

易方达丰惠混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	9
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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	14
6.4 报表附注	15
§ 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	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52

7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
§ 9 开放式基金份额变动	56
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	57
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
§ 12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达丰惠混合型证券投资基金
基金简称	易方达丰惠混合
基金主代码	002602
交易代码	002602
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 3 月 24 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	372,700,581.34 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于固定收益类资产，并通过较灵活的资产配置，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1、本基金将密切关注宏观经济走势，综合考量各类资产的市场容量等因素，确定资产的最优配置比例。2、本基金在债券投资上主要通过久期配置、类属配置、期限结构配置和个券选择四个层次进行投资管理；本基金将选择具有较高投资价值的可转换债券进行投资；本基金将对资金面进行综合分析的基础上，判断利差空间，通过杠杆操作放大组合收益。3、本基金将适度参与股票资产投资。本基金股票投资部分主要采取“自下而上”的投资策略，精选优质企业进行投资。4、本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。5、本基金将主要选择流动性好、交易活跃的股指期货、国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的风险。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×25%+中债新综合指数收益率×70%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号

办公地址	广东省广州市天河区珠江西路 21 号 52 层；广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层；广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	510627；510623；519031	100033
法定代表人	吴欣荣	张金良

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.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江西路 21 号 52 层；广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层；广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 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 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-2,457,298.41
本期利润	-3,758,179.51
加权平均基金份额本期利润	-0.0367
本期加权平均净值利润率	-2.58%
本期基金份额净值增长率	1.23%
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	150,415,064.28
期末可供分配基金份额利润	0.4036
期末基金资产净值	523,115,645.62
期末基金份额净值	1.404
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	45.96%

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	-0.50%	0.37%	3.80%	0.32%	-4.30%	0.05%
过去六个月	1.23%	0.40%	3.43%	0.29%	-2.20%	0.11%
过去一年	5.17%	0.32%	7.53%	0.25%	-2.36%	0.07%
过去三年	16.32%	0.26%	17.16%	0.27%	-0.84%	-0.01%
过去五年	23.28%	0.23%	16.03%	0.27%	7.25%	-0.04%
过去七年	45.09%	0.34%	33.47%	0.28%	11.62%	0.06%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	45.96%	0.43%	48.56%	0.29%	-2.60%	0.14%

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

易方达丰惠混合型证券投资基金

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

(2017 年 3 月 24 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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII 等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
罗川	本基金的基金经理，易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达新享混合、易方达瑞信混合、易方达瑞选混合的基金经理，易方达悦丰稳健债券、易方达稳健增长混合、易方达稳健回报混合、易方达稳健增利混合、易方达安心回报债券的基金经理助理	2025-05-09	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任中金基金管理有限公司研究员、基金经理助理，易方达基金管理有限公司研究员。
周琼	本基金的基金经理助理，易方达悦兴一年持有混合的基金经理，易方达鑫转添利混合、易方达裕丰回报债券、易方达新收益混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达安盈回报混合、易方达安心回报债券、易方达新利混合（自 2019 年 10 月 30 日至 2026 年 03 月 13 日）、易方达新鑫混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞锦混合、易方达悦兴一年持有混合（自 2020 年 12 月 01 日至 2026 年 06 月 12 日）、易方达瑞通混合、易方达全球配置混合（QDII）、易方达丰和债券的基金经理助理	2020-06-09	-	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员。
刘文贵	本基金的基金经理助理，易方达中证 500 量化增强、易方达中证 800 增强的基金经理，投资经理	2025-10-30	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任松河资本管理公司量化研究员，上海泓信投资管理有限公司衍生品投

					资总监，深圳市弘源泰平资产管理有限公司量化投资总监。
--	--	--	--	--	----------------------------

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

- 2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。
- 3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 64 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。

本报告期内，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

2026 年上半年国内经济延续修复，但结构性分化明显。新兴产业景气较高，传统消费与地产板块恢复偏缓。投资端高技术制造业表现积极，基建地产行业仍处调整阶段。外需受全球科技产业扩张支撑，内需偏弱，物价呈输入性结构性分化特征。宏观政策保持积极，货币政策适度宽松，为经济运行提供平稳环境。

上半年债券市场运行偏强，收益率震荡下行。年初政府债券供给放量一度推升利率，随后资金

面改善与配置需求释放推动各期限利率回落。信用债整体表现稳健，利差维持低位，但弱资质品种分化仍较明显。

上半年 A 股结构性行情突出，成长风格表现明显优于价值风格。科技板块交易活跃，通信、电子等领域涨幅领先；消费、地产等传统行业普遍承压。资金集中于少数景气赛道，市场交投活跃但分化严重。

上半年转债市场整体平稳，但个券间收益差异显著。偏股型转债走势与科技主线正股联动性较强，净值波动幅度相对更大，偏债型转债受益于债券市场利率下行而走势稳健。转债估值有所抬升，一级市场供给节奏正常，部分品种性价比随价格上涨有所下降。

债券方面，年初考虑到价格指数回升，组合久期有所下降，二季度观察到内需边际走弱后，久期逐步提升至中性水平，持仓以高等级信用债和金融债为主以获取票息收益，同时积极把握利率债的阶段性机会。

股票方面，组合整体维持了较为稳健和均衡的配置，主要寻找估值偏低、盈利质量较强、交易拥挤度低的股票。在板块和结构上均保持均衡，控制相对基准的偏离，没有过多追逐市场热点，而是以更加长期的视角来获得一个稳健的收益。

转债方面，考虑到当前偏股型转债的估值已经达到历史较高水平，对偏股型转债系统性低配，仅考虑部分低估值的结构性机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.404 元，本报告期份额净值增长率为 1.23%，同期业绩比较基准收益率为 3.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济或延续温和修复，结构性分化持续。新兴产业景气有望维持，传统消费板块与地产板块修复需观察政策落地效果。外部环境有支撑亦有变数，物价上行压力或逐步趋缓。宏观政策预计将平衡稳增长与防风险，信用扩张节奏仍是关键观察变量。

下半年债市收益率或延续低位运行，融资需求恢复节奏存在不确定性。虽然供给端存在阶段性放量可能，但流动性充裕背景下市场承接能力尚可。利率曲线形态或动态变化，票息与久期管理需灵活应对，总体环境仍属友好。

权益市场预计仍以结构性机会为主。科技板块后续表现取决于业绩能否持续兑现，消费与顺周期板块则取决于经济复苏力度。市场风险偏好有望平稳，但板块轮动或加快，波动管理的重要性进一步凸显。

转债市场机遇与挑战并存。偏股型转债品种波动可能加大，偏债型转债有望受益于低利率环境。

当前转债市场估值水平已处相对高位，需精选个券，平衡弹性与防御属性，同时关注条款博弈可能带来的阶段性机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：易方达丰惠混合型证券投资基金

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	1,264,071.77	962,435.16
结算备付金		3,644,889.58	1,385,978.63
存出保证金		1,732,202.94	27,928.18
交易性金融资产	6.4.7.2	686,244,361.10	114,158,881.15
其中：股票投资		74,502,327.10	20,215,050.43
基金投资		-	-
债券投资		611,742,034.00	93,943,830.72
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	-	-383.56
应收清算款		637,599.19	9,758,898.95
应收股利		-	-
应收申购款		69,039.16	24,564.79
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		693,592,163.74	126,318,303.30
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		169,013,985.06	28,304,738.18
应付清算款		-	641.95

应付赎回款		844,393.72	86,007.47
应付管理人报酬		260,083.22	69,559.45
应付托管费		65,020.78	17,389.90
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,790.99	4,192.83
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	283,244.35	88,727.84
负债合计		170,476,518.12	28,571,257.62
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	372,700,581.34	70,457,504.15
未分配利润	6.4.7.8	150,415,064.28	27,289,541.53
净资产合计		523,115,645.62	97,747,045.68
负债和净资产总计		693,592,163.74	126,318,303.30

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.404 元，基金份额总额 372,700,581.34 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达丰惠混合型证券投资基金

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		-2,791,059.32	3,269,225.06
1.利息收入		78,344.37	13,874.35
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,033.41	11,432.69
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		43,310.96	2,441.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,663,640.43	20,238,790.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-3,486,456.19	11,153,652.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,663,405.54	7,856,089.35
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	58,632.09
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-781,339.05	-
股利收益	6.4.7.14	940,749.27	1,170,416.53
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-1,300,881.10	-17,000,685.71

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	95,117.84	17,246.13
减：二、营业总支出		967,120.19	2,487,065.20
1. 管理人报酬		572,599.76	1,195,887.17
2. 托管费		143,149.96	298,971.76
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		160,041.03	875,428.01
其中：卖出回购金融资产支出		160,041.03	875,428.01
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2,795.06	8,233.22
8. 其他费用	6.4.7.18	88,534.38	108,545.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,758,179.51	782,159.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,758,179.51	782,159.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,758,179.51	782,159.86

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达丰惠混合型证券投资基金

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	70,457,504.15	27,289,541.53	97,747,045.68
二、本期期初净资产	70,457,504.15	27,289,541.53	97,747,045.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	302,243,077.19	123,125,522.75	425,368,599.94
（一）、综合收益总额	-	-3,758,179.51	-3,758,179.51
（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）	302,243,077.19	126,883,702.26	429,126,779.45
其中：1.基金申购款	338,805,749.81	142,339,048.55	481,144,798.36

2.基金赎回款	-36,562,672.62	-15,455,346.29	-52,018,018.91
(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	372,700,581.34	150,415,064.28	523,115,645.62
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	240,842,051.81	79,138,335.60	319,980,387.41
二、本期期初净资产	240,842,051.81	79,138,335.60	319,980,387.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-70,906,611.33	-22,271,851.18	-93,178,462.51
(一)、综合收益总额	-	782,159.86	782,159.86
(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)	-70,906,611.33	-23,054,011.04	-93,960,622.37
其中: 1.基金申购款	4,425,137.80	1,373,779.22	5,798,917.02
2.基金赎回款	-75,331,749.13	-24,427,790.26	-99,759,539.39
(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	169,935,440.48	56,866,484.42	226,801,924.90

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：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达丰惠混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]625 号《关于准予易方达丰惠混合型证券投资基金注册的批复》和证券投资基金机构监管部函[2016]3039 号《关于易方达丰惠混合型证券投资基金延期募集备案的回函》进行募集,由易方达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《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 3 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 480,008,347.68 份基金份额,其中认购资金利息折合 52,526.55 份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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》《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>》,中国证券投资基金业协会发布的《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》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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。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、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据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》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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》、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》及财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》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。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。纳税人转让金融商品，以卖出价扣除买入价后的余额计算销售额。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。

至 2027 年 12 月 31 日，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、债券的转让收入免征增值税及金融同业往来利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，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，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，免征增值税直至债券到期。存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

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

（3）企业所得税

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

个人所得税税率为 20%。

基金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，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，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；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。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,264,071.77
等于：本金	1,263,828.74
加：应计利息	243.03
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	1,264,071.77

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		75,687,797.50	-	74,502,327.10	-1,185,470.40
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	178,703,534.97	561,321.41	179,194,651.91	-70,204.47
	银行间市场	429,481,755.74	2,371,982.09	432,547,382.09	693,644.26
	合计	608,185,290.71	2,933,303.50	611,742,034.00	623,439.79
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	683,873,088.21	2,933,303.50	686,244,361.10	-562,030.61

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	-14,085,780.00	-	-	-
IF2612	-14,085,780.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-14,085,780.00	-	-	-

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
IF2612	IF2612	-10	-14,284,200.00	-198,420.00
合计	-	-	-	-198,420.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-198,420.00
净额	-	-	-	-

注：1. 衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

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	1,670.24
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	218,149.90
其中：交易所市场	206,711.40
银行间市场	11,438.50
应付利息	-
预提费用	63,424.21
合计	283,244.35

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	70,457,504.15	70,457,504.15
本期申购	338,805,749.81	338,805,749.81
本期赎回（以“-”号填列）	-36,562,672.62	-36,562,672.62
本期末	372,700,581.34	372,700,581.34

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 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	28,993,636.10	-1,704,094.57	27,289,541.53
本期期初	28,993,636.10	-1,704,094.57	27,289,541.53
本期利润	-2,457,298.41	-1,300,881.10	-3,758,179.51
本期基金份额交易产生的变动数	141,506,820.95	-14,623,118.69	126,883,702.26
其中：基金申购款	157,779,002.47	-15,439,953.92	142,339,048.55
基金赎回款	-16,272,181.52	816,835.23	-15,455,346.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	168,043,158.64	-17,628,094.36	150,415,064.28

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	9,003.48
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	4,982.58
其他	21,047.35
合计	35,033.41

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,486,456.19
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-3,486,456.19

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	247,008,329.51
减：卖出股票成本总额	250,095,003.31
减：交易费用	399,782.39
买卖股票差价收入	-3,486,456.19

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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	1,152,345.22
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	511,060.32
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	1,663,405.54

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	277,995,315.82

总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	275,935,585.06
减：应计利息总额	1,523,750.32
减：交易费用	24,920.12
买卖债券差价收入	511,060.32

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 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	-781,339.05

6.4.7.14 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	940,749.27
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	940,749.27

6.4.7.15 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	-1,102,461.10
——股票投资	-1,359,441.07
——债券投资	256,979.97
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-198,420.00
——权证投资	-
——期货投资	-198,420.00
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	-1,300,881.10

6.4.7.16 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	95,117.84
合计	95,117.84

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 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	23,752.63
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行汇划费	6,510.17
其他	600.00
合计	88,534.38

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的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
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

注：以下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		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	
	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
广发证券	37,676,734.23	6.82%	176,241.29	0.11%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	119,329,423.93	21.87%	-	-

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		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	
	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
广发证券	326,300,000.00	23.34%	-	-

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	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
广发证券	15,879.60	6.61%	2,322.05	1.12%
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
广发证券	64.33	0.09%	-	-

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.本基金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交易服务及研究服务。

3.根据《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，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	572,599.76	1,195,887.17
其中：应支付销售机构的客户维护费	70,714.84	53,181.94
应支付基金管理人的净管理费	501,884.92	1,142,705.23

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.8\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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	143,149.96	298,971.76

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人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

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
中国建设银行-活期存款	1,264,071.77	9,003.48	11,406,650.91	3,549.30

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

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（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
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 113,013,985.06 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102602083	26 华能 MTN003(能源保供特别债)	2026-07-06	100.15	178,000	17,827,085.26
232680003	26 中行二级资本债 01BC	2026-07-06	100.91	200,000	20,181,312.88
232680010	26 兴业银行二级资本债 02	2026-07-06	100.05	87,000	8,704,100.68

242680014	26 招商银行 永续债 02BC	2026-07-06	100.44	100,000	10,043,978.63
242680015	26 中信银行 永续债 02BC	2026-07-06	100.36	200,000	20,072,407.67
242680016	26 光大银行 永续债 02	2026-07-06	100.44	100,000	10,043,542.47
102481079	24 陕西交通 MTN001B	2026-07-07	103.92	50,000	5,195,820.00
102483997	24 安瑞科技 MTN002	2026-07-07	103.67	50,000	5,183,599.73
102602083	26 华能 MTN003(能源 保供特别债)	2026-07-07	100.15	22,000	2,203,347.62
272400007	24 中国人寿 资本补充债 01BC	2026-07-07	102.95	100,000	10,295,002.74
312610001	26 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	2026-07-07	100.71	106,000	10,675,242.57
合计				1,193,000	120,425,440.25

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 56,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”

的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 110.74%(2025 年 12 月 31 日：81.91%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元		
短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	30,171,006.58	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	27,316,788.88	5,028,075.34
合计	57,487,795.46	5,028,075.34

- 注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。
3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元		
短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	473,179,899.62	53,383,078.00
AAA 以下	6,733,859.26	9,366,501.21
未评级	74,340,479.66	26,166,176.17
合计	554,254,238.54	88,915,755.38

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

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在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VaR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,264,071.77	-	-	-	1,264,071.77
结算备付金	3,644,889.58	-	-	-	3,644,889.58
存出保证金	1,732,202.94	-	-	-	1,732,202.94
交易性金融资产	108,450,701.76	323,549,391.96	179,741,940.28	74,502,327.10	686,244,361.10
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	637,599.19	637,599.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	69,039.16	69,039.16
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	115,091,866.05	323,549,391.96	179,741,940.28	75,208,965.45	693,592,163.74
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	169,013,985.06	-	-	-	169,013,985.06
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	844,393.72	844,393.72
应付管理人报酬	-	-	-	260,083.22	260,083.22
应付托管费	-	-	-	65,020.78	65,020.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	9,790.99	9,790.99
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	283,244.35	283,244.35
负债总计	169,013,985.06	-	-	1,462,533.06	170,476,518.12
利率敏感度缺口	-53,922,119.01	323,549,391.96	179,741,940.28	73,746,432.39	523,115,645.62

上年度末 2025 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	962,435.16	-	-	-	962,435.16
结算备付金	1,385,978.63	-	-	-	1,385,978.63
存出保证金	27,928.18	-	-	-	27,928.18
交易性金融资产	5,028,075.34	64,632,275.97	24,283,479.41	20,215,050.43	114,158,881.15
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-383.56	-	-	-	-383.56
应收清算款	-	-	-	9,758,898.95	9,758,898.95
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,564.79	24,564.79
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,404,033.75	64,632,275.97	24,283,479.41	29,998,514.17	126,318,303.30
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	28,304,738.18	-	-	-	28,304,738.18
应付清算款	-	-	-	641.95	641.95
应付赎回款	-	-	-	86,007.47	86,007.47
应付管理人报酬	-	-	-	69,559.45	69,559.45
应付托管费	-	-	-	17,389.90	17,389.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	4,192.83	4,192.83
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	88,727.84	88,727.84
负债总计	28,304,738.18	-	-	266,519.44	28,571,257.62
利率敏感度缺口	-20,900,704.43	64,632,275.97	24,283,479.41	29,731,994.73	97,747,045.68

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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
	1.市场利率下降 25 个基点	4,523,960.93	641,833.13
	2.市场利率上升 25 个基点	-4,469,898.46	-632,908.68

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	74,502,327.10	14.24	20,215,050.43	20.68
交易性金融资产—债券投资	10,238,995.92	1.96	-	-
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	84,741,323.02	16.20	20,215,050.43	20.68

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	13,303,177.08	5,139,860.69
	2.业绩比较基准下降 5%	-13,303,177.08	-5,139,860.69

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	84,730,484.02
第二层次	601,513,877.08
第三层次	-
合计	686,244,361.10

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金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关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

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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，所以其账面价值与公允价值相若。

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	74,502,327.10	10.74
	其中：股票	74,502,327.10	10.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	611,742,034.00	88.20
	其中：债券	611,742,034.00	88.20
	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	4,908,961.35	0.71
8	其他各项资产	2,438,841.29	0.35
9	合计	693,592,163.74	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	119,462.00	0.02
B	采矿业	4,795,666.00	0.92
C	制造业	46,671,872.94	8.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	193,031.00	0.04
E	建筑业	68,232.00	0.01

F	批发和零售业	836,839.30	0.16
G	交通运输、仓储和邮政业	982,680.92	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,591,872.14	1.26
J	金融业	11,113,677.00	2.12
K	房地产业	80,955.00	0.02
L	租赁和商务服务业	396,283.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	2,093,420.80	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	395,158.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,803.00	0.00
Q	卫生和社会工作	56,924.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	83,450.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	74,502,327.10	14.24

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	占基金资产净值 比例（%）
1	688008	澜起科技	6,352	1,968,484.80	0.38
2	688396	华润微	19,890	1,940,269.50	0.37
3	688256	寒武纪	1,157	1,846,051.35	0.35
4	688036	传音控股	31,173	1,837,648.35	0.35
5	601318	中国平安	38,000	1,814,120.00	0.35
6	603259	药明康德	14,500	1,805,395.00	0.35
7	600036	招商银行	50,600	1,796,300.00	0.34
8	601398	工商银行	253,900	1,795,073.00	0.34
9	605117	德业股份	16,900	1,794,442.00	0.34
10	601288	农业银行	292,400	1,774,868.00	0.34
11	600030	中信证券	60,400	1,735,292.00	0.33
12	600406	国电南瑞	72,900	1,665,765.00	0.32
13	688111	金山办公	7,795	1,660,724.75	0.32
14	688271	联影医疗	16,345	1,654,604.35	0.32
15	600522	中天科技	27,100	1,644,428.00	0.31
16	600887	伊利股份	68,500	1,641,260.00	0.31
17	688009	中国通号	343,193	1,633,598.68	0.31
18	688183	生益电子	12,328	1,632,227.20	0.31

19	600183	生益科技	9,400	1,629,960.00	0.31
20	601138	工业富联	22,300	1,608,945.00	0.31
21	600875	东方电气	55,300	1,590,981.00	0.30
22	600741	华域汽车	101,500	1,575,280.00	0.30
23	600489	中金黄金	86,000	1,552,300.00	0.30
24	603993	洛阳钼业	88,300	1,549,665.00	0.30
25	600309	万华化学	22,400	1,532,384.00	0.29
26	601899	紫金矿业	60,800	1,528,512.00	0.29
27	601600	中国铝业	185,500	1,524,810.00	0.29
28	600089	特变电工	62,900	1,415,250.00	0.27
29	603288	海天味业	39,772	1,318,839.52	0.25
30	688012	中微公司	2,785	1,304,772.50	0.25
31	688472	阿特斯	112,257	1,214,620.74	0.23
32	601995	中金公司	33,200	1,200,180.00	0.23
33	600519	贵州茅台	1,000	1,185,490.00	0.23
34	601009	南京银行	74,900	740,761.00	0.14
35	600233	圆通速递	31,200	491,400.00	0.09
36	688981	中芯国际	2,000	317,640.00	0.06
37	600176	中国巨石	2,800	204,064.00	0.04
38	688221	前沿生物	7,113	159,331.20	0.03
39	300801	泰和科技	4,700	151,810.00	0.03
40	688155	先惠技术	1,784	144,307.76	0.03
41	688110	东芯股份	672	136,886.40	0.03
42	300613	富瀚微	1,700	136,136.00	0.03
43	000703	恒逸石化	10,000	135,700.00	0.03
44	300558	贝达药业	2,000	130,140.00	0.02
45	688699	明微电子	1,563	128,087.85	0.02
46	603317	天味食品	9,800	127,498.00	0.02
47	000589	贵州轮胎	31,200	126,672.00	0.02
48	603162	海通发展	13,936	125,005.92	0.02
49	301329	信音电子	5,100	123,879.00	0.02
50	301606	绿联科技	2,000	122,040.00	0.02
51	301358	湖南裕能	1,600	121,392.00	0.02
52	603345	安井食品	1,500	120,285.00	0.02
53	300590	移为通信	8,300	119,105.00	0.02
54	002752	昇兴股份	21,500	118,680.00	0.02
54	605138	盛泰集团	21,500	118,680.00	0.02
56	601061	中信金属	11,000	118,470.00	0.02
57	002120	韵达股份	18,600	118,296.00	0.02
58	688689	银河微电	1,807	116,949.04	0.02
59	603711	香飘飘	10,300	114,433.00	0.02
60	002568	百润股份	6,600	111,672.00	0.02
61	300142	沃森生物	8,400	109,116.00	0.02
62	688002	睿创微纳	703	108,747.07	0.02

63	000810	创维数字	8,000	106,000.00	0.02
64	603579	荣泰健康	6,200	105,214.00	0.02
65	001314	亿道信息	1,700	105,060.00	0.02
66	688475	萤石网络	3,760	102,836.00	0.02
67	002557	洽洽食品	5,600	100,576.00	0.02
68	688599	天合光能	7,088	100,082.56	0.02
69	603719	良品铺子	11,500	99,475.00	0.02
70	000848	承德露露	13,400	99,160.00	0.02
71	002832	比音勒芬	4,800	99,072.00	0.02
72	301371	敷尔佳	3,800	98,800.00	0.02
73	688633	星球石墨	3,277	97,425.21	0.02
74	601933	永辉超市	34,000	96,560.00	0.02
75	002737	葵花药业	8,600	96,406.00	0.02
76	300890	翔丰华	2,900	96,193.00	0.02
77	300921	南凌科技	4,720	95,863.20	0.02
78	688339	亿华通	5,103	95,426.10	0.02
79	002818	富森美	9,100	94,549.00	0.02
80	001309	德明利	100	94,290.00	0.02
81	002154	报喜鸟	26,400	93,984.00	0.02
82	301500	飞南资源	3,600	93,780.00	0.02
83	301261	恒工精密	1,200	93,720.00	0.02
84	001332	锡装股份	2,340	91,891.80	0.02
85	688269	凯立新材	2,890	91,641.90	0.02
86	603551	奥普科技	9,900	89,001.00	0.02
87	000681	视觉中国	4,400	87,736.00	0.02
88	603836	海程邦达	11,100	87,690.00	0.02
89	300504	天邑股份	5,400	87,102.00	0.02
90	300583	赛托生物	7,600	85,348.00	0.02
91	603214	爱婴室	7,000	84,770.00	0.02
92	603273	天元智能	6,500	84,175.00	0.02
93	301170	锡南科技	3,900	83,889.00	0.02
94	301173	毓恬冠佳	2,800	83,188.00	0.02
95	301272	英华特	2,500	82,350.00	0.02
96	002384	东山精密	300	78,705.00	0.02
97	002035	华帝股份	16,500	74,580.00	0.01
98	688670	金迪克	4,268	72,299.92	0.01
99	688355	明志科技	3,455	66,508.75	0.01
100	001201	东瑞股份	5,700	61,902.00	0.01
101	920033	康普化学	4,130	61,578.30	0.01
102	600961	株冶集团	1,900	61,541.00	0.01
103	920167	同享科技	3,600	61,380.00	0.01
104	688176	亚虹医药	6,187	61,375.04	0.01
105	688075	安旭生物	2,051	61,037.76	0.01
106	688137	近岸蛋白	1,692	60,912.00	0.01

107	300915	海融科技	3,000	59,400.00	0.01
108	301203	国泰环保	1,400	59,150.00	0.01
109	002543	万和电气	9,500	59,090.00	0.01
110	002749	国光股份	7,400	59,052.00	0.01
111	603208	江山欧派	5,500	58,850.00	0.01
112	301355	南王科技	6,000	58,680.00	0.01
113	688232	新点软件	3,297	58,620.66	0.01
114	300942	易瑞生物	10,100	58,378.00	0.01
115	600587	新华医疗	4,900	58,212.00	0.01
116	688244	永信至诚	4,075	58,109.50	0.01
117	688393	安必平	3,267	58,087.26	0.01
118	688217	睿昂基因	2,803	57,909.98	0.01
119	603051	鹿山新材	3,000	57,840.00	0.01
120	301386	未来电器	2,800	57,708.00	0.01
121	600308	华泰股份	19,300	57,707.00	0.01
122	601065	江盐集团	8,600	57,706.00	0.01
123	301198	喜悦智行	4,300	57,620.00	0.01
124	603385	惠达卫浴	11,800	57,584.00	0.01
125	603982	泉峰汽车	10,300	57,577.00	0.01
126	688569	铁科轨道	3,563	57,542.45	0.01
127	000637	茂化实华	16,400	57,400.00	0.01
127	002344	海宁皮城	16,400	57,400.00	0.01
129	600697	欧亚集团	5,900	57,348.00	0.01
130	300713	英可瑞	4,500	57,330.00	0.01
131	000731	四川美丰	11,200	57,232.00	0.01
132	688067	爱威科技	2,840	57,226.00	0.01
133	688560	明冠新材	4,820	57,117.00	0.01
134	002873	新天药业	7,800	57,096.00	0.01
135	301578	辰奕智能	2,800	57,092.00	0.01
136	688058	宝兰德	2,727	57,048.84	0.01
137	688613	奥精医疗	4,040	57,004.40	0.01
138	301063	海锅股份	3,400	56,984.00	0.01
139	301229	纽泰格	4,700	56,964.00	0.01
140	300288	朗玛信息	6,400	56,960.00	0.01
141	002677	浙江美大	10,300	56,959.00	0.01
142	301258	富士莱	2,500	56,925.00	0.01
143	301103	何氏眼科	3,800	56,924.00	0.01
144	603102	百合股份	1,800	56,826.00	0.01
145	603107	上海汽配	5,000	56,750.00	0.01
146	301166	优宁维	2,200	56,738.00	0.01
147	605567	春雪食品	7,100	56,729.00	0.01
148	301372	科净源	1,800	56,718.00	0.01
149	603073	彩蝶实业	3,800	56,658.00	0.01
150	300610	晨化股份	5,800	56,550.00	0.01

151	000789	万年青	15,100	56,474.00	0.01
152	603801	志邦家居	10,400	56,472.00	0.01
153	301102	兆讯传媒	6,600	56,430.00	0.01
154	301519	舜禹股份	5,200	56,420.00	0.01
155	301429	森泰股份	3,600	56,412.00	0.01
156	301037	保立佳	4,700	56,400.00	0.01
157	002949	华阳国际	5,700	56,373.00	0.01
158	001260	坤泰股份	3,600	56,340.00	0.01
159	688329	艾隆科技	2,783	56,244.43	0.01
160	002853	皮阿诺	2,800	56,224.00	0.01
161	301088	戎美股份	4,900	56,154.00	0.01
162	920685	新芝生物	5,478	56,149.50	0.01
163	300614	百川畅银	5,800	56,144.00	0.01
164	301515	港通医疗	3,200	56,096.00	0.01
165	920111	聚星科技	1,716	56,078.88	0.01
166	301559	中集环科	4,600	56,074.00	0.01
167	603041	美思德	5,400	55,998.00	0.01
168	603182	嘉华股份	4,900	55,860.00	0.01
169	301100	风光股份	4,000	55,600.00	0.01
170	301359	东南电子	3,500	55,580.00	0.01
171	301206	三元生物	2,500	55,575.00	0.01
172	301567	贝隆精密	1,600	55,376.00	0.01
173	301130	西点药业	2,300	55,154.00	0.01
174	688576	西山科技	1,366	54,435.10	0.01
175	603896	寿仙谷	4,200	54,390.00	0.01
176	001373	翔腾新材	1,800	54,270.00	0.01
177	920819	颖泰生物	20,989	54,151.62	0.01
178	603125	常青科技	1,500	49,110.00	0.01
179	300497	富祥股份	2,200	48,752.00	0.01
180	300953	震裕科技	340	45,458.00	0.01
181	300033	同花顺	180	43,380.00	0.01
182	002810	山东赫达	1,600	39,520.00	0.01
183	688028	沃尔德	234	36,473.58	0.01
184	300604	长川科技	100	34,142.00	0.01
185	688356	键凯科技	440	33,915.20	0.01
186	688307	中润光学	422	33,738.90	0.01
187	300573	兴齐眼药	800	32,608.00	0.01
188	300980	祥源新材	1,100	32,351.00	0.01
189	002468	申通快递	2,200	32,032.00	0.01
190	300358	楚天科技	4,000	32,000.00	0.01
191	003010	若羽臣	1,300	31,590.00	0.01
192	300458	全志科技	800	31,568.00	0.01
193	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.01
194	688045	必易微	387	31,261.86	0.01

195	688321	微芯生物	1,178	31,016.74	0.01
196	688518	联赢激光	1,003	30,992.70	0.01
197	301002	崧盛股份	800	30,880.00	0.01
198	002833	弘亚数控	1,600	30,864.00	0.01
199	002415	海康威视	900	30,780.00	0.01
200	002463	沪电股份	200	30,560.00	0.01
201	300813	泰林生物	1,600	30,544.00	0.01
202	603638	艾迪精密	1,300	30,485.00	0.01
203	002884	凌霄泵业	2,000	30,480.00	0.01
204	688580	伟思医疗	570	30,363.90	0.01
205	301469	恒达新材	1,100	30,338.00	0.01
206	002558	巨人网络	1,100	30,316.00	0.01
206	300357	我武生物	1,300	30,316.00	0.01
208	301110	青木科技	800	30,288.00	0.01
209	002555	三七互娱	1,600	30,192.00	0.01
210	688049	炬芯科技	643	30,163.13	0.01
211	300277	汽轮科技	2,000	30,080.00	0.01
212	002008	大族激光	200	30,022.00	0.01
213	301101	明月镜片	1,100	29,964.00	0.01
214	600211	西藏药业	800	29,912.00	0.01
215	300971	博亚精工	1,600	29,856.00	0.01
216	688410	山外山	2,077	29,825.72	0.01
217	001202	炬申股份	2,200	29,810.00	0.01
218	603998	方盛制药	3,300	29,799.00	0.01
219	300404	博济医药	3,400	29,784.00	0.01
220	600479	千金药业	3,200	29,760.00	0.01
221	603035	常熟汽饰	2,800	29,736.00	0.01
222	920656	海昇药业	2,189	29,726.62	0.01
223	001316	润贝航科	900	29,682.00	0.01
224	688558	国盛智科	903	29,672.58	0.01
225	000989	九芝堂	3,800	29,526.00	0.01
226	603367	辰欣药业	2,300	29,509.00	0.01
227	688557	兰剑智能	950	29,478.50	0.01
228	301043	绿岛风	600	29,466.00	0.01
229	000686	东北证券	3,500	29,400.00	0.01
230	605305	中际联合	700	29,344.00	0.01
231	300725	药石科技	800	29,280.00	0.01
232	600155	华创云信	5,300	29,256.00	0.01
233	300693	盛弘股份	600	29,250.00	0.01
234	688636	智明达	806	29,201.38	0.01
235	001231	农心科技	1,600	29,184.00	0.01
236	002414	高德红外	2,200	29,172.00	0.01
237	300823	建科智能	2,000	29,160.00	0.01
238	300016	北陆药业	3,800	29,146.00	0.01

239	605123	派克新材	300	29,103.00	0.01
240	301159	三维天地	1,000	29,100.00	0.01
241	600167	联美控股	5,200	29,068.00	0.01
242	002956	西麦食品	1,400	29,064.00	0.01
242	301215	中汽股份	5,600	29,064.00	0.01
244	001298	好上好	1,400	29,050.00	0.01
245	000650	仁和药业	5,700	29,013.00	0.01
246	002487	大金重工	500	28,985.00	0.01
247	300132	青松股份	5,100	28,968.00	0.01
248	002283	天润工业	3,000	28,950.00	0.01
249	603659	璞泰来	1,000	28,930.00	0.01
250	603948	建业股份	1,200	28,920.00	0.01
251	002033	丽江股份	3,500	28,910.00	0.01
252	603899	晨光股份	1,400	28,882.00	0.01
253	301507	民生健康	2,400	28,872.00	0.01
254	300662	科锐国际	1,700	28,866.00	0.01
255	000938	紫光股份	1,000	28,860.00	0.01
256	002111	威海广泰	3,200	28,800.00	0.01
257	001368	通达创智	1,400	28,798.00	0.01
258	002376	新北洋	5,000	28,750.00	0.01
259	603187	海容冷链	2,500	28,725.00	0.01
260	300800	力合科技	3,100	28,675.00	0.01
261	002690	美亚光电	2,000	28,660.00	0.01
261	002942	新农股份	2,000	28,660.00	0.01
263	300512	中亚股份	4,200	28,644.00	0.01
264	001336	楚环科技	1,300	28,626.00	0.01
265	002338	奥普光电	500	28,600.00	0.01
266	300658	延江股份	2,500	28,575.00	0.01
267	002063	远光软件	5,600	28,560.00	0.01
267	301097	天益医疗	800	28,560.00	0.01
269	301391	卡莱特	500	28,550.00	0.01
270	300837	浙矿股份	1,200	28,512.00	0.01
271	600523	贵航股份	2,700	28,485.00	0.01
272	002284	亚太股份	3,000	28,470.00	0.01
273	300168	万达信息	6,200	28,458.00	0.01
274	300406	九强生物	2,600	28,418.00	0.01
275	603600	永艺股份	3,200	28,384.00	0.01
276	603018	华设集团	5,520	28,372.80	0.01
277	605060	联德股份	500	28,370.00	0.01
278	000729	燕京啤酒	2,800	28,364.00	0.01
279	000089	深圳机场	4,700	28,341.00	0.01
279	000717	中南股份	14,100	28,341.00	0.01
281	002266	浙富控股	5,600	28,336.00	0.01
282	300738	奥飞数据	1,400	28,308.00	0.01

283	002363	隆基机械	4,700	28,294.00	0.01
284	603987	康德莱	4,100	28,290.00	0.01
285	300253	卫宁健康	4,200	28,266.00	0.01
286	301156	美农生物	2,600	28,262.00	0.01
287	603170	宝立食品	2,500	28,250.00	0.01
288	300645	正元智慧	2,400	28,248.00	0.01
289	301353	普莱得	1,700	28,237.00	0.01
290	002039	黔源电力	1,500	28,230.00	0.01
291	601677	明泰铝业	1,700	28,220.00	0.01
292	002936	郑州银行	17,100	28,215.00	0.01
293	600496	精工钢构	9,100	28,210.00	0.01
294	300389	艾比森	2,200	28,204.00	0.01
295	603966	法兰泰克	3,460	28,199.00	0.01
296	605577	龙版传媒	3,200	28,192.00	0.01
297	002390	信邦制药	10,800	28,188.00	0.01
298	300230	永利股份	6,700	28,140.00	0.01
298	601033	永兴股份	2,100	28,140.00	0.01
300	300988	津荣天宇	1,800	28,134.00	0.01
301	300206	理邦仪器	2,300	28,129.00	0.01
302	600595	中孚实业	5,000	28,100.00	0.01
303	603096	新经典	2,100	28,098.00	0.01
304	600109	国金证券	3,200	28,096.00	0.01
305	002441	众业达	3,600	28,080.00	0.01
305	300817	双飞集团	1,800	28,080.00	0.01
307	002027	分众传媒	5,800	28,072.00	0.01
308	603309	维力医疗	2,500	28,050.00	0.01
309	002275	桂林三金	2,300	28,037.00	0.01
310	603365	水星家纺	1,800	28,026.00	0.01
311	000570	苏常柴 A	6,000	28,020.00	0.01
312	300824	北鼎股份	3,900	28,002.00	0.01
313	603408	建霖家居	2,900	27,985.00	0.01
314	600685	中船防务	1,100	27,984.00	0.01
315	002458	益生股份	3,600	27,972.00	0.01
316	000419	通程控股	6,200	27,962.00	0.01
317	600201	生物股份	2,400	27,960.00	0.01
318	603967	中创物流	2,700	27,945.00	0.01
319	002315	焦点科技	1,200	27,936.00	0.01
320	002511	中顺洁柔	4,200	27,930.00	0.01
321	688543	国科军工	707	27,891.15	0.01
322	603305	旭升集团	2,300	27,876.00	0.01
323	300771	智莱科技	2,700	27,864.00	0.01
324	600064	南京高科	3,900	27,807.00	0.01
325	600425	青松建化	8,500	27,795.00	0.01
326	000552	甘肃能化	12,400	27,776.00	0.01

326	600872	中炬高新	1,600	27,776.00	0.01
328	603508	思维列控	1,300	27,768.00	0.01
329	688681	科汇股份	1,986	27,764.28	0.01
330	002398	垒知集团	7,400	27,750.00	0.01
331	000603	盛达资源	1,200	27,720.00	0.01
331	300012	华测检测	2,000	27,720.00	0.01
331	300529	健帆生物	1,800	27,720.00	0.01
331	301175	中科环保	5,600	27,720.00	0.01
335	600262	北方股份	1,400	27,706.00	0.01
336	601997	贵阳银行	5,400	27,702.00	0.01
337	002985	北摩高科	1,000	27,700.00	0.01
338	002216	三全食品	2,400	27,672.00	0.01
338	603739	蔚蓝生物	2,400	27,672.00	0.01
340	600388	龙净环保	1,900	27,645.00	0.01
341	600271	航天信息	4,200	27,636.00	0.01
342	002841	视源股份	800	27,624.00	0.01
343	300559	佳发教育	2,700	27,621.00	0.01
343	301339	通行宝	2,700	27,621.00	0.01
345	003017	大洋生物	1,200	27,600.00	0.01
345	600499	科达制造	2,000	27,600.00	0.01
345	603788	宁波高发	2,000	27,600.00	0.01
348	600885	宏发股份	800	27,592.00	0.01
349	600037	歌华有线	4,400	27,588.00	0.01
350	603209	兴通股份	2,200	27,566.00	0.01
351	300226	上海钢联	1,800	27,558.00	0.01
352	300098	高新兴	6,000	27,540.00	0.01
352	300768	迪普科技	2,000	27,540.00	0.01
354	603611	诺力股份	1,700	27,523.00	0.01
355	688095	福昕软件	463	27,516.09	0.01
356	002140	东华科技	3,000	27,510.00	0.01
357	301149	隆华新材	2,600	27,508.00	0.01
358	603323	苏农银行	7,100	27,477.00	0.01
359	600323	瀚蓝环境	1,000	27,460.00	0.01
360	603708	家家悦	3,200	27,456.00	0.01
361	600116	三峡水利	4,900	27,440.00	0.01
362	600711	盛屯矿业	2,500	27,425.00	0.01
363	300970	华绿生物	1,500	27,420.00	0.01
364	920415	恒拓开源	2,964	27,417.00	0.01
365	300515	三德科技	2,100	27,405.00	0.01
365	603195	公牛集团	700	27,405.00	0.01
367	301219	腾远钴业	500	27,400.00	0.01
367	605599	莱百股份	2,000	27,400.00	0.01
369	600577	精达股份	2,800	27,384.00	0.01
370	600125	铁龙物流	5,400	27,378.00	0.01

371	600230	沧州大化	2,100	27,342.00	0.01
372	600874	创业环保	5,100	27,336.00	0.01
373	688628	优利德	276	27,307.44	0.01
374	002271	东方雨虹	2,300	27,301.00	0.01
375	920239	长虹能源	1,144	27,295.84	0.01
376	000338	潍柴动力	1,000	27,250.00	0.01
377	301665	泰禾股份	1,300	27,248.00	0.01
378	000581	威孚高科	1,600	27,232.00	0.01
379	603929	亚翔集成	100	27,202.00	0.01
380	000792	盐湖股份	900	27,171.00	0.01
381	301025	读客文化	3,500	27,160.00	0.01
382	002170	芭田股份	2,500	27,150.00	0.01
383	603190	亚通精工	1,200	27,144.00	0.01
384	688021	奥福科技	1,400	27,104.00	0.01
385	301456	盘古智能	1,200	27,096.00	0.01
386	603889	新澳股份	5,300	27,083.00	0.01
387	300445	康斯特	1,300	27,066.00	0.01
388	002448	中原内配	2,200	27,060.00	0.01
389	600452	涪陵电力	2,900	27,057.00	0.01
390	300628	亿联网络	800	27,056.00	0.01
391	603233	大参林	1,800	27,054.00	0.01
392	601333	广深铁路	9,800	26,950.00	0.01
393	001914	招商积余	3,300	26,928.00	0.01
394	603013	亚普股份	1,700	26,843.00	0.01
395	002532	天山铝业	2,500	26,825.00	0.01
396	002518	科士达	500	26,795.00	0.01
397	688258	卓易信息	226	26,790.04	0.01
398	603059	倍加洁	1,100	26,675.00	0.01
399	002043	兔宝宝	2,400	26,592.00	0.01
400	688390	固德威	245	26,584.95	0.01
401	000807	云铝股份	1,200	26,568.00	0.01
402	920174	五新智能	874	26,560.86	0.01
403	603383	顶点软件	1,000	26,560.00	0.01
404	300797	钢研纳克	2,000	26,520.00	0.01
405	000869	张裕 A	1,700	26,486.00	0.01
406	301299	卓创资讯	600	26,436.00	0.01
407	600989	宝丰能源	1,300	26,429.00	0.01
408	001286	陕西能源	2,600	26,364.00	0.01
409	603507	振江股份	800	26,312.00	0.01
410	300236	上海新阳	200	26,300.00	0.01
411	301026	浩通科技	1,300	26,286.00	0.01
412	688717	艾罗能源	318	26,257.26	0.01
413	300919	中伟新材	600	26,250.00	0.01
414	002922	伊戈尔	800	26,240.00	0.01

415	000036	华联控股	6,000	26,220.00	0.01
416	300815	玉禾田	1,600	26,160.00	0.01
417	300432	富临精工	1,300	26,117.00	0.00
418	688275	万润新能	204	26,020.20	0.00
419	300014	亿纬锂能	400	26,012.00	0.00
420	002545	东方铁塔	1,600	25,952.00	0.00
421	000683	博源化工	4,500	25,920.00	0.00
421	601231	环旭电子	800	25,920.00	0.00
423	002648	卫星化学	1,100	25,839.00	0.00
424	688677	海泰新光	254	25,687.02	0.00
425	301510	固高科技	800	25,544.00	0.00
426	603338	浙江鼎力	600	25,500.00	0.00
427	002961	瑞达期货	1,300	25,454.00	0.00
428	603530	神马电力	500	25,450.00	0.00
429	920914	远航精密	1,377	25,336.80	0.00
430	603699	纽威股份	500	25,150.00	0.00
431	301608	博实结	500	25,130.00	0.00
432	600026	中远海能	1,400	25,116.00	0.00
433	300855	图南股份	800	25,008.00	0.00
434	600801	华新建材	1,600	24,960.00	0.00
435	300438	鹏辉能源	300	24,855.00	0.00
436	002645	华宏科技	900	24,759.00	0.00
437	002838	道恩股份	800	24,496.00	0.00
438	601121	宝地矿业	4,300	24,252.00	0.00
439	603799	华友钴业	500	24,130.00	0.00
440	605189	富春染织	2,000	24,100.00	0.00
441	300073	当升科技	500	24,020.00	0.00
442	002602	世纪华通	1,700	23,970.00	0.00
443	301031	中熔电气	200	23,890.00	0.00
444	601233	桐昆股份	1,100	23,815.00	0.00
445	001389	广合科技	100	23,725.00	0.00
446	000933	神火股份	1,100	23,320.00	0.00
447	301345	涛涛车业	100	23,100.00	0.00
448	601872	招商轮船	1,300	22,841.00	0.00
449	600661	昂立教育	3,300	22,803.00	0.00
450	603186	华正新材	100	22,530.00	0.00
451	600487	亨通光电	200	21,868.00	0.00
452	301613	新铝时代	600	21,858.00	0.00
453	603228	景旺电子	300	21,723.00	0.00
454	000709	河钢股份	11,100	21,534.00	0.00
455	600968	海油发展	6,400	21,312.00	0.00
456	600900	长江电力	800	21,176.00	0.00
457	002946	新乳业	1,500	21,120.00	0.00
458	301086	鸿富瀚	100	20,928.00	0.00

459	301662	宏工科技	200	20,264.00	0.00
460	300127	银河磁体	700	19,565.00	0.00
461	601168	西部矿业	700	18,998.00	0.00
462	002222	福晶科技	200	18,456.00	0.00
463	300773	拉卡拉	1,200	18,360.00	0.00
464	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.00
465	002533	金杯电工	1,600	17,072.00	0.00
466	300408	三环集团	100	16,690.00	0.00
467	301388	欣灵电气	700	16,324.00	0.00
468	600755	厦门国贸	2,900	15,718.00	0.00
469	600600	青岛啤酒	300	15,669.00	0.00
470	301172	君逸数码	600	15,570.00	0.00
471	000975	山金国际	900	15,300.00	0.00
472	688117	圣诺生物	564	15,244.92	0.00
473	002497	雅化集团	700	14,259.00	0.00
474	002975	博杰股份	100	14,200.00	0.00
475	002375	亚厦股份	4,000	13,520.00	0.00
476	603587	地素时尚	1,200	13,332.00	0.00
477	002493	荣盛石化	1,200	12,900.00	0.00
478	603101	汇嘉时代	1,900	11,856.00	0.00
479	600704	物产中大	2,500	11,800.00	0.00
480	000001	平安银行	1,000	10,050.00	0.00
481	001266	宏英智能	200	9,820.00	0.00
482	000951	中国重汽	500	9,755.00	0.00
483	600733	北汽蓝谷	2,000	9,740.00	0.00
484	605099	共创草坪	300	9,660.00	0.00
485	002080	中材科技	100	9,000.00	0.00
486	300726	宏达电子	100	8,457.00	0.00
487	000949	新乡化纤	1,300	8,242.00	0.00
488	600501	航天晨光	500	7,865.00	0.00
489	300452	山河药辅	500	5,840.00	0.00
490	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
491	002948	青岛银行	1,100	5,588.00	0.00
492	000534	万泽股份	200	5,472.00	0.00
493	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.00
494	603606	东方电缆	120	4,981.20	0.00
495	002429	兆驰股份	400	4,156.00	0.00
496	002299	圣农发展	200	3,032.00	0.00
497	300119	瑞普生物	200	2,886.00	0.00
498	605016	百龙创园	100	2,585.00	0.00
499	601658	邮储银行	500	2,465.00	0.00
500	301283	聚胶股份	100	2,448.00	0.00
501	600925	苏能股份	600	2,406.00	0.00
502	600598	北大荒	200	2,168.00	0.00

503	001378	德冠新材	100	1,791.00	0.00
504	600694	大商股份	110	1,455.30	0.00
505	603223	恒通股份	100	1,305.00	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	688256	寒武纪	5,337,749.78	5.46
2	601318	中国平安	5,077,716.00	5.19
3	600188	兖矿能源	4,492,754.00	4.60
4	600546	山煤国际	4,370,328.00	4.47
5	603565	中谷物流	3,917,091.00	4.01
6	601857	中国石油	3,785,975.00	3.87
7	601168	西部矿业	3,777,060.00	3.86
8	600519	贵州茅台	3,765,047.00	3.85
9	601009	南京银行	3,613,275.12	3.70
10	600938	中国海油	3,520,814.00	3.60
11	601077	渝农商行	3,488,537.00	3.57
12	601000	唐山港	3,410,271.00	3.49
13	601916	浙商银行	3,395,416.00	3.47
14	601899	紫金矿业	3,364,949.00	3.44
15	601668	中国建筑	3,344,254.00	3.42
16	601997	贵阳银行	3,337,582.00	3.41
17	600273	嘉化能源	3,324,527.00	3.40
18	600295	鄂尔多斯	3,316,595.00	3.39
19	600398	海澜之家	3,301,510.00	3.38
20	688008	澜起科技	3,288,044.06	3.36
21	600096	云天化	3,238,270.00	3.31
22	600064	南京高科	3,141,000.40	3.21
23	601328	交通银行	3,076,084.00	3.15
24	600036	招商银行	3,051,493.00	3.12
25	688041	海光信息	3,050,822.68	3.12
26	603967	中创物流	3,016,825.00	3.09
27	600887	伊利股份	2,969,892.00	3.04
28	600971	恒源煤电	2,821,618.00	2.89
29	600919	江苏银行	2,724,691.00	2.79
30	601088	中国神华	2,699,307.44	2.76
31	600030	中信证券	2,476,684.00	2.53
32	688012	中微公司	2,439,917.75	2.50
33	601288	农业银行	2,437,682.00	2.49
34	601398	工商银行	2,405,155.00	2.46

35	603259	药明康德	2,344,216.00	2.40
36	603993	洛阳钼业	2,340,554.00	2.39
37	688396	华润微	2,292,147.53	2.34
38	601339	百隆东方	2,261,149.00	2.31
39	605599	菜百股份	2,256,038.00	2.31
40	601577	长沙银行	2,247,409.00	2.30
41	600210	紫江企业	2,230,431.00	2.28
42	600028	中国石化	2,167,029.00	2.22
43	601998	中信银行	2,161,033.00	2.21
44	600406	国电南瑞	2,011,529.00	2.06
45	688111	金山办公	2,009,726.19	2.06
46	600309	万华化学	2,006,374.00	2.05
47	600177	雅戈尔	1,993,374.00	2.04
48	600741	华域汽车	1,983,318.00	2.03

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	603565	中谷物流	4,135,557.50	4.23
2	600546	山煤国际	3,816,518.00	3.90
3	601168	西部矿业	3,781,337.34	3.87
4	688256	寒武纪	3,659,913.02	3.74
5	601857	中国石油	3,452,908.90	3.53
6	600188	兖矿能源	3,432,594.00	3.51
7	601077	渝农商行	3,357,447.00	3.43
8	601916	浙商银行	3,325,909.00	3.40
9	601000	唐山港	3,302,145.00	3.38
10	601668	中国建筑	3,288,063.00	3.36
11	600096	云天化	3,276,616.00	3.35
12	688041	海光信息	3,230,185.48	3.30
13	600398	海澜之家	3,219,972.80	3.29
14	600295	鄂尔多斯	3,195,268.00	3.27
15	600273	嘉化能源	3,180,398.00	3.25
16	600064	南京高科	3,171,772.00	3.24
17	601997	贵阳银行	3,102,052.00	3.17
18	601328	交通银行	3,075,956.00	3.15
19	600938	中国海油	3,030,231.00	3.10
20	601318	中国平安	2,930,749.00	3.00
21	603967	中创物流	2,736,124.00	2.80
22	600919	江苏银行	2,705,132.00	2.77
23	601009	南京银行	2,681,513.00	2.74

24	600519	贵州茅台	2,501,941.00	2.56
25	600971	恒源煤电	2,469,609.00	2.53
26	601088	中国神华	2,316,864.99	2.37
27	600210	紫江企业	2,283,528.00	2.34
28	601339	百隆东方	2,235,497.00	2.29
29	601577	长沙银行	2,182,317.00	2.23
30	601998	中信银行	2,147,125.00	2.20
31	600028	中国石化	2,130,917.00	2.18
32	605599	菜百股份	2,112,358.00	2.16
33	600177	雅戈尔	1,993,214.80	2.04

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

7.4.3 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	305,741,721.05
卖出股票收入（成交）总额	247,008,329.51

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	2,018,177.37	0.39
2	央行票据	-	-
3	金融债券	429,140,480.11	82.04
	其中：政策性金融债	25,298,611.51	4.84
4	企业债券	106,723,029.85	20.40
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	58,492,136.66	11.18
7	可转债（可交换债）	10,238,995.92	1.96
8	同业存单	-	-
9	其他	5,129,214.09	0.98
10	合计	611,742,034.00	116.94

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	312610005	26 交行 TLAC 非资本债 01BC	350,000	35,147,095.89	6.72
2	2228004	22 工商银行二级 01	300,000	30,730,387.40	5.87
3	212480009	24 上海银行债 01	300,000	30,359,694.25	5.80
4	244641	26 中证 S1	300,000	30,171,006.58	5.77
5	2128047	21 招商银行永续债	200,000	20,603,212.05	3.94

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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的进行股指期货投资，主要选择流动性好的股指期货品种进行交易，调节组合的权益仓位和结构。

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**

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局、中国人民银行的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾

受到国家金融监督管理总局的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局云南监管局、中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	1,732,202.94
2	应收清算款	637,599.19
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	69,039.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,438,841.29

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127045	牧原转债	355,597.06	0.07
2	113067	燃 23 转债	354,182.25	0.07
3	113070	渝水转债	354,072.78	0.07
4	113052	兴业转债	353,319.07	0.07
5	127083	山路转债	353,036.12	0.07
6	127110	广核转债	352,946.60	0.07
7	113062	常银转债	349,977.45	0.07

8	127056	中特转债	349,723.03	0.07
9	113056	重银转债	345,053.21	0.07
10	110093	神马转债	337,229.09	0.06
11	127064	杭氧转债	182,747.57	0.03
12	110098	南药转债	178,422.51	0.03
13	127040	国泰转债	178,421.24	0.03
14	127108	太能转债	176,950.87	0.03
15	127102	浙建转债	176,531.08	0.03
16	110087	天业转债	176,447.91	0.03
17	113631	皖天转债	176,031.95	0.03
18	110099	福能转债	175,530.51	0.03
19	123257	安克转债	174,814.75	0.03
20	113054	绿动转债	174,323.03	0.03
21	118034	晶能转债	174,080.60	0.03
22	127067	恒逸转 2	151,781.96	0.03
23	127046	百润转债	122,224.78	0.02
24	110084	贵燃转债	122,211.66	0.02
25	123119	康泰转 2	121,864.26	0.02
26	113696	伯 25 转债	120,900.00	0.02
27	111017	蓝天转债	120,837.78	0.02
28	111002	特纸转债	120,718.50	0.02
29	113661	福 22 转债	120,302.45	0.02
30	123149	通裕转债	119,523.06	0.02
31	127082	亚科转债	118,978.81	0.02
32	110097	天润转债	118,434.58	0.02
33	113652	伟 22 转债	118,303.68	0.02
34	118024	冠宇转债	118,219.85	0.02
35	113655	欧 22 转债	118,013.38	0.02
36	127054	双箭转债	117,934.86	0.02
37	118031	天 23 转债	117,693.69	0.02
38	113058	友发转债	117,527.15	0.02
39	113627	太平转债	117,239.51	0.02
40	113659	莱克转债	116,816.81	0.02
41	118022	锂科转债	116,329.61	0.02
42	110086	精工转债	115,636.24	0.02
43	111020	合顺转债	61,727.22	0.01
44	110095	双良转债	61,623.49	0.01
45	113656	嘉诚转债	61,424.97	0.01
46	123165	回天转债	61,413.48	0.01
47	113640	苏利转债	60,768.85	0.01
48	111015	东亚转债	60,701.80	0.01
49	123195	蓝晓转 02	60,658.36	0.01
50	127061	美锦转债	60,577.78	0.01
51	118042	奥维转债	60,223.14	0.01

52	127060	湘佳转债	60,121.08	0.01
53	123216	科顺转债	59,979.28	0.01
54	118010	洁特转债	59,923.00	0.01
55	113679	芯能转债	59,851.78	0.01
56	123183	海顺转债	59,839.46	0.01
57	123150	九强转债	59,797.72	0.01
58	123189	晓鸣转债	59,778.86	0.01
59	113650	博 22 转债	59,741.70	0.01
60	127044	蒙娜转债	59,724.26	0.01
61	123122	富瀚转债	59,697.99	0.01
62	123138	丝路转债	59,574.25	0.01
63	111021	奥锐转债	59,435.14	0.01
64	111004	明新转债	59,309.40	0.01
65	123253	永贵转债	59,243.87	0.01
66	123172	漱玉转债	59,197.84	0.01
67	113636	甬金转债	59,177.65	0.01
68	123215	铭利转债	58,976.48	0.01
69	127098	欧晶转债	58,807.00	0.01
70	123155	中陆转债	58,794.58	0.01
71	113643	风语转债	58,203.02	0.01
72	123154	火星转债	58,152.47	0.01
73	123250	嘉益转债	58,151.68	0.01
74	123252	银邦转债	57,995.90	0.01
75	113665	汇通转债	57,923.37	0.01
76	111018	华康转债	57,763.03	0.01
77	113658	密卫转债	57,702.11	0.01
78	123171	共同转债	56,888.23	0.01
79	123144	裕兴转债	56,877.63	0.01

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情况。

§ 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

3,737	99,732.56	341,860,850.27	91.73%	30,839,731.07	8.27%
-------	-----------	----------------	--------	---------------	-------

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	68.60%

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	19,766.93	0.0053%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 3 月 24 日）基金份额总额	480,008,347.68
本报告期期初基金份额总额	70,457,504.15
本报告期基金总申购份额	338,805,749.81
减：本报告期基金总赎回份额	36,562,672.62

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	372,700,581.34

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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，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，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，基金托管人未受到调查或处罚。

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，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

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	

财通证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	25,958,690.85	4.70%	11,318.42	4.71%	-
东方财富	1	112,450,738.96	20.36%	49,028.40	20.40%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	7,987,052.29	1.45%	3,483.07	1.45%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	37,676,734.23	6.82%	15,879.60	6.61%	-
国海证券	1	21,725,963.87	3.93%	9,472.43	3.94%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通	2	5,927,108.68	1.07%	2,584.23	1.08%	-
国投证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	7,647,453.00	1.38%	3,334.24	1.39%	-
华泰证券	2	259,481,344.37	46.97%	113,134.11	47.08%	-
华西证券	2	7,571,682.00	1.37%	3,301.40	1.37%	-
华源证券	1	6,633,440.37	1.20%	2,892.15	1.20%	-
汇丰前海	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	54,936,607.47	9.94%	23,953.30	9.97%	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	4,410,806.85	0.80%	1,923.04	0.80%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：a）本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为信达证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为开源证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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	
	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
财通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	26,593,269.45	4.87%	66,000.00	0.00%	-	-
东方财富	20,807,926.43	3.81%	98,500,000.00	7.05%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	21,447,416.83	3.93%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	119,329,423.93	21.87%	326,300,000.00	23.34%	-	-
国海证券	60,734,467.65	11.13%	135,000,000.00	9.66%	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	18,497,228.23	3.39%	103,900,000.00	7.43%	-	-

国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	10,569,997.67	1.94%	-	-	-	-
华泰证券	138,785,138.84	25.43%	599,766,000.00	42.91%	-	-
华西证券	10,931,894.96	2.00%	6,600,000.00	0.47%	-	-
华源证券	13,500,795.13	2.47%	71,900,000.00	5.14%	-	-
汇丰前海	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	93,170,781.35	17.07%	19,200,000.00	1.37%	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	11,296,077.05	2.07%	36,500,000.00	2.61%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08

3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
4	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
5	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
6	易方达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（2025 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22
9	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
10	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
11	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
12	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-29
13	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23

§ 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. 中国证监会准予易方达丰惠混合型证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达丰惠混合型证券投资基金基金合同》；

- 3.《易方达丰惠混合型证券投资基金托管协议》;
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日