

易方达科汇灵活配置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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
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所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51

7.12 投资组合报告附注	51
§ 8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 盈利投资者数量占比	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9 开放式基金份额变动	53
§ 10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4 基金投资策略的改变	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	54
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	54
10.8 其他重大事件	55
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
§ 12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	易方达科汇灵活配置混合
基金主代码	110012
交易代码	110012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 9 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	329,375,845.99 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于价值型股票和固定收益品种，追求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	资产配置方面，本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资方面，本基金主要投资价值型股票。债券投资方面，本基金主要通过平均久期配置、期限结构配置、类属配置和信用风险管理进行投资管理。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。
业绩比较基准	沪深 300 价值指数收益率×60%+中债总指数收益率×40%
风险收益特征	本基金是混合型基金，理论上其风险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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	方圆
	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38798812	021-62701216
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号

邮政编码	510627；510623；519031	200336
法定代表人	吴欣荣	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	184,763,089.75
本期利润	275,066,028.88
加权平均基金份额本期利润	0.8556
本期加权平均净值利润率	24.65%
本期基金份额净值增长率	34.81%
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	985,431,419.61
期末可供分配基金份额利润	2.9918
期末基金资产净值	1,304,397,599.13
期末基金份额净值	3.960
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	810.00%

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	15.69%	1.52%	-3.95%	0.51%	19.64%	1.01%
过去六个月	34.81%	1.51%	-6.19%	0.53%	41.00%	0.98%
过去一年	86.23%	1.41%	-4.69%	0.46%	90.92%	0.95%
过去三年	74.93%	1.21%	7.96%	0.56%	66.97%	0.65%
过去五年	73.47%	1.09%	-1.25%	0.62%	74.72%	0.47%
过去七年	253.71%	1.09%	1.04%	0.64%	252.67%	0.45%
过去十年	274.93%	1.02%	25.30%	0.64%	249.63%	0.38%
自基金合同生效起至今	810.00%	1.25%	79.78%	0.84%	730.22%	0.41%

3.2.2 自基金转型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

易方达科汇灵活配置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

(2008 年 10 月 9 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：本基金由原基金科汇于 2008 年 10 月 9 日转型而来。

§ 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		
胡天乐	本基金的基金经理，行业研究员	2025-09-17	-	6 年	博士研究生，具有基金从业资格。
张凯颀	本基金的基金经理助理，易方达岁丰添利债券（LOF）的基金经理，易方达双债增强债券、易方达投资级信用债债券、易方达增强回报债券、易方达高等级信用债债券、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券、易方达裕祥回报债券、易方达稳健增长混合、易方达平稳增长混合、易方达稳健回报混合、易方达稳健增利混合、易方达稳健添利混合（自 2022 年 01 月 11 日至 2026 年 05 月 25 日）、易方达裕惠定开混合、易方达恒安稳健 6 个月持有债券的基金经理助理	2021-05-15	-	15 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任工银瑞信基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司债券交易员。

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/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，A 股市场整体呈现结构性牛市特征，上证指数上涨 3.16%、沪深 300 指数上涨 7.55%、创业板指数上涨 35.58%。在上半年的申万一级行业中，电子、通信和建筑材料涨幅居前，且显著领先于其他行业；美容护理、农林牧渔以及商贸零售等行业表现靠后。

报告期内，组合管理始终围绕“进攻与防守”的动态平衡展开。一方面，我们在市场波动放大、部分热门资产交易拥挤度上升的阶段主动控制组合风险，降低了净值波动和回撤压力；另一方面，我们也在持续反思和迭代对时代产业主线的理解，逐步认识到，在产业趋势持续强化的阶段，市场共识本身并不必然构成风险，真正需要警惕的是产业兑现节奏、估值水平、交易结构与预期之间的不匹配。

因此，上半年组合既保持了对“答案已经开始浮现、但尚未被充分定价”资产的寻找，也适度提高了对时代产业贝塔的参与度。我们尽量避免在短期情绪过热、远期叙事被过度前置定价时承担过高波动。回顾上半年，市场环境持续挑战着我们既有的投资范式，也促使我们反复思考与平衡投资收益的弹性与可预期性。

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 3.960 元，本报告期份额净值增长率为 34.81%，同期业绩比较基准收益率为-6.19%。

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，我们认为市场的投资难度可能较上半年进一步提升。人工智能等时代级产业趋势仍在快速演进，但是经过前期较大幅度上涨后，部分核心资产的预期与估值已经明显抬升，市场对产业趋势的定价也更加充分，未来股价表现将对业绩兑现、景气持续性和资金结构变化更为敏感。与此同时，我们也注意到很多行业在资金虹吸效应下，股价已经呈现出不错的性价比。

面对可能更高的市场波动和更复杂的定价环境，我们会在保持进攻能力的同时，更加关注收益的可持续性、超额收益的稳定性以及极端情景下的回撤控制，努力把投资中的复杂问题留给自己，把相对简单、平稳的持有体验留给持有人。

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

本基金本报告期内实施的利润分配金额为 30,228,513.55 元。

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，基金托管人在易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽

的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，易方达基金管理有限公司在易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达科汇灵活配置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	362,578,157.45	85,199,202.77
结算备付金		14,436,000.63	2,816,104.97
存出保证金		1,424,863.67	422,215.57
交易性金融资产	6.4.7.2	1,003,363,988.60	583,116,532.31
其中：股票投资		892,142,498.53	521,552,639.64
基金投资		-	-
债券投资		111,221,490.07	61,563,892.67
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	-	-
应收清算款		-	5,197,123.45
应收股利		-	-
应收申购款		1,235,604.47	556,328.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,383,038,614.82	677,307,507.78

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		64,851,111.94	-
应付赎回款		6,868,436.06	3,489,346.36
应付管理人报酬		1,191,859.92	669,484.19
应付托管费		198,643.31	111,580.67
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		596.87	1,657.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	5,530,367.59	1,750,762.42
负债合计		78,641,015.69	6,022,830.66
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	318,966,179.52	211,629,474.79
未分配利润	6.4.7.8	985,431,419.61	459,655,202.33
净资产合计		1,304,397,599.13	671,284,677.12
负债和净资产总计		1,383,038,614.82	677,307,507.78

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.960 元，基金份额总额 329,375,845.99 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达科汇灵活配置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		282,860,427.82	27,813,557.81
1.利息收入		445,369.19	396,459.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	445,369.19	277,860.68
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		-	118,598.98
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		191,503,579.29	11,040,485.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	170,252,442.48	6,130,613.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	17,997,965.08	-551,361.48

资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	3,253,171.73	5,461,234.19
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	90,302,939.13	16,260,750.70
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	608,540.21	115,861.60
减：二、营业总支出		7,794,398.94	5,625,591.29
1. 管理人报酬		6,578,331.66	4,710,643.40
2. 托管费		1,096,388.69	785,107.19
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		482.48	127.08
8. 其他费用	6.4.7.18	119,196.11	129,713.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		275,066,028.88	22,187,966.52
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		275,066,028.88	22,187,966.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		275,066,028.88	22,187,966.52

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达科汇灵活配置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	211,629,474.79	459,655,202.33	671,284,677.12
二、本期期初净资产	211,629,474.79	459,655,202.33	671,284,677.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	107,336,704.73	525,776,217.28	633,112,922.01
（一）、综合收益总额	-	275,066,028.88	275,066,028.88

(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)	107,336,704.73	280,938,701.95	388,275,406.68
其中: 1.基金申购款	266,264,165.46	692,063,026.13	958,327,191.59
2.基金赎回款	-158,927,460.73	-411,124,324.18	-570,051,784.91
(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)	-	-30,228,513.55	-30,228,513.55
四、本期期末净资产	318,966,179.52	985,431,419.61	1,304,397,599.13
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	415,227,889.14	536,771,354.40	951,999,243.54
二、本期期初净资产	415,227,889.14	536,771,354.40	951,999,243.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-113,747,904.50	-124,931,834.78	-238,679,739.28
(一)、综合收益总额	-	22,187,966.52	22,187,966.52
(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)	-113,747,904.50	-147,119,801.30	-260,867,705.80
其中: 1.基金申购款	6,963,350.31	8,764,683.53	15,728,033.84
2.基金赎回款	-120,711,254.81	-155,884,484.83	-276,595,739.64
(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	301,479,984.64	411,839,519.62	713,319,504.26

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

易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金（简称“本基金”）由科汇证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会证监许可[2008]1140 号文《关于核准科汇证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》，科汇证券投资基金由封闭式基金转型为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金”。自 2008 年 10 月 9 日科汇证券投资基金在深圳证券交易所终止上市之日起，由《科汇证券投资基金基金合同》修订而成的《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。本基金为开放式基金，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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》的有关规定，易方达基金管理有限公司于 2008 年 11 月 7 日对原基金科汇退市时的基金份额进行了份额拆分，拆分比例为 1：1.032996474，并由注册登记机构进行了持有人份额的登记确认。

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》、国务院令第 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	362,578,157.45
等于：本金	362,563,359.54
加：应计利息	14,797.91
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	362,578,157.45

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	764,120,253.87	-	892,142,498.53	128,022,244.66
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所 市场	103,873,061.58	116,997.76	111,221,490.07	7,231,430.73
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	103,873,061.58	116,997.76	111,221,490.07	7,231,430.73
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		867,993,315.45	116,997.76	1,003,363,988.60	135,253,675.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末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	500,000.00
应付赎回费	22,605.17
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,915,179.11
其中：交易所市场	4,915,179.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	92,583.31
其他应付款	-

合计	5,530,367.59
----	--------------

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	218,536,215.18	211,629,474.79
本期申购	274,954,821.89	266,264,165.46
本期赎回（以“-”号填列）	-164,115,191.08	-158,927,460.73
本期末	329,375,845.99	318,966,179.52

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	538,168,977.27	-78,513,774.94	459,655,202.33
本期期初	538,168,977.27	-78,513,774.94	459,655,202.33
本期利润	184,763,089.75	90,302,939.13	275,066,028.88
本期基金份额交易产生的变动数	319,192,291.49	-38,253,589.54	280,938,701.95
其中：基金申购款	786,948,566.76	-94,885,540.63	692,063,026.13
基金赎回款	-467,756,275.27	56,631,951.09	-411,124,324.18
本期已分配利润	-30,228,513.55	-	-30,228,513.55
本期末	1,011,895,844.96	-26,464,425.35	985,431,419.61

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	420,740.90
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	14,257.44
其他	10,370.85
合计	445,369.19

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	170,252,442.48

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	170,252,442.48

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	7,656,788,373.36
减：卖出股票成本总额	7,475,002,411.59
减：交易费用	11,533,519.29
买卖股票差价收入	170,252,442.48

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	138,218.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,859,746.49
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	17,997,965.08

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）成交总额	1,276,090,111.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,256,250,567.96
减：应计利息总额	1,876,500.52
减：交易费用	103,296.05
买卖债券差价收入	17,859,746.49

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

本基金本报告期无衍生工具收益。

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	3,253,171.73
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	3,253,171.73

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	90,302,939.13
——股票投资	92,073,518.76
——债券投资	-1,770,579.63
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	90,302,939.13

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	608,540.21
合计	608,540.21

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	33,075.94
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
银行汇划费	8,012.80
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	119,196.11

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
交通银行股份有限公司	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
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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	253,706,838.81	1.65%	-	-

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	75,326,853.87	2.92%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	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	104,436.57	1.56%	82,856.81	1.69%
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
-	-	-	-	-

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	6,578,331.66	4,710,643.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,402,239.94	1,078,745.65
应支付基金管理人的净管理费	5,176,091.72	3,631,897.75

注：本基金的管理费率为年费率 1.2%。

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

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	1,096,388.69	785,107.19

注：本基金的托管费率为年费率 0.2%。

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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

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
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	14,174,480.69	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	14,174,480.69	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.3034%	-

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达资产管理有限公司	1,269,505.42	0.3854%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行-活期存款	362,578,157.45	420,740.90	138,145,001.63	272,309.66

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通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

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
广发证券股 份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
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
-	-	-	-	-	-

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

单位：人民币元

序号	权益登记 日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	本期利润分 配合计	备注
		场 内	场 外					
1	2026-01-09	-	2026- 01-09	1.380	14,105,080.0 6	16,123,433.4 9	30,228,513.5 5	-
合计				1.380	14,105,080.0 6	16,123,433.4 9	30,228,513.5 5	-

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
00122	世盟	2026-0	6 个月	新股	28.00	27.78	57	1,596.	1,583.	-

0	股份	1-27		流通受限				00	46	
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	1,000	10,110.00	10,110.00	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-

301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	690	7,714.20	12,137.10	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	32,210	277,650.20	1,849,498.20	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-

				受限						
688790	昂瑞微	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	1,884	156,485.04	238,231.80	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	2,560	292,556.80	1,732,966.40	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	1,864	195,086.24	1,433,210.96	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,523	29,972.64	215,489.27	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026-06-24	1 个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.00	3,590	359,000.00	359,005.50	-

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为 0，无抵押债券。

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为 0，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“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。

本基金是混合型基金，理论上其风险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 8.53%(2025 年 12 月 31 日：9.17%)。

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	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

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	0.00	0.00
AAA 以下	111,221,490.07	60,137,620.80
未评级	0.00	1,426,271.87
合计	111,221,490.07	61,563,892.67

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	362,578,157.45	-	-	-	362,578,157.45
结算备付金	14,436,000.63	-	-	-	14,436,000.63
存出保证金	1,424,863.67	-	-	-	1,424,863.67
交易性金融资产	-	71,805,451.72	39,416,038.35	892,142,498.53	1,003,363,988.60
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,235,604.47	1,235,604.47
递延所得税资产	-	-	-	-	-

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	378,439,021.75	71,805,451.72	39,416,038.35	893,378,103.00	1,383,038,614.82
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	64,851,111.94	64,851,111.94
应付赎回款	-	-	-	6,868,436.06	6,868,436.06
应付管理人报酬	-	-	-	1,191,859.92	1,191,859.92
应付托管费	-	-	-	198,643.31	198,643.31
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	596.87	596.87
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	5,530,367.59	5,530,367.59
负债总计	-	-	-	78,641,015.69	78,641,015.69
利率敏感度缺口	378,439,021.75	71,805,451.72	39,416,038.35	814,737,087.31	1,304,397,599.13
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	85,199,202.77	-	-	-	85,199,202.77
结算备付金	2,816,104.97	-	-	-	2,816,104.97
存出保证金	422,215.57	-	-	-	422,215.57
交易性金融资产	16,824,284.19	44,739,608.48	-	521,552,639.64	583,116,532.31
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	5,197,123.45	5,197,123.45
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	556,328.71	556,328.71

递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	105,261,807.50	44,739,608.48	-	527,306,091.80	677,307,507.78
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	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	3,489,346.36	3,489,346.36
应付管理人报酬	-	-	-	669,484.19	669,484.19
应付托管费	-	-	-	111,580.67	111,580.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	1,657.02	1,657.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,750,762.42	1,750,762.42
负债总计	-	-	-	6,022,830.66	6,022,830.66
利率敏感度缺口	105,261,807.50	44,739,608.48	-	521,283,261.14	671,284,677.12

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

本期末本基金未持有交易性债券投资（不包括可转债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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	892,142,498.53	68.39	521,552,639.64	77.69
交易性金融资产—债券投资	111,221,490.07	8.53	-	-
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	1,003,363,988.60	76.92	521,552,639.64	77.69

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%	33,149,341.49	42,555,720.84
	2.业绩比较基准下降 5%	-33,149,341.49	-42,555,720.84

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	995,064,642.82
第二层次	369,115.50
第三层次	7,930,230.28
合计	1,003,363,988.60

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	892,142,498.53	64.51
	其中：股票	892,142,498.53	64.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	111,221,490.07	8.04
	其中：债券	111,221,490.07	8.04
	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	377,014,158.08	27.26
8	其他各项资产	2,660,468.14	0.19
9	合计	1,383,038,614.82	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	-	-
B	采矿业	37,989.27	0.00
C	制造业	739,630,467.00	56.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,404.00	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	16,980,000.00	1.30
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	83,015,227.57	6.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	52,461,827.23	4.02
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	892,142,498.53	68.39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002353	杰瑞股份	391,789	59,747,822.50	4.58
2	688521	芯原股份	150,313	55,787,166.82	4.28
3	603259	药明康德	420,955	52,413,107.05	4.02
4	688200	华峰测控	95,508	50,151,250.80	3.84
5	603078	江化微	869,500	42,970,690.00	3.29
6	601636	旗滨集团	4,009,100	41,013,093.00	3.14
7	688376	美埃科技	255,902	29,761,402.60	2.28
8	600552	凯盛科技	891,375	29,040,997.50	2.23
9	002821	凯莱英	172,468	27,939,816.00	2.14
10	300943	春晖智控	621,200	27,922,940.00	2.14
11	688256	寒武纪	17,065	27,228,060.75	2.09
12	688605	先锋精科	260,513	27,098,562.26	2.08
13	603986	兆易创新	31,000	25,265,000.00	1.94
14	688172	燕东微	294,935	24,674,262.10	1.89
15	002384	东山精密	92,800	24,346,080.00	1.87
16	300394	天孚通信	78,960	23,899,612.80	1.83
17	300820	英杰电气	225,100	20,310,773.00	1.56
18	688233	神工股份	93,404	20,027,685.68	1.54
19	600500	中化国际	2,329,970	18,243,665.10	1.40
20	002409	雅克科技	81,000	18,184,500.00	1.39
21	688361	中科飞测	40,146	17,262,780.00	1.32
22	300475	香农芯创	56,600	16,980,000.00	1.30
23	301393	昊帆生物	243,400	15,765,018.00	1.21
24	688396	华润微	158,215	15,433,873.25	1.18
25	300285	国瓷材料	149,500	15,425,410.00	1.18
26	300037	新宙邦	143,500	13,323,975.00	1.02
27	002859	洁美科技	121,500	13,305,465.00	1.02
28	688686	奥普特	78,746	13,260,038.94	1.02
29	300201	海伦哲	619,100	13,044,437.00	1.00
30	688028	沃尔德	83,675	13,042,422.25	1.00
31	002025	航天电器	170,448	12,991,546.56	1.00
32	605060	联德股份	226,600	12,857,284.00	0.99
33	603379	三美股份	167,200	12,688,808.00	0.97
34	301307	美利信	165,712	12,476,456.48	0.96
35	300491	通合科技	298,933	11,416,251.27	0.88
36	688019	安集科技	19,796	6,719,950.16	0.52
37	300373	扬杰科技	41,900	6,587,937.00	0.51
38	300136	信维通信	55,200	6,582,600.00	0.50
39	603663	三祥新材	67,600	6,509,880.00	0.50
40	688783	西安奕材	32,210	1,849,498.20	0.14
41	688795	摩尔线程	2,560	1,732,966.40	0.13

42	688802	沐曦股份	1,864	1,433,210.96	0.11
43	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.11
44	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
45	001399	惠科股份	16,218	551,403.64	0.04
46	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.03
47	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
48	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
49	688790	昂瑞微	1,884	238,231.80	0.02
50	300223	北京君正	900	224,010.00	0.02
51	301669	高特电子	5,455	217,413.57	0.02
52	688820	盛合晶微	1,523	215,489.27	0.02
53	688809	强一股份	207	128,961.00	0.01
54	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
55	300750	宁德时代	300	117,903.00	0.01
56	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
57	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
58	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
59	688807	优迅股份	131	52,718.33	0.00
60	688796	百奥赛图	423	46,276.20	0.00
61	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
62	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
63	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
64	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
65	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
66	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
67	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
68	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
69	001233	海安集团	367	16,404.90	0.00
70	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
71	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
72	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
73	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
74	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
75	688805	健信超导	265	12,447.05	0.00
76	601112	振石股份	690	12,137.10	0.00
77	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
78	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
79	301667	纳百川	151	10,920.32	0.00
80	001248	华润新能源	1,000	10,110.00	0.00
81	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
82	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
83	001285	瑞立科密	137	5,634.81	0.00
84	603248	锡华科技	260	5,483.40	0.00
85	600900	长江电力	200	5,294.00	0.00

86	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
87	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
88	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
89	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
90	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
91	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
92	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
93	002155	湖南黄金	60	1,432.20	0.00
94	600938	中国海油	15	407.25	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	002353	杰瑞股份	213,913,167.20	31.87
2	600938	中国海油	162,389,457.64	24.19
3	300191	潜能恒信	139,682,148.48	20.81
4	688777	中控技术	119,219,217.58	17.76
5	300750	宁德时代	105,281,012.00	15.68
6	002821	凯莱英	99,123,815.72	14.77
7	300502	新易盛	96,390,932.96	14.36
8	002594	比亚迪	94,734,175.75	14.11
9	300432	富临精工	91,591,420.19	13.64
10	603308	应流股份	78,912,487.08	11.76
11	300394	天孚通信	76,994,643.91	11.47
12	002155	湖南黄金	74,427,830.60	11.09
13	300308	中际旭创	71,280,751.00	10.62
14	603619	中曼石油	70,710,137.71	10.53
15	002203	海亮股份	68,327,412.76	10.18
16	300373	扬杰科技	68,238,726.51	10.17
17	600500	中化国际	68,227,011.70	10.16
18	301396	宏景科技	67,008,630.07	9.98
19	603067	振华股份	64,478,572.36	9.61
20	688521	芯原股份	64,032,041.70	9.54
21	600988	赤峰黄金	63,363,897.00	9.44
22	300438	鹏辉能源	62,920,379.20	9.37
23	002714	牧原股份	62,055,830.60	9.24
24	301216	万凯新材	61,706,898.62	9.19
25	688981	中芯国际	61,698,130.28	9.19
26	600547	山东黄金	59,915,272.24	8.93
27	688200	华峰测控	59,655,908.89	8.89
28	603078	江化微	56,578,852.00	8.43

29	603268	松发股份	55,628,367.00	8.29
30	300274	阳光电源	55,210,864.60	8.22
31	603093	南华期货	53,516,332.54	7.97
32	601636	旗滨集团	51,587,784.46	7.68
33	603259	药明康德	50,034,475.40	7.45
34	002637	赞宇科技	48,015,146.98	7.15
35	300277	汽轮科技	47,062,431.40	7.01
36	300498	温氏股份	46,889,369.20	6.99
37	000792	盐湖股份	46,783,016.00	6.97
38	600926	杭州银行	45,045,419.24	6.71
39	002138	顺络电子	44,687,582.72	6.66
40	600549	厦门钨业	43,844,258.00	6.53
41	601001	晋控煤业	43,385,276.00	6.46
42	605111	新洁能	43,335,905.68	6.46
43	300763	锦浪科技	43,077,473.00	6.42
44	688498	源杰科技	42,751,572.79	6.37
45	600026	中远海能	42,695,443.00	6.36
46	300014	亿纬锂能	42,629,531.00	6.35
47	000510	新金路	41,097,816.00	6.12
48	002271	东方雨虹	41,070,040.43	6.12
49	000550	江铃汽车	40,823,383.42	6.08
50	600036	招商银行	40,780,282.78	6.07
51	300943	春晖智控	40,450,993.28	6.03
52	688172	燕东微	40,026,669.02	5.96
53	601838	成都银行	39,285,245.00	5.85
54	688012	中微公司	37,587,182.73	5.60
55	002192	融捷股份	36,090,119.37	5.38
56	601898	中煤能源	35,208,503.97	5.24
57	301307	美利信	35,207,170.45	5.24
58	600879	航天电子	35,150,502.00	5.24
59	603606	东方电缆	34,974,006.21	5.21
60	300390	天华新能	34,943,081.00	5.21
61	300737	科顺股份	34,781,101.09	5.18
62	601857	中国石油	34,601,516.00	5.15
63	600875	东方电气	33,284,362.00	4.96
64	600256	广汇能源	33,080,944.00	4.93
65	688256	寒武纪	32,910,044.43	4.90
66	600118	中国卫星	32,576,639.97	4.85
67	002384	东山精密	32,229,652.00	4.80
68	601288	农业银行	32,228,746.00	4.80
69	688347	华虹宏力	32,111,396.24	4.78
70	920438	戈碧迦	31,998,549.85	4.77
71	000725	京东方 A	31,832,118.00	4.74
72	688234	天岳先进	31,656,165.60	4.72

73	002008	大族激光	30,401,146.68	4.53
74	603393	新天然气	30,004,201.99	4.47
75	688390	固德威	29,905,156.31	4.45
76	600372	中航机载	29,250,523.39	4.36
77	002428	云南锗业	28,653,872.11	4.27
78	002957	科瑞技术	28,649,208.00	4.27
79	600482	中国动力	28,441,986.00	4.24
80	600075	新疆天业	28,211,162.88	4.20
81	601872	招商轮船	28,022,115.78	4.17
82	688127	蓝特光学	27,789,930.35	4.14
83	002850	科达利	27,580,352.00	4.11
84	002709	天赐材料	27,554,848.05	4.10
85	688311	盟升电子	27,267,151.57	4.06
86	002975	博杰股份	27,151,892.20	4.04
87	002254	泰和新材	27,076,611.00	4.03
88	002756	永兴材料	26,536,945.80	3.95
89	000534	万泽股份	26,483,514.00	3.95
90	300490	华自科技	26,270,261.00	3.91
91	601899	紫金矿业	25,829,766.00	3.85
92	300661	圣邦股份	25,607,911.88	3.81
93	301292	海科新源	25,460,262.73	3.79
94	688361	中科飞测	25,288,469.50	3.77
95	600563	法拉电子	24,306,985.00	3.62
96	301486	致尚科技	23,442,637.25	3.49
97	300316	晶盛机电	23,098,072.00	3.44
98	688605	先锋精科	23,035,964.21	3.43
99	600343	航天动力	22,911,418.00	3.41
100	002281	光迅科技	22,895,007.00	3.41
101	002938	鹏鼎控股	22,852,288.00	3.40
102	601012	隆基绿能	22,773,876.60	3.39
103	300972	万辰集团	22,716,998.00	3.38
104	301188	力诺药包	22,611,977.40	3.37
105	688376	美埃科技	22,565,038.49	3.36
106	300866	安克创新	22,260,047.91	3.32
107	300483	首华燃气	22,056,542.00	3.29
108	688808	联讯仪器	22,022,908.52	3.28
109	002092	中泰化学	21,924,299.00	3.27
110	002465	海格通信	21,752,961.00	3.24
111	300759	康龙化成	21,120,411.20	3.15
112	601975	招商南油	21,062,346.00	3.14
113	300015	爱尔眼科	20,902,518.51	3.11
114	000831	中国稀土	20,881,409.10	3.11
115	300604	长川科技	20,867,702.00	3.11
116	688320	禾川科技	20,773,286.39	3.09

117	600111	北方稀土	20,743,566.00	3.09
118	688813	泰金新能	20,613,244.42	3.07
119	600584	长电科技	20,576,690.94	3.07
120	600552	凯盛科技	20,200,168.75	3.01
121	688190	云路股份	20,030,434.62	2.98
122	688536	思瑞浦	19,939,208.39	2.97
123	688052	纳芯微	19,783,295.20	2.95
124	600012	皖通高速	19,706,977.00	2.94
125	603766	隆鑫通用	19,656,400.53	2.93
126	688478	晶升股份	19,465,556.46	2.90
127	002080	中材科技	19,380,828.25	2.89
128	688028	沃尔德	19,188,811.72	2.86
129	603986	兆易创新	19,055,688.00	2.84
130	300820	英杰电气	18,947,284.00	2.82
131	300201	海伦哲	18,901,501.00	2.82
132	300666	江丰电子	18,898,142.84	2.82
133	300491	通合科技	18,794,972.21	2.80
134	300775	三角防务	18,789,657.00	2.80
135	600309	万华化学	18,786,754.50	2.80
136	600900	长江电力	18,777,000.00	2.80
137	600105	永鼎股份	18,541,200.12	2.76
138	002436	兴森科技	18,539,228.00	2.76
139	601988	中国银行	18,068,768.00	2.69
140	601985	中国核电	17,930,829.00	2.67
141	603315	福鞍股份	17,711,752.28	2.64
142	301392	汇成真空	17,522,358.00	2.61
143	600773	西藏城投	17,490,012.00	2.61
144	300672	国科微	17,452,993.00	2.60
145	301468	博盈特焊	17,150,687.46	2.55
146	300164	通源石油	17,139,134.00	2.55
147	688432	有研硅	17,131,286.12	2.55
148	688126	沪硅产业	17,110,768.62	2.55
149	000338	潍柴动力	17,099,769.00	2.55
150	002119	康强电子	17,048,085.00	2.54
151	688147	微导纳米	16,608,472.97	2.47
152	688008	澜起科技	16,261,548.32	2.42
153	688516	奥特维	16,227,308.35	2.42
154	688063	派能科技	16,197,707.88	2.41
155	002846	英联股份	16,188,275.00	2.41
156	600893	航发动力	15,455,626.00	2.30
157	301393	昊帆生物	15,167,498.00	2.26
158	300136	信维通信	15,000,013.00	2.23
159	002240	盛新锂能	14,748,081.18	2.20
160	000762	西藏矿业	14,689,334.00	2.19

161	688257	新锐股份	14,606,652.73	2.18
162	002865	钧达股份	14,581,920.00	2.17
163	688818	电科蓝天	14,434,350.75	2.15
164	300881	盛德鑫泰	14,390,328.00	2.14
165	002149	西部材料	14,338,791.85	2.14
166	002460	赣锋锂业	14,332,564.00	2.14
167	603026	石大胜华	14,292,456.80	2.13
168	301005	超捷股份	14,291,060.00	2.13
169	688167	炬光科技	14,260,715.94	2.12
170	600863	华能蒙电	14,083,330.00	2.10
171	600150	中国船舶	14,011,472.20	2.09
172	600115	中国东航	13,976,877.00	2.08
173	002050	三花智控	13,957,047.95	2.08
174	601166	兴业银行	13,937,309.00	2.08
175	688027	国盾量子	13,924,844.22	2.07
176	301317	鑫磊股份	13,881,693.00	2.07
177	300059	东方财富	13,881,576.94	2.07
178	002371	北方华创	13,836,028.20	2.06
179	600110	诺德股份	13,830,983.00	2.06
180	603659	璞泰来	13,828,576.00	2.06
181	688006	杭可科技	13,804,799.08	2.06
182	603688	石英股份	13,800,593.00	2.06
183	688131	皓元医药	13,797,949.88	2.06
184	688383	新益昌	13,782,177.21	2.05
185	688717	艾罗能源	13,779,231.89	2.05
186	601633	长城汽车	13,758,212.36	2.05
187	688031	星环科技	13,728,611.81	2.05
188	002648	卫星化学	13,707,635.00	2.04
189	600660	福耀玻璃	13,694,111.40	2.04
190	002245	蔚蓝锂芯	13,586,041.50	2.02
191	300223	北京君正	13,464,806.00	2.01

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	002353	杰瑞股份	213,599,134.76	31.82
2	600938	中国海油	158,181,940.89	23.56
3	300191	潜能恒信	133,066,097.02	19.82
4	603308	应流股份	126,260,017.38	18.81
5	688777	中控技术	122,104,134.67	18.19
6	603067	振华股份	113,970,863.11	16.98

7	300750	宁德时代	108,531,167.00	16.17
8	300502	新易盛	106,378,009.80	15.85
9	002594	比亚迪	94,751,584.69	14.11
10	300432	富临精工	92,497,040.30	13.78
11	300308	中际旭创	89,190,483.00	13.29
12	002155	湖南黄金	76,109,418.20	11.34
13	002821	凯莱英	73,556,194.00	10.96
14	688981	中芯国际	72,772,911.80	10.84
15	301396	宏景科技	72,550,193.74	10.81
16	603619	中曼石油	70,009,449.75	10.43
17	002203	海亮股份	68,412,680.04	10.19
18	300274	阳光电源	67,531,175.25	10.06
19	300438	鹏辉能源	66,827,122.15	9.96
20	300373	扬杰科技	64,317,136.21	9.58
21	301216	万凯新材	63,716,742.50	9.49
22	600988	赤峰黄金	61,222,131.00	9.12
23	600500	中化国际	59,506,755.30	8.86
24	603268	松发股份	59,238,263.00	8.82
25	002714	牧原股份	58,197,684.00	8.67
26	688498	源杰科技	56,267,269.08	8.38
27	600547	山东黄金	56,020,024.22	8.35
28	002271	东方雨虹	53,157,199.00	7.92
29	300394	天孚通信	52,241,073.70	7.78
30	603093	南华期货	51,939,888.00	7.74
31	002138	顺络电子	49,574,721.00	7.39
32	300737	科顺股份	48,394,226.40	7.21
33	300277	汽轮科技	47,835,551.63	7.13
34	605376	博迁新材	47,832,671.00	7.13
35	000792	盐湖股份	46,899,720.25	6.99
36	600549	厦门钨业	46,259,176.00	6.89
37	000510	新金路	45,086,662.86	6.72
38	300498	温氏股份	44,492,036.20	6.63
39	000534	万泽股份	44,241,754.47	6.59
40	600926	杭州银行	44,235,524.92	6.59
41	002192	融捷股份	43,659,983.59	6.50
42	603606	东方电缆	43,295,924.64	6.45
43	300390	天华新能	43,181,052.69	6.43
44	002637	赞宇科技	42,136,113.80	6.28
45	300763	锦浪科技	42,005,440.00	6.26
46	300014	亿纬锂能	41,801,831.66	6.23
47	600026	中远海能	41,661,433.20	6.21
48	002756	永兴材料	41,607,174.90	6.20
49	300818	耐普矿机	41,168,043.57	6.13
50	600036	招商银行	40,842,805.00	6.08

51	688012	中微公司	40,709,241.39	6.06
52	000550	江铃汽车	40,345,225.00	6.01
53	605111	新洁能	39,901,708.38	5.94
54	601838	成都银行	39,641,457.50	5.91
55	601001	晋控煤业	39,564,402.00	5.89
56	002008	大族激光	39,441,793.00	5.88
57	688390	固德威	36,560,394.47	5.45
58	000688	国城矿业	35,742,178.50	5.32
59	000725	京东方 A	35,565,920.00	5.30
60	002444	巨星科技	34,864,078.00	5.19
61	600879	航天电子	34,510,286.73	5.14
62	002850	科达利	33,973,766.00	5.06
63	601898	中煤能源	33,614,912.80	5.01
64	600256	广汇能源	33,561,386.62	5.00
65	601288	农业银行	33,269,895.00	4.96
66	002957	科瑞技术	33,091,696.12	4.93
67	601857	中国石油	33,081,910.00	4.93
68	600875	东方电气	32,742,448.20	4.88
69	002428	云南锗业	32,224,051.69	4.80
70	600118	中国卫星	31,916,835.80	4.75
71	688813	泰金新能	31,769,813.99	4.73
72	001203	大中矿业	30,748,362.00	4.58
73	688127	蓝特光学	29,984,898.37	4.47
74	688347	华虹宏力	29,466,592.20	4.39
75	600372	中航机载	29,168,116.43	4.35
76	603766	隆鑫通用	28,873,640.34	4.30
77	002709	天赐材料	28,714,822.02	4.28
78	688808	联讯仪器	27,918,750.98	4.16
79	001376	百通能源	27,693,370.05	4.13
80	300490	华自科技	27,668,827.00	4.12
81	920438	戈碧迦	27,539,089.17	4.10
82	002975	博杰股份	27,481,065.80	4.09
83	002281	光迅科技	26,868,965.00	4.00
84	600482	中国动力	26,851,134.20	4.00
85	301188	力诺药包	26,558,132.56	3.96
86	688234	天岳先进	26,488,720.82	3.95
87	002254	泰和新材	26,106,577.00	3.89
88	601872	招商轮船	25,893,449.60	3.86
89	688311	盟升电子	25,860,351.50	3.85
90	688200	华峰测控	25,834,727.92	3.85
91	002938	鹏鼎控股	25,775,129.00	3.84
92	603393	新天然气	25,669,488.00	3.82
93	601012	隆基绿能	25,136,699.00	3.74
94	601899	紫金矿业	24,948,145.01	3.72

95	300661	圣邦股份	24,764,866.28	3.69
96	301292	海科新源	24,551,432.93	3.66
97	600563	法拉电子	24,404,947.60	3.64
98	600075	新疆天业	24,387,813.50	3.63
99	300666	江丰电子	24,055,088.26	3.58
100	300866	安克创新	23,689,423.27	3.53
101	688190	云路股份	22,948,679.49	3.42
102	301307	美利信	22,761,652.00	3.39
103	600343	航天动力	22,528,436.08	3.36
104	600584	长电科技	22,228,568.95	3.31
105	000831	中国稀土	21,999,914.76	3.28
106	688052	纳芯微	21,743,596.14	3.24
107	002851	麦格米特	21,648,569.20	3.22
108	002465	海格通信	21,339,994.00	3.18
109	300316	晶盛机电	20,966,272.00	3.12
110	688521	芯原股份	20,957,281.93	3.12
111	300972	万辰集团	20,386,787.85	3.04
112	300604	长川科技	20,246,837.00	3.02
113	601975	招商南油	20,019,870.00	2.98
114	688536	思瑞浦	19,973,167.75	2.98
115	688320	禾川科技	19,879,448.77	2.96
116	300483	首华燃气	19,775,494.08	2.95
117	300015	爱尔眼科	19,621,293.00	2.92
118	688147	微导纳米	19,593,520.25	2.92
119	300408	三环集团	19,255,526.00	2.87
120	600111	北方稀土	19,112,583.30	2.85
121	300759	康龙化成	19,106,559.45	2.85
122	301486	致尚科技	19,084,756.94	2.84
123	600105	永鼎股份	18,991,980.00	2.83
124	600900	长江电力	18,909,970.00	2.82
125	002092	中泰化学	18,752,213.00	2.79
126	603078	江化微	18,744,992.40	2.79
127	601988	中国银行	18,588,502.00	2.77
128	002497	雅化集团	18,520,965.27	2.76
129	301392	汇成真空	18,430,795.00	2.75
130	300775	三角防务	18,421,597.00	2.74
131	600012	皖通高速	18,334,437.27	2.73
132	601636	旗滨集团	18,275,841.04	2.72
133	600773	西藏城投	18,173,411.00	2.71
134	601985	中国核电	17,883,900.00	2.66
135	300672	国科微	17,842,264.00	2.66
136	002119	康强电子	17,735,271.45	2.64
137	688256	寒武纪	17,714,394.22	2.64
138	600309	万华化学	17,685,591.00	2.63

139	688063	派能科技	17,509,392.63	2.61
140	688516	奥特维	17,236,896.43	2.57
141	603315	福鞍股份	17,225,732.00	2.57
142	002080	中材科技	17,165,633.19	2.56
143	601211	国泰海通	16,879,974.00	2.51
144	301468	博盈特焊	16,764,573.00	2.50
145	688696	极米科技	16,713,511.70	2.49
146	300943	春晖智控	16,653,396.00	2.48
147	002436	兴森科技	16,427,137.00	2.45
148	688478	晶升股份	16,273,618.54	2.42
149	002371	北方华创	15,996,555.60	2.38
150	000338	潍柴动力	15,867,320.00	2.36
151	688432	有研硅	15,616,488.35	2.33
152	688082	盛美上海	15,546,817.54	2.32
153	002240	盛新锂能	15,498,307.00	2.31
154	300164	通源石油	15,488,192.00	2.31
155	002846	英联股份	15,412,023.00	2.30
156	600893	航发动力	15,404,774.00	2.29
157	000762	西藏矿业	15,241,713.00	2.27
158	688257	新锐股份	15,098,838.78	2.25
159	301362	民爆光电	15,053,073.60	2.24
160	688172	燕东微	15,049,560.55	2.24
161	688818	电科蓝天	14,772,071.93	2.20
162	688027	国盾量子	14,729,262.47	2.19
163	688717	艾罗能源	14,721,376.37	2.19
164	688031	星环科技	14,665,858.51	2.18
165	000657	中钨高新	14,649,235.00	2.18
166	688006	杭可科技	14,647,942.29	2.18
167	688126	沪硅产业	14,588,336.30	2.17
168	300881	盛德鑫泰	14,580,497.00	2.17
169	603353	和顺石油	14,398,584.00	2.14
170	688167	炬光科技	14,379,229.05	2.14
171	002460	赣锋锂业	14,345,335.00	2.14
172	300115	长盈精密	14,306,295.65	2.13
173	688361	中科飞测	14,227,195.80	2.12
174	603618	杭电股份	14,205,375.00	2.12
175	301317	鑫磊股份	14,181,740.00	2.11
176	688008	澜起科技	14,143,572.70	2.11
177	002245	蔚蓝锂芯	14,106,769.75	2.10
178	002050	三花智控	14,100,363.54	2.10
179	300059	东方财富	13,986,255.00	2.08
180	600863	华能蒙电	13,942,644.00	2.08
181	601166	兴业银行	13,828,760.00	2.06
182	688131	皓元医药	13,673,183.05	2.04

183	603659	璞泰来	13,497,232.00	2.01
184	603688	石英股份	13,496,510.50	2.01

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	7,753,518,751.72
卖出股票收入（成交）总额	7,656,788,373.36

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	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	111,221,490.07	8.53
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	111,221,490.07	8.53

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	118051	皓元转债	90,300	26,421,643.93	2.03
2	118061	茂莱转债	70,750	18,667,197.54	1.43
3	118053	正帆转债	58,820	12,812,293.26	0.98
4	118058	微导转债	12,810	6,988,677.65	0.54

5	118056	路维转债	17,150	6,861,844.21	0.53
---	--------	------	--------	--------------	------

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

本基金本报告期末投资股指期货。

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 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	1,424,863.67
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,235,604.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,660,468.14

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	118051	皓元转债	26,421,643.93	2.03
2	118061	茂莱转债	18,667,197.54	1.43
3	118053	正帆转债	12,812,293.26	0.98
4	118058	微导转债	6,988,677.65	0.54
5	118056	路维转债	6,861,844.21	0.53
6	118062	天准转债	6,574,221.57	0.50
7	118050	航宇转债	6,536,781.27	0.50
8	118030	睿创转债	6,496,400.96	0.50
9	118040	宏微转债	6,369,843.39	0.49
10	113632	鹤 21 转债	6,306,644.70	0.48

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
42,323	7,782.43	113,627,923.72	34.50%	215,747,922.27	65.50%

注：持有人户数含未确权的原持有人户数。

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	95.85%

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	5,463,829.53	1.6588%

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	>100
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（2008 年 10 月 9 日）基金份额总额	800,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	218,536,215.18
本报告期基金总申购份额	274,954,821.89
减：本报告期基金总赎回份额	164,115,191.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	329,375,845.99

§ 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

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

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	
长江证券	1	3,699,497,698.71	24.01%	1,612,981.05	24.03%	-
广发证券	2	253,706,838.81	1.65%	104,436.57	1.56%	-
国泰海通	2	3,073,453,356.61	19.95%	1,340,025.13	19.97%	-
国投证券	2	321,807,578.18	2.09%	140,309.61	2.09%	-
民生证券	1	1,481,695,916.11	9.62%	646,019.39	9.63%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	75,005,758.08	0.49%	32,703.47	0.49%	-
招商证券	1	2,762,834,396.91	17.93%	1,204,601.48	17.95%	-
中信证券	2	3,738,850,866.35	24.27%	1,630,149.95	24.29%	-

注：a)本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司、中信证券股份有限公司。

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
长江证券	833,781,505.92	32.29%	-	-	-	-
广发证券	75,326,853.87	2.92%	-	-	-	-
国泰海通	601,545,630.89	23.29%	-	-	-	-
国投证券	95,880,836.21	3.71%	-	-	-	-
民生证券	318,001,692.51	12.31%	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	151,014,127.19	5.85%	-	-	-	-
中信证券	506,825,793.69	19.63%	-	-	-	-

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	证券日报、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	易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金暂停机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-07
3	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
4	易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
5	易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金恢复机构客户申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-09
6	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	证券日报	2026-01-22
7	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
8	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
9	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
10	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	证券日报	2026-03-31
11	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	证券日报	2026-04-22
12	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
13	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
14	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-16
15	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	证券日报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
16	易方达基金管理有限公司关于终止中证金牛	证券日报、基金管理人网	2026-05-29

	(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	站及中国证监会基金电子披露网站	
17	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	证券日报、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.科汇证券投资基金基金份额持有人大会决议生效公告；
- 2.中国证监会《关于核准科汇证券投资基金基金份额持有人大会有关转换基金运作方式决议的批复》（证监许可[2008]1140 号）；
- 3.《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 4.《易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 5.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 6.基金管理人业务资格批件和营业执照。

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