	华培动力	700	8,225.00	0.00
504	001393	维通利	209	8,148.91	0.00
505	300813	泰林生物	400	7,636.00	0.00
506	301683	慧谷新材	59	7,184.43	0.00
507	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
508	001237	惠康科技	119	6,990.06	0.00
509	300045	华力创通	400	6,896.00	0.00
510	601112	振石股份	363	6,385.17	0.00
511	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
512	002946	新乳业	400	5,632.00	0.00
513	603876	鼎胜新材	200	5,202.00	0.00
514	300693	盛弘股份	100	4,875.00	0.00
515	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
516	300047	天源迪科	500	4,440.00	0.00
517	600692	亚通股份	700	3,801.00	0.00
518	600961	株冶集团	100	3,239.00	0.00

519	300771	智莱科技	300	3,096.00	0.00
520	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
521	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
522	600929	雪天盐业	500	2,270.00	0.00
523	600546	山煤国际	200	2,186.00	0.00
524	301001	凯淳股份	100	2,167.00	0.00
525	002204	大连重工	400	2,112.00	0.00
526	300625	三雄极光	200	1,816.00	0.00
527	002566	益盛药业	300	1,812.00	0.00
528	000089	深圳机场	300	1,809.00	0.00
529	603293	埃泰克	51	1,730.43	0.00
530	001312	福恩股份	103	1,728.34	0.00
531	920189	康美特	200	1,628.00	0.00
532	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
533	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
534	002271	东方雨虹	100	1,187.00	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	300308	中际旭创	3,614,024.00	0.99
2	603993	洛阳钼业	3,403,036.00	0.94
3	300274	阳光电源	3,377,543.00	0.93
4	688012	中微公司	3,354,048.24	0.92
5	002475	立讯精密	3,082,303.00	0.85
6	000960	锡业股份	3,057,836.00	0.84
7	000893	亚钾国际	2,977,253.00	0.82
8	000933	神火股份	2,949,441.00	0.81
9	002384	东山精密	2,942,211.00	0.81
10	603986	兆易创新	2,921,959.00	0.80

11	600801	华新建材	2,917,154.00	0.80
12	002738	中矿资源	2,842,821.00	0.78
13	300502	新易盛	2,779,697.00	0.76
14	688256	寒武纪	2,674,127.19	0.74
15	688498	源杰科技	2,630,691.20	0.72
16	002371	北方华创	2,624,787.00	0.72
17	601233	桐昆股份	2,561,794.00	0.70
18	601138	工业富联	2,541,019.00	0.70
19	002558	巨人网络	2,540,930.00	0.70
20	300207	欣旺达	2,506,867.00	0.69

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	5,022,774.00	1.38
2	300750	宁德时代	5,003,351.00	1.38
3	000933	神火股份	4,997,243.00	1.37
4	601899	紫金矿业	4,651,291.00	1.28
5	688008	澜起科技	4,164,440.16	1.14
6	000960	锡业股份	3,987,827.00	1.10
7	300274	阳光电源	3,574,609.00	0.98
8	300502	新易盛	3,541,603.00	0.97
9	688012	中微公司	3,522,130.15	0.97
10	000893	亚钾国际	3,512,727.00	0.97
11	002371	北方华创	3,442,390.00	0.95
12	601318	中国平安	3,334,185.00	0.92
13	000725	京东方 A	3,241,331.00	0.89
14	603259	药明康德	3,232,195.00	0.89
15	603993	洛阳钼业	3,150,531.00	0.87
16	600519	贵州茅台	3,100,570.00	0.85

17	601138	工业富联	3,075,797.00	0.85
18	002475	立讯精密	3,075,039.00	0.85
19	600938	中国海油	2,974,464.00	0.82
20	603588	高能环境	2,948,260.00	0.81

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	808,937,212.54
卖出股票收入（成交）总额	903,627,868.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

（1）股指期货对冲策略

本基金参与股指期货投资将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对合约数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。

（2）股指期货套利策略

股指期货套利策略是指积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

①期现套利：期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

②跨期套利：跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 186,247,852.04 元，占基金资产净值的比例为 79.83%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值-163,537,080.00 元，占基金资产净值的比例为-70.09%，空头合约市值占股票资产的比例为-87.81%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 9,120,391.21 元，公允价值变动损益为 -4,958,450.57 元。

7.13 本报告期投资基金情况

7.13.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.14 投资组合报告附注

7.14.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

7.14.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.14.3 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	19,767,497.37
2	应收清算款	12,126,536.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,894,033.62

7.14.4 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。

7.14.5 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情况。

7.14.6 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
7,587	24,935.98	67,606,688.80	35.73%	121,582,580.66	64.27%

注：本章节持有人户数合计按份额级别汇总，未予以合并剔重。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比	8.69%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 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	609,095.45	0.32%
------------------	------------	-------

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2023 年 6 月 5 日，华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金的基金合同生效届满三年。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 6 月 5 日）基金份额总额	1,154,005,597.33
本报告期期初基金份额总额	297,114,730.18
本报告期基金总申购份额	36,927,931.86
减：本报告期基金总赎回份额	144,853,392.58
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	189,189,269.46

§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，本基金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

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本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

本报告期未发生影响基金管理人经营或公募基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	3	926,056,061.39	54.13%	88,819.94	54.13%	-
中信证券	24	336,048,914.65	19.64%	32,232.03	19.64%	-
方正证券	4	303,905,377.86	17.76%	29,153.98	17.77%	-
国泰海通证券	6	144,663,527.15	8.46%	13,868.45	8.45%	-
招商证券	4	196,061.82	0.01%	24.52	0.01%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择研究服务证券公司的标准，即：

i 投研部门根据证券公司的总体资质情况、财务状况、研究服务能力、经营行为及风控合规能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪评估，对合作库证券公司进行调整。

ii 投研部门牵头制定证券公司研究服务评价制度，建立健全对证券公司研究服务的定期评价机制。评价指标包括但不限于：业绩贡献、反馈速度、观点或数据质量等。

②为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择交易服务证券公司的标准，即：

i 投资部门根据证券公司的总体资质、财务状况、经营行为和合规风控能力、交易服务能力等情况，选择证券公司进入交易合作库，并进行跟踪监控，对合作库证券公司进行调整。

ii 投资部门牵头制定证券公司交易服务评价制度，建立健全对证券公司交易服务的定期评价机制。

iii 投资部门定期对证券公司的交易服务开展评价，评价指标包括但不限于：交易服务成本、交易服务能力、交易系统稳定性、交易系统支持能力、应急交易能力等。

③证券公司专用交易单元选择程序：

i 投资、研究部门牵头制定规范、合理的合作证券公司管理制度，明确证券公司准入标准、退出程序等。合规管理部门对合作证券公司管理制度进行合规性审查。

ii 投资、研究部门根据上述标准进行评估并确定选用的证券公司。

iii 本基金管理人与被选择的证券公司签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

④除本表列示外，本基金还选择了财通证券、长江证券、东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高盛（中国）证券、广发证券、国金证券、国盛证券、国信证券、华西证券、华源证券、华鑫证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际证券、浙商证券、中国银河证券、中金公司、中信建投证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

⑤在上述租用的券商交易单元中，国泰海通证券的部分交易单元、万和证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
华泰证券	22,752.56	93.33%	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	131,000,000.00	86.75%	-	-	-	-
方正证券	1,626.00	6.67%	20,000,000.00	13.25%	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配	中国证监会规定报刊及	2026-02-11

	置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	网站	
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-26
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-03
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-15
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-16
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-18
7	华夏安泰对冲策略 3 个月定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-12
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-04
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-18
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-26

§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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日