

同泰同欣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：同泰基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 27 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 26 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 2026 年 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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 ..	55
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 ..	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 盈利投资者数量占比	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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的情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	59
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	60
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	同泰同欣混合型证券投资基金	
基金简称	同泰同欣混合	
基金主代码	013657	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 27 日	
基金管理人	同泰基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	975,538,827.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分类基金的基金简称	同泰同欣混合 A	同泰同欣混合 C
下属分类基金的交易代码	013657	013658
报告期末下属分类基金的份额总额	103,913,165.96 份	871,625,661.95 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健回报。
投资策略	本基金在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上,通过自上而下的分析,形成对不同大类资产市场的预测和判断,在基金合同约定的范围内确定固定收益类资产、权益类资产和现金等的配置比例,并随着市场运行状况以及各类证券风险收益特征的相对变化,动态调整大类资产的投资比例,力争有效控制基金资产运作风险,提高基金资产风险调整后收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 $\times$ 20%+恒生综合指数收益率 $\times$ 10%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 70%
风险收益特征	本基金为混合型基金,长期平均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。 本基金可投资港股通标的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		同泰基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	滕大江	潘琦
	联系电话	0755-23537896	0755-22168257
	电子邮箱	tengdj@tongtaiamc.com	PANQI003@pingan.com.cn

客户服务电话	400-830-1666	95511-3
传真	0755-23537801	0755-82080387
注册地址	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城（南区）T2 栋 3302	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城（南区）T2 栋 3302	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	518033	518001
法定代表人	马俊生	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.tongtaiamc.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	同泰基金管理有限公司	深圳市福田区华富街道莲花一村社区皇岗路 5001 号深业上城(南区)T2 栋 3302

§ 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

基金类别	同泰同欣混合 A	同泰同欣混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）	报告期（2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,256,262.67	4,631,506.75
本期利润	2,703,548.04	10,487,919.41
加权平均基金份额本期利润	0.0340	0.0288
本期加权平均净值利润率	3.41%	2.93%
本期基金份额净值增长率	3.72%	3.51%
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	-515,276.79	-20,120,035.19
期末可供分配基金份额利润	-0.0050	-0.0231
期末基金资产净值	105,137,016.61	865,786,138.89
期末基金份额净值	1.0118	0.9933

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	1.18%	-0.67%

注：1、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。

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

3、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

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

同泰同欣混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.91%	0.22%	1.99%	0.35%	0.92%	-0.13%
过去六个月	3.72%	0.24%	0.97%	0.33%	2.75%	-0.09%
过去一年	6.23%	0.22%	4.28%	0.30%	1.95%	-0.08%
过去三年	5.06%	0.21%	12.62%	0.32%	-7.56%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	1.18%	0.27%	6.93%	0.34%	-5.75%	-0.07%

同泰同欣混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	2.82%	0.22%	1.99%	0.35%	0.83%	-0.13%
过去六个月	3.51%	0.23%	0.97%	0.33%	2.54%	-0.10%
过去一年	5.81%	0.22%	4.28%	0.30%	1.53%	-0.08%
过去三年	3.76%	0.21%	12.62%	0.32%	-8.86%	-0.11%
自基金合同 生效起至今	-0.67%	0.27%	6.93%	0.34%	-7.60%	-0.07%

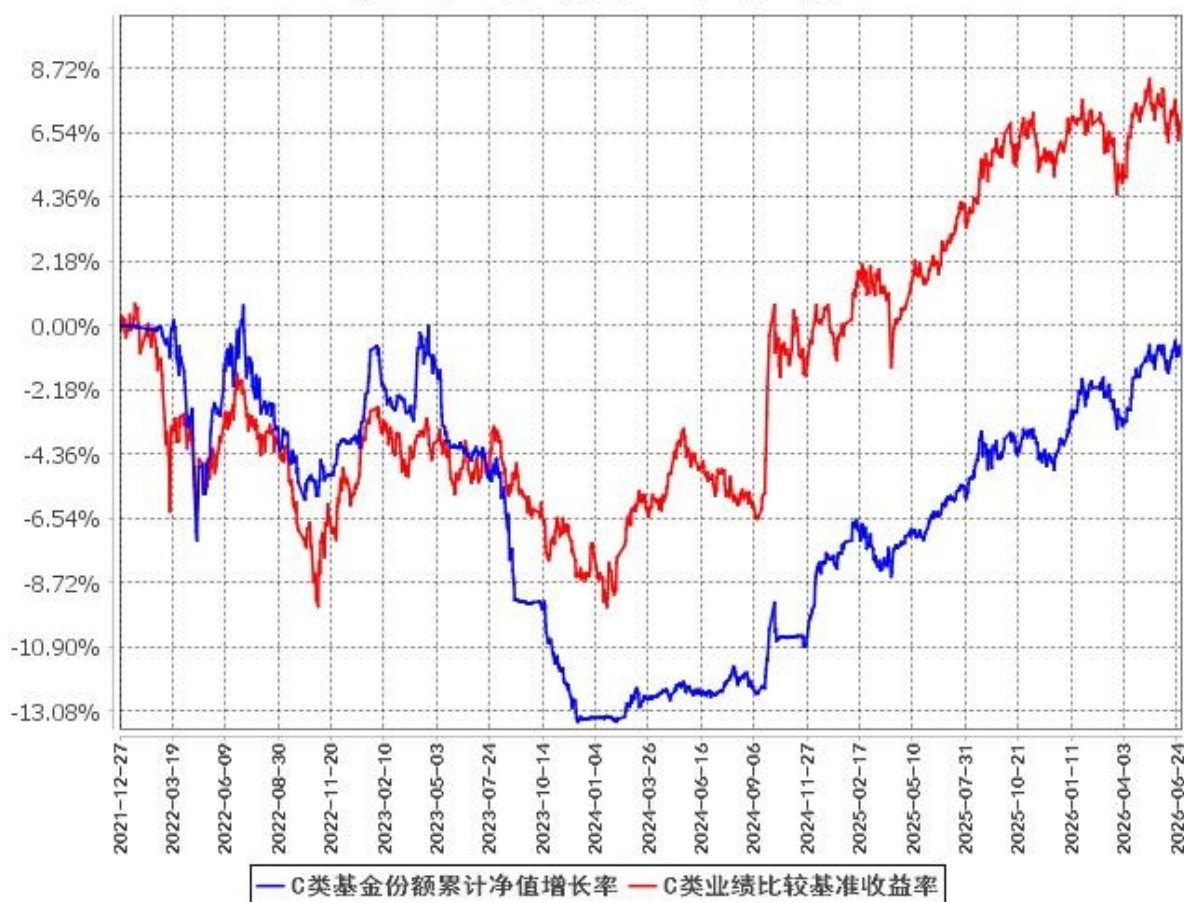
注：本基金的业绩比较基准为中债综合全价(总值)指数收益率*70%+沪深 300 指数收益率*20%+恒生综合指数收益率*10%，每日进行再平衡过程。

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

A类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2021年12月27日至2026年6月30日)



C类基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2021年12月27日至2026年6月30日)



注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关约定。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为同泰基金管理有限公司，经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]1497 号文批准设立，于 2018 年 10 月 11 日在深圳注册成立，注册资本 1 亿元人民币，并于 2019 年 3 月 15 日取得中国证监会核发的《经营证券期货业务许可证》。目前，公司股东及其出资比例为：刘文灿先生 33.3%，刘韞芬女士 32%，上海蓝尚投资管理中心（有限合伙）20%，马俊生先生 4.9%，王雪梅女士 4.9%，王敏飞先生 4.9%。截止本报告期末，本基金

管理人共管理了 22 只开放式基金。

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		
马毅	本基金基金经理, 固定收益部总监, 总经理助理	2024 年 1 月 23 日	-	17	马毅先生, 中国国籍, 硕士。曾任华泰资产管理有限公司投资经理、富国基金管理有限公司年金投资经理兼研究员、摩根基金管理(中国)有限公司(原上投摩根基金管理有限公司)基金经理、浙商证券股份有限公司自营分公司 ED(执行总监)、上海玖歌投资管理有限公司量化多策略负责人兼投资经理。2023 年 10 月加入同泰基金管理有限公司, 现任总经理助理、固定收益部总监、同泰恒兴纯债债券型证券投资基金基金经理、同泰泰享中短债债券型证券投资基金基金经理、同泰恒盛债券型证券投资基金基金经理、同泰沪深 300 指数量化增强型证券投资基金基金经理、同泰同欣混合型证券投资基金基金经理、同泰恒利纯债债券型证券投资基金基金经理、同泰远见灵活配置混合型证券投资基金基金经理、同泰慧择混合型证券投资基金基金经理、同泰大健康主题混合型证券投资基金基金经理, 2024 年 1 月 23 日至 2026 年 4 月 20 日担任同泰泰裕三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。
赵勇	本基金基金经理, 固定收益部总监	2026 年 4 月 15 日	-	9	赵勇先生, 中国国籍, 硕士。曾任职于浙商证券、长信基金、厦门银行、瑞达期货、厦门国际银行, 从事量化研究、交易及投资主管等职务。

	助理				2025 年 12 月加入同泰基金管理有限公司，现任固定收益部总监助理、同泰恒兴纯债债券型证券投资基金基金经理、同泰泰和三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、同泰泰裕三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、同泰同欣混合型证券投资基金基金经理、同泰新能源优选 1 年持有期股票型证券投资基金基金经理。
--	----	--	--	--	--

- 1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期。
- 2、基金的非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。
- 3、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期，无此情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有投资组合。报告期内，本基金管理人对连续 4 个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日成交量的 5% 的情况，且未发现其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年国内利率市场整体呈现震荡回暖态势。一季度，十年期国债收益率季度下行 4bp 左右，其中影响因素包括：风险资产走强、央行持续释放宽松信号、债券配置需求、美伊冲突与原油暴涨引发通胀担忧、同业利率预期调降及资金面宽松等。二季度，十年期国债到期收益率当季下行约 9bp，市场走势受多重内外因素共同影响，一方面，美伊地缘冲突影响边际弱化、国内资金面维持结构性宽松，对债市形成支撑；另一方面，国内经济基本面预期波动、新任美联储主席释放鹰派政策信号，对市场走势形成阶段性扰动。

2026 年上半年国内股市整体呈现区间震荡特征。其中一季度国内股市整体先扬后抑，季度涨跌幅小盘股、红利策略相对表现占优；二季度国内股市风格分化特征凸显，半导体、人工智能等科技产业链领涨市场，消费、周期板块表现相对疲弱，整体呈现大市值因子占优的市场格局。

报告期内，本基金通过量化策略进行多资产管理：

- （1）固收端：基于量化信号动态管理久期，整体维持中性久期中枢，稳健把握债市震荡行情；
- （2）转债端：采用多因子模型构建组合，基于估值与风险性价比变化，适度回落整体仓位，有效控制波动敞口；
- （3）权益端：依托量化策略选股及仓位择时，顺应市场风格切换，适度压降红利风格持仓，动态优化权益结构。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末同泰同欣混合 A 的基金份额净值为 1.0118 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.72%；截至本报告期末同泰同欣混合 C 的基金份额净值为 0.9933 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.51%；同期业绩比较基准收益率为 0.97%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，全球宏观核心矛盾集中于美国再通胀交易升温，下半年美联储或维持高利率格局，全球资产定价逻辑正从估值主导的分母端行情，逐步转向业绩主导的分子端行情，具备真实盈利支撑的资产将持续占优。国内经济正处于新旧动能转换的换挡期，宏观政策延续结构性发力基调：财

政端精准聚焦“两重”“两新”托底实体，货币端维持流动性合理充裕。在此背景下，预计国内纯债市场将延续震荡格局，A 股或将延续由产业趋势与业绩兑现驱动的结构性价行情。

后续运作中，本基金将持续依托量化体系开展大类资产配置与组合管理：紧跟宏观变化与风格迭代，动态优化组合结构；将风险控制置于首位，强化极端行情下的回撤管理与风险对冲；同时，积极参与一级市场网下申购等多重策略，多措并举增厚收益，力争为持有人创造稳健可持续的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人从事基金估值业务的组织机构主要包括估值委员会、运营部及相关部门。

本基金的日常估值程序通常由运营部估值核算岗执行并由业务复核岗复核估值结果，最终由估值核算岗与基金托管人的估值结果核对一致。

本基金的特别估值程序由估值委员会秘书部门运营部在收到启动特殊估值程序的请求后，通过估值核算人员及时与基金托管人沟通协商，必要时征求会计师事务所的专业意见，并将有关信息及材料一并报送全体估值委员会成员；估值委员会应综合考虑投资研究部和运营部等各方面的意见和建议，并按照有关议事规则讨论审议，决定批准或不批准使用特殊估值调整；运营部应当根据经估值委员会审议通过的特别估值调整意见执行估值程序，准备特殊估值调整事项的临时公告，并发起信息披露审批流程；监察稽核部应当对特殊估值调整事项的相关信息披露进行合规审核。

截止报告期末，本基金管理人已与中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内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，平安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。

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，本托管人复核的财务指标、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：同泰同欣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	31,175,929.74	96,086.94
结算备付金		193,584,748.41	5,291,752.98
存出保证金		20,894,343.20	1,285,606.54
交易性金融资产	6.4.7.2	583,368,122.47	109,460,073.15
其中：股票投资		139,694,039.14	17,845,978.69
基金投资		-	-
债券投资		443,674,083.33	91,614,094.46
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	160,505,323.14	27,995,742.13
应收清算款		-	-
应收股利		-	464.00
应收申购款		1,190,765.39	6,618,500.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		990,719,232.35	150,748,225.74
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		-	-
应付赎回款		18,682,126.37	311.71
应付管理人报酬		572,960.57	94,633.40
应付托管费		114,592.13	18,926.65
应付销售服务费		200,561.86	27,477.50
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,808.26	620.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	212,027.66	157,668.00
负债合计		19,796,076.85	299,637.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	975,538,827.91	155,946,569.78
未分配利润	6.4.7.8	-4,615,672.41	-5,497,981.48
净资产合计		970,923,155.50	150,448,588.30
负债和净资产总计		990,719,232.35	150,748,225.74

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 975,538,827.91 份，其中同泰同欣混合 A 基金份额净值 1.0118 元，基金份额总额 103,913,165.96 份；同泰同欣混合 C 基金份额净值 0.9933 元，基金份额总额 871,625,661.95 份。

6.2 利润表

会计主体：同泰同欣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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025
----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、营业总收入		16,602,167.60	885,575.41
1. 利息收入		425,163.45	66,696.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	237,663.70	11,869.35
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		187,499.75	54,827.31
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,736,398.11	964,801.66
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,990,597.80	43,178.15
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	5,895,535.88	785,275.46
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-24,319.11	88,961.59
股利收益	6.4.7.16	874,583.54	47,386.46
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,303,698.03	-146,237.48
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	136,908.01	314.57
减：二、营业总支出		3,410,700.15	282,567.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,169,450.99	194,046.11
2. 托管费	6.4.10.2.2	433,890.21	38,809.35
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	710,436.49	9,210.92
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		3,377.70	-
其中：卖出回购金融资产支出		3,377.70	-
6. 信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7. 税金及附加		5,200.04	433.02
8. 其他费用	6.4.7.20	88,344.72	40,068.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,191,467.45	603,007.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以		13,191,467.45	603,007.74

“-”号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,191,467.45	603,007.74

6.3 净资产变动表

会计主体：同泰同欣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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	155,946,569.78	-	-5,497,981.48	150,448,588.30
二、本期期初净资产	155,946,569.78	-	-5,497,981.48	150,448,588.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	819,592,258.13	-	882,309.07	820,474,567.20
（一）、综合收益总额	-	-	13,191,467.45	13,191,467.45
（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）	819,592,258.13	-	-12,309,158.38	807,283,099.75
其中：1. 基金申购款	1,349,437,131.72	-	-20,944,992.09	1,328,492,139.63
2. 基金赎回款	-529,844,873.59	-	8,635,833.71	-521,209,039.88
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	975,538,827.91	-	-4,615,672.41	970,923,155.50
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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	30,589,798.91	-	-2,123,396.34	28,466,402.57
二、本期期初净资产	30,589,798.91	-	-2,123,396.34	28,466,402.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,118,777.72	-	366,696.94	5,485,474.66
（一）、综合收益总额	-	-	603,007.74	603,007.74
（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）	5,118,777.72	-	-236,310.80	4,882,466.92
其中：1. 基金申购款	28,913,396.12	-	-1,718,121.27	27,195,274.85
2. 基金赎回款	-23,794,618.40	-	1,481,810.47	-22,312,807.93
（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	35,708,576.63	-	-1,756,699.40	33,951,877.23

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：

马俊生	杨伍	杨伍
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

同泰同欣混合型证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2021]985 号《关于准予同泰同欣混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人同泰基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于 2021 年 12 月 27 日正式生效，首次设立募集规模为 207,023,719.59 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同泰基金管理有限公司，

基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票以及存托凭证）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（简称“港股通标的股票”）、债券（包括国家债券、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、企业债券、公司债券、公开发行的次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为 0%-40%，港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%，本基金投资同业存单的比例不超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×20%+恒生综合指数收益率×10%+中债综合全价（总值）指数收益率×70%。

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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；对金融同业往来利息收入亦免征增值税；对在 2025 年 8 月 8 日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息

及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

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

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

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	1,169,888.09
等于：本金	1,169,847.85
加：应计利息	40.24
减：坏账准备	—
定期存款	30,006,041.65
等于：本金	30,000,000.00
加：应计利息	6,041.65
减：坏账准备	—
其中：存款期限 1 个月以内	30,006,041.65
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—

减：坏账准备	-
合计	31,175,929.74

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		132,511,288.69	-	139,694,039.14	7,182,750.45
贵金属投资-金交所黄金 合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	97,488,001.32	632,292.94	98,780,228.54	659,934.28
	银行间市场	342,526,131.43	1,963,854.79	344,893,854.79	403,868.57
	合计	440,014,132.75	2,596,147.73	443,674,083.33	1,063,802.85
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		572,525,421.44	2,596,147.73	583,368,122.47	8,246,553.30

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	118,795,350.00	-	-	-
其中：国债期货	118,795,350.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	13,978,800.00	-	-	-
其中：股指期货	13,978,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	132,774,150.00	-	-	-

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
IF2609	沪深300指 2609	-10	-14,549,400.00	-570,600.00
T2609	国债(10年期)2609	109	119,044,350.00	249,000.00
合计				-321,600.00
减：可抵销期货暂收款				-321,600.00
净额				0.00

注：（1）买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。（2）衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/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国债/股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/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。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	41,500,041.50	-
银行间市场	119,005,281.64	-
合计	160,505,323.14	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,184.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	9,184.50
应付利息	-
其他应付款_其他	3,500.00
预提费用	199,343.16
合计	212,027.66

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

同泰同欣混合 A		
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	50,693,226.48	50,693,226.48
本期申购	76,645,894.49	76,645,894.49
本期赎回(以“-”号填列)	-23,425,955.01	-23,425,955.01
本期末	103,913,165.96	103,913,165.96

金额单位：人民币元

同泰同欣混合 C		
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	105,253,343.30	105,253,343.30
本期申购	1,272,791,237.23	1,272,791,237.23
本期赎回(以“-”号填列)	-506,418,918.58	-506,418,918.58
本期末	871,625,661.95	871,625,661.95

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

同泰同欣混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,138,838.30	-102,257.91	-1,241,096.21
本期期初	-1,138,838.30	-102,257.91	-1,241,096.21

本期利润	1,256,262.67	1,447,285.37	2,703,548.04
本期基金份额交易产生的变动数	-632,701.16	394,099.98	-238,601.18
其中：基金申购款	-836,673.69	700,562.11	-136,111.58
基金赎回款	203,972.53	-306,462.13	-102,489.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-515,276.79	1,739,127.44	1,223,850.65

单位：人民币元

同泰同欣混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,041,358.05	-215,527.22	-4,256,885.27
本期期初	-4,041,358.05	-215,527.22	-4,256,885.27
本期利润	4,631,506.75	5,856,412.66	10,487,919.41
本期基金份额交易产生的变动数	-20,710,183.89	8,639,626.69	-12,070,557.20
其中：基金申购款	-34,973,756.27	14,164,875.76	-20,808,880.51
基金赎回款	14,263,572.38	-5,525,249.07	8,738,323.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-20,120,035.19	14,280,512.13	-5,839,523.06

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	1,963.22
定期存款利息收入	6,041.65
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	225,324.93
其他	4,333.90
合计	237,663.70

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	1,990,597.80
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	1,990,597.80

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	140,086,091.81
减：卖出股票成本总额	137,823,080.49
减：交易费用	272,413.52
买卖股票差价收入	1,990,597.80

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 基金投资收益

无。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	2,017,351.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付） 差价收入	3,878,184.01
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	5,895,535.88
----	--------------

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	642,409,850.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	634,722,242.35
减：应计利息总额	3,754,970.54
减：交易费用	54,453.68
买卖债券差价收入	3,878,184.01

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	238,424.25
股指期货投资收益	-262,743.36

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	874,583.54
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	874,583.54

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	7,615,548.03
——股票投资	7,106,232.57
——债券投资	509,315.46
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-311,850.00
——权证投资	-
——股指期货投资	-570,600.00
——国债期货投资	258,750.00
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	7,303,698.03

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日 至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	136,908.01
合计	136,908.01

6.4.7.19 信用减值损失

无。

6.4.7.20 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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
账户维护费	9,000.00
港股通证券组合费	1.56
合计	88,344.72

6.4.7.21 分部报告

无。

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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要说明的重大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
同泰基金管理有限公司	管理人、销售机构、注册登记机构
平安银行股份有限公司	托管人、销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 基金交易

无。

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

无。

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	2,169,450.99	194,046.11

其中：应支付销售机构的客户维护费	840,109.37	37,583.71
应支付基金管理人的净管理费	1,329,341.62	156,462.40

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$

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

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	433,890.21	38,809.35

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务 费 的各关联方名 称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰同欣混合 A	同泰同欣混合 C	合计
同泰基金管理 有限公司	-	81,779.04	81,779.04
平安银行股份 有限公司	-	612,259.61	612,259.61
合计	-	694,038.65	694,038.65
获得销售服务 费 的各关联方名 称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	同泰同欣混合 A	同泰同欣混合 C	合计
同泰基金管理 有限公司	-	0.38	0.38
平安银行股份 有限公司	-	473.08	473.08
合计	-	473.46	473.46

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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
平安银行股份有限公司	1,169,888.09	1,963.22	71,279.09	159.49

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 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进行利润分配。

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
920136	永励精密	2026 年 6 月 25 日	-	新股未上市流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
920193	吉和昌	2026 年 6 月 18 日	-	新股未上市流通受限	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
920189	康美特	2026 年 6 月 30 日	-	新股未上市流通受限	8.14	8.14	200	1,628.00	1,628.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌流通受限	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	1,089	712,201.23	906,048.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理架构由董事会下的风险控制委员会、督察长、公司风险管理委员会、监察稽核部、以及各个业务部门组成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在具有基金托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于本报告期末，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 5.17%，以下列示中不含国债、央行票据、政策性金融债等非信用债券投资。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期不适用。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期不适用。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期不适用。

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	8,216,278.45	16,495,741.64
AAA 以下	41,972,695.90	12,156,866.50
未评级	0.00	0.00
合计	50,188,974.35	28,652,608.14

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2、本统计数据不包含国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期不适用。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期不适用。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

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

式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金本报告期不适用。

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制（如有）外，本基金所持的证券均能及时变现。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

本报告期内，未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	31,175,929.74	-	-	-	31,175,929.74
结算备付金	193,584,748.41	-	-	-	193,584,748.41
存出保证金	16,767,528.20	-	-	4,126,815.00	20,894,343.20
交易性金融资产	105,630,564.42	212,580,008.22	125,463,510.69	139,694,039.14	583,368,122.47
买入返售金融资产	160,505,323.14	-	-	-	160,505,323.14
应收申购款	-	-	-	1,190,765.39	1,190,765.39
资产总计	507,664,093.91	212,580,008.22	125,463,510.69	145,011,619.53	990,719,232.35

负债					
应付赎回款	-	-	-	18,682,126.37	18,682,126.37
应付管理人报酬	-	-	-	572,960.57	572,960.57
应付托管费	-	-	-	114,592.13	114,592.13
应付销售服务费	-	-	-	200,561.86	200,561.86
应交税费	-	-	-	13,808.26	13,808.26
其他负债	-	-	-	212,027.66	212,027.66
负债总计	-	-	-	19,796,076.85	19,796,076.85
利率敏感度缺口	507,664,093.91	212,580,008.22	125,463,510.69	125,215,542.68	970,923,155.50
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	96,086.94	-	-	-	96,086.94
结算备付金	5,291,752.98	-	-	-	5,291,752.98
存出保证金	962,131.54	-	-	323,475.00	1,285,606.54
交易性金融资产	37,304,467.32	-	54,309,627.14	17,845,978.69	109,460,073.15
买入返售金融资产	27,995,742.13	-	-	-	27,995,742.13
应收股利	-	-	-	464.00	464.00
应收申购款	-	-	-	6,618,500.00	6,618,500.00
资产总计	71,650,180.91	-	54,309,627.14	24,788,417.69	150,748,225.74
负债					
应付赎回款	-	-	-	311.71	311.71
应付管理人报酬	-	-	-	94,633.40	94,633.40
应付托管费	-	-	-	18,926.65	18,926.65
应付销售服务费	-	-	-	27,477.50	27,477.50
应交税费	-	-	-	620.18	620.18
其他负债	-	-	-	157,668.00	157,668.00
负债总计	-	-	-	299,637.44	299,637.44
利率敏感度缺口	71,650,180.91	-	54,309,627.14	24,488,780.25	150,448,588.30

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）
	市场利率上升 25 个基点	-5,475,521.31	-1,198,118.64
	市场利率下降 25 个基点	5,475,521.31	1,211,590.29

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	318,686.72	-	318,686.72
资产合计	-	318,686.72	-	318,686.72
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	318,686.72	-	318,686.72

本基金本报告期不适用。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场价格变量保持不变	
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）
	所有外币相对人民币升值 5%	-	15,934.34
	所有外币相对人民币贬值 5%	-	-15,934.34

本基金本报告期不适用。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。

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	139,694,039.14	14.39	17,845,978.69	11.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	443,674,083.33	45.70	91,614,094.46	60.89
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	583,368,122.47	60.08	109,460,073.15	72.76

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数收益率以外的其他市场价格变量保持不变		
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）
	沪深 300 指数收益率上升 5%	8,368,758.46	831,749.56
	沪深 300 指数收益率下降 5%	-8,368,758.46	-831,749.56

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

本基金本报告期不适用。

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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	188,966,997.49	46,498,586.83
第二层次	394,401,124.98	62,961,486.32
第三层次	-	-
合计	583,368,122.47	109,460,073.15

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资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，确定相关投资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

本基金本报告期末及上年度末均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

无。

§ 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	139,694,039.14	14.10
	其中：股票	139,694,039.14	14.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	443,674,083.33	44.78
	其中：债券	443,674,083.33	44.78
	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	160,505,323.14	16.20
	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	224,760,678.15	22.69
8	其他各项资产	22,085,108.59	2.23
9	合计	990,719,232.35	100.00

注：存放在证券经纪商的证券交易资金账户中的证券交易结算资金统计在“其他各项资产”内的“存出保证金”项下。

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	480,786.00	0.05
B	采矿业	3,894,591.00	0.40
C	制造业	101,748,946.05	10.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,219,639.00	0.23
E	建筑业	1,163,063.00	0.12
F	批发和零售业	254,961.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	2,059,301.34	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,697,821.31	1.10
J	金融业	14,942,282.00	1.54
K	房地产业	323,481.00	0.03

L	租赁和商务服务业	658,530.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	1,051,295.44	0.11
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	159,418.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	39,924.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	139,694,039.14	14.39

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通标的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	7,700	9,779,000.00	1.01
2	300502	新易盛	11,560	7,016,920.00	0.72
3	300750	宁德时代	12,700	4,991,227.00	0.51
4	300476	胜宏科技	7,600	2,632,868.00	0.27
5	300394	天孚通信	8,020	2,427,493.60	0.25
6	600519	贵州茅台	2,000	2,370,980.00	0.24
7	688777	中控技术	19,811	2,327,792.50	0.24
8	603986	兆易创新	2,100	1,711,500.00	0.18
9	300274	阳光电源	10,300	1,637,906.00	0.17
10	688256	寒武纪	1,022	1,630,652.10	0.17
11	600030	中信证券	52,100	1,496,833.00	0.15
12	300486	东杰智能	63,300	1,351,455.00	0.14
13	601899	紫金矿业	53,600	1,347,504.00	0.14
14	600036	招商银行	37,200	1,320,600.00	0.14
15	002371	北方华创	1,300	1,149,928.00	0.12
16	300059	东方财富	54,200	1,104,596.00	0.11
17	002475	立讯精密	15,500	1,091,200.00	0.11
18	002384	东山精密	4,100	1,075,635.00	0.11
19	688008	澜起科技	3,467	1,074,423.30	0.11
20	000333	美的集团	14,200	1,072,526.00	0.11
21	688041	海光信息	2,880	1,066,464.00	0.11
22	600900	长江电力	38,800	1,027,036.00	0.11
23	688981	中芯国际	6,319	1,003,583.58	0.10
24	688012	中微公司	2,072	970,732.00	0.10

25	300408	三环集团	5,700	951,330.00	0.10
26	000725	京东方 A	108,300	940,044.00	0.10
27	688766	普冉股份	1,209	926,819.40	0.10
28	301308	江波龙	1,300	914,940.00	0.09
29	603259	药明康德	7,300	908,923.00	0.09
30	688072	拓荆科技	1,089	906,048.00	0.09
31	601138	工业富联	12,200	880,230.00	0.09
32	300604	长川科技	2,500	853,550.00	0.09
33	600183	生益科技	4,900	849,660.00	0.09
34	601166	兴业银行	50,800	841,248.00	0.09
35	688200	华峰测控	1,549	813,379.90	0.08
36	688521	芯原股份	2,146	796,466.44	0.08
37	688037	芯源微	1,751	768,776.55	0.08
38	688146	中船特气	2,076	726,579.24	0.07
39	688313	仕佳光子	3,913	722,535.45	0.07
40	601398	工商银行	101,300	716,191.00	0.07
41	688017	绿的谐波	1,689	705,765.54	0.07
42	002594	比亚迪	8,700	693,390.00	0.07
43	600276	恒瑞医药	13,100	681,724.00	0.07
44	688019	安集科技	2,003	679,938.38	0.07
45	688002	睿创微纳	4,371	676,149.99	0.07
46	601688	华泰证券	32,100	661,902.00	0.07
47	601211	国泰海通	35,800	651,560.00	0.07
48	002463	沪电股份	4,200	641,760.00	0.07
49	688409	富创精密	2,075	635,468.75	0.07
50	000100	TCL 科技	109,000	634,380.00	0.07
51	600176	中国巨石	8,700	634,056.00	0.07
52	688167	炬光科技	1,726	611,366.46	0.06
53	000988	华工科技	3,300	609,213.00	0.06
54	601328	交通银行	90,000	578,700.00	0.06
55	688627	精智达	790	564,850.00	0.06
56	688630	芯碁微装	1,028	564,772.92	0.06
57	688172	燕东微	6,614	553,327.24	0.06
58	300857	协创数据	1,600	543,840.00	0.06
59	600584	长电科技	5,000	517,750.00	0.05
60	600919	江苏银行	48,000	517,440.00	0.05
61	601288	农业银行	85,100	516,557.00	0.05
62	688141	杰华特	3,358	515,453.00	0.05
63	603019	中科曙光	4,700	503,981.00	0.05
64	600150	中国船舶	14,900	503,471.00	0.05
65	000651	格力电器	13,400	502,500.00	0.05
66	688234	天岳先进	2,762	479,234.62	0.05
67	603993	洛阳钼业	27,100	475,605.00	0.05

68	000858	五粮液	6,400	473,600.00	0.05
69	300450	先导智能	11,500	468,280.00	0.05
70	300395	菲利华	3,500	468,055.00	0.05
71	600887	伊利股份	19,300	462,428.00	0.05
72	002916	深南电路	1,000	457,900.00	0.05
73	600309	万华化学	6,600	451,506.00	0.05
74	688536	思瑞浦	1,239	451,107.51	0.05
75	300548	长芯博创	1,600	444,800.00	0.05
76	000338	潍柴动力	16,100	438,725.00	0.05
77	600111	北方稀土	8,900	427,645.00	0.04
78	688052	纳芯微	1,462	421,509.22	0.04
79	688548	广钢气体	7,860	409,506.00	0.04
80	601816	京沪高铁	88,900	402,717.00	0.04
81	300033	同花顺	1,640	395,240.00	0.04
82	688411	海博思创	1,355	394,576.00	0.04
83	600089	特变电工	17,500	393,750.00	0.04
84	601857	中国石油	45,300	393,204.00	0.04
85	300433	蓝思科技	7,300	391,718.00	0.04
86	300124	汇川技术	5,800	384,714.00	0.04
87	600000	浦发银行	44,600	384,006.00	0.04
88	002028	思源电气	2,200	380,600.00	0.04
89	002415	海康威视	10,600	362,520.00	0.04
90	601088	中国神华	9,100	355,264.00	0.04
91	000938	紫光股份	12,300	354,978.00	0.04
92	688629	华丰科技	1,887	353,831.37	0.04
93	002202	金风科技	14,500	346,550.00	0.04
94	000063	中兴通讯	9,500	343,805.00	0.04
95	688235	百济神州	1,348	343,214.28	0.04
96	002050	三花智控	7,700	337,491.00	0.03
97	002353	杰瑞股份	2,200	335,500.00	0.03
98	000657	中钨高新	3,500	335,020.00	0.03
99	688387	信科移动	16,694	331,208.96	0.03
100	601601	中国太保	11,600	330,832.00	0.03
101	688147	微导纳米	2,012	325,702.56	0.03
102	688123	聚辰股份	1,528	324,852.80	0.03
103	000792	盐湖股份	10,700	323,033.00	0.03
104	688195	腾景科技	1,656	318,912.48	0.03
105	688205	德科立	1,530	318,530.70	0.03
106	300567	精测电子	1,000	317,600.00	0.03
107	688322	奥比中光	2,419	315,800.45	0.03
108	688385	复旦微电	4,343	309,612.47	0.03
109	002142	宁波银行	10,200	302,838.00	0.03
110	002714	牧原股份	8,600	300,914.00	0.03

111	600031	三一重工	17,340	299,635.20	0.03
112	600549	厦门钨业	3,500	298,200.00	0.03
113	600941	中国移动	3,400	292,842.00	0.03
114	601012	隆基绿能	22,000	288,640.00	0.03
115	601728	中国电信	55,400	287,526.00	0.03
116	601225	陕西煤业	14,000	284,900.00	0.03
117	601229	上海银行	32,000	277,760.00	0.03
118	688301	奕瑞科技	2,206	273,544.00	0.03
119	300014	亿纬锂能	4,200	273,126.00	0.03
120	688676	金盘科技	3,222	272,710.08	0.03
121	601668	中国建筑	62,200	269,948.00	0.03
122	600406	国电南瑞	11,800	269,630.00	0.03
123	002230	科大讯飞	6,500	265,460.00	0.03
124	300620	光库科技	700	264,740.00	0.03
125	601919	中远海控	19,800	262,548.00	0.03
126	688331	荣昌生物	2,000	260,520.00	0.03
127	002600	领益智造	14,600	253,164.00	0.03
128	601939	建设银行	26,200	252,306.00	0.03
129	688266	泽璟制药	2,157	251,635.62	0.03
130	600460	士兰微	4,600	251,436.00	0.03
131	601995	中金公司	6,900	249,435.00	0.03
132	300442	润泽科技	3,000	249,210.00	0.03
133	600926	杭州银行	17,200	248,540.00	0.03
134	688549	中巨芯	6,724	247,510.44	0.03
135	601988	中国银行	42,700	244,244.00	0.03
136	002352	顺丰控股	7,800	243,828.00	0.03
137	601872	招商轮船	13,500	237,195.00	0.02
138	603501	豪威集团	2,500	237,125.00	0.02
139	002602	世纪华通	16,600	234,060.00	0.02
140	300390	天华新能	2,500	233,775.00	0.02
141	002466	天齐锂业	3,800	233,016.00	0.02
142	600690	海尔智家	11,400	232,674.00	0.02
143	300760	迈瑞医疗	1,700	230,911.00	0.02
144	300136	信维通信	1,900	226,575.00	0.02
145	002709	天赐材料	4,400	226,292.00	0.02
146	688343	云天励飞	2,746	224,238.36	0.02
147	688390	固德威	2,060	223,530.60	0.02
148	600016	民生银行	69,400	223,468.00	0.02
149	002837	英维克	2,800	222,768.00	0.02
150	688126	沪硅产业	5,485	218,796.65	0.02
151	601985	中国核电	24,200	218,526.00	0.02
152	002241	歌尔股份	9,600	216,288.00	0.02
153	002460	赣锋锂业	3,300	215,820.00	0.02

154	688102	斯瑞新材	4,566	215,423.88	0.02
155	601100	恒立液压	2,000	215,120.00	0.02
156	300058	蓝色光标	15,600	214,656.00	0.02
157	688772	珠海冠宇	10,800	212,004.00	0.02
158	600660	福耀玻璃	4,200	211,848.00	0.02
159	688484	南芯科技	3,738	211,159.62	0.02
160	002938	鹏鼎控股	2,000	210,760.00	0.02
161	688082	盛美上海	484	209,088.00	0.02
162	603288	海天味业	6,300	208,908.00	0.02
163	601169	北京银行	42,600	208,740.00	0.02
164	300672	国科微	700	206,500.00	0.02
165	300418	昆仑万维	5,100	205,836.00	0.02
166	300373	扬杰科技	1,300	204,399.00	0.02
167	002049	紫光国微	2,300	204,125.00	0.02
168	688400	凌云光	3,074	203,498.80	0.02
169	688018	乐鑫科技	1,581	202,241.52	0.02
170	300661	圣邦股份	1,400	200,872.00	0.02
171	601658	邮储银行	40,700	200,651.00	0.02
172	688180	君实生物	5,848	197,779.36	0.02
173	000977	浪潮信息	2,800	196,000.00	0.02
174	600999	招商证券	9,200	194,120.00	0.02
175	600028	中国石化	43,300	193,118.00	0.02
176	603799	华友钴业	4,000	193,040.00	0.02
177	688433	华曙高科	2,249	192,514.40	0.02
178	000425	徐工机械	23,700	191,733.00	0.02
179	600160	巨化股份	3,600	190,836.00	0.02
180	300054	鼎龙股份	1,800	190,746.00	0.02
181	600938	中国海油	7,000	190,050.00	0.02
182	600989	宝丰能源	9,300	189,069.00	0.02
183	688449	联芸科技	2,178	187,983.18	0.02
184	688005	容百科技	6,135	187,731.00	0.02
185	600104	上汽集团	19,200	187,392.00	0.02
186	601628	中国人寿	5,300	187,355.00	0.02
187	002179	中航光电	4,000	184,800.00	0.02
188	601888	中国中免	3,400	182,614.00	0.02
189	002625	光启技术	6,000	181,920.00	0.02
190	600362	江西铜业	4,200	181,860.00	0.02
191	301200	大族数控	500	180,325.00	0.02
192	601600	中国铝业	21,900	180,018.00	0.02
193	300498	温氏股份	14,600	179,872.00	0.02
194	002001	新和成	6,300	179,046.00	0.02
195	000776	广发证券	7,500	175,500.00	0.02
196	600809	山西汾酒	1,600	174,992.00	0.02

197	688116	天奈科技	4,519	172,625.80	0.02
198	688582	芯动联科	2,636	171,340.00	0.02
199	601825	沪农商行	22,800	170,772.00	0.02
200	000568	泸州老窖	2,200	170,544.00	0.02
201	601766	中国中车	32,100	166,920.00	0.02
202	000408	藏格矿业	2,400	166,368.00	0.02
203	600547	山东黄金	7,200	166,248.00	0.02
204	601390	中国中铁	39,700	165,549.00	0.02
205	301377	鼎泰高科	300	165,270.00	0.02
206	688097	博众精工	2,620	165,191.00	0.02
207	688327	云从科技	13,027	162,316.42	0.02
208	601006	大秦铁路	35,100	161,811.00	0.02
209	688615	合合信息	1,419	160,488.90	0.02
210	300015	爱尔眼科	19,300	159,418.00	0.02
211	301526	国际复材	3,400	158,678.00	0.02
212	600050	中国联通	39,400	157,600.00	0.02
213	300972	万辰集团	900	156,069.00	0.02
214	600346	恒力石化	8,800	155,848.00	0.02
215	300803	指南针	1,700	155,839.00	0.02
216	688114	华大智造	2,992	152,831.36	0.02
217	688001	华兴源创	1,767	151,431.90	0.02
218	600010	宝钢股份	67,300	150,079.00	0.02
219	600489	中金黄金	8,300	149,815.00	0.02
220	688692	达梦数据	611	149,261.19	0.02
221	600426	华鲁恒升	6,200	148,304.00	0.02
222	300666	江丰电子	400	147,440.00	0.02
223	688432	有研硅	3,688	147,409.36	0.02
224	000538	云南白药	3,100	146,847.00	0.02
225	688352	颀中科技	6,061	146,554.98	0.02
226	601009	南京银行	14,800	146,372.00	0.02
227	600795	国电电力	31,300	146,171.00	0.02
228	601818	光大银行	50,500	145,945.00	0.02
229	688271	联影医疗	1,439	145,669.97	0.02
230	300806	斯迪克	1,300	145,600.00	0.01
231	301269	华大九天	1,200	143,304.00	0.01
232	601336	新华保险	2,400	143,184.00	0.01
233	688248	南网科技	2,058	142,372.44	0.01
234	300748	金力永磁	4,600	141,910.00	0.01
235	600893	航发动力	3,700	141,858.00	0.01
236	600905	三峡能源	38,200	141,722.00	0.01
237	601127	赛力斯	2,300	140,875.00	0.01
238	601916	浙商银行	53,400	140,442.00	0.01
239	688183	生益电子	1,054	139,549.60	0.01

240	300316	晶盛机电	2,300	138,920.00	0.01
241	601868	中国能建	51,800	138,306.00	0.01
242	688318	财富趋势	1,936	138,056.16	0.01
243	688396	华润微	1,410	137,545.50	0.01
244	601066	中信建投	4,700	136,629.00	0.01
245	600009	上海机场	5,900	136,290.00	0.01
246	688778	厦钨新能	2,489	135,401.60	0.01
247	688279	峰岬科技	603	135,337.32	0.01
248	302132	中航成飞	2,300	134,136.00	0.01
249	600585	海螺水泥	7,900	133,905.00	0.01
250	002311	海大集团	3,000	133,830.00	0.01
251	601456	国联民生	15,100	133,484.00	0.01
252	688516	奥特维	2,311	132,628.29	0.01
253	688332	中科蓝讯	839	132,142.50	0.01
254	603893	瑞芯微	700	131,852.00	0.01
255	601377	兴业证券	21,800	131,672.00	0.01
256	600029	南方航空	25,400	131,572.00	0.01
257	600066	宇通客车	4,900	131,369.00	0.01
258	000768	中航西飞	6,400	131,072.00	0.01
259	600415	小商品城	12,900	131,064.00	0.01
260	603296	华勤技术	1,760	130,715.20	0.01
261	688726	拉普拉斯	2,468	130,433.80	0.01
262	601998	中信银行	18,800	130,284.00	0.01
263	002027	分众传媒	26,900	130,196.00	0.01
264	688295	中复神鹰	2,142	129,676.68	0.01
265	605117	德业股份	1,220	129,539.60	0.01
266	601838	成都银行	7,300	129,210.00	0.01
267	301358	湖南裕能	1,700	128,979.00	0.01
268	600958	东方证券	13,600	128,384.00	0.01
269	688166	博瑞医药	3,667	128,381.67	0.01
270	601788	光大证券	8,800	126,984.00	0.01
271	000157	中联重科	18,200	126,854.00	0.01
272	688047	龙芯中科	818	126,520.06	0.01
273	000630	铜陵有色	19,700	125,292.00	0.01
274	000625	长安汽车	17,400	124,758.00	0.01
275	600674	川投能源	8,800	124,696.00	0.01
276	601186	中国铁建	20,900	124,355.00	0.01
277	000807	云铝股份	5,600	123,984.00	0.01
278	600760	中航沈飞	3,000	123,300.00	0.01
279	600118	中国卫星	1,500	123,075.00	0.01
280	600482	中国动力	3,700	121,360.00	0.01
281	600196	复星医药	5,400	121,338.00	0.01
282	600019	宝钢股份	22,300	121,089.00	0.01

283	300953	震裕科技	900	120,330.00	0.01
284	002532	天山铝业	11,100	119,103.00	0.01
285	601689	拓普集团	2,100	118,482.00	0.01
286	601877	正泰电器	4,700	117,829.00	0.01
287	688779	五矿新能	14,334	116,248.74	0.01
288	601117	中国化学	15,800	116,130.00	0.01
289	002558	巨人网络	4,200	115,752.00	0.01
290	300866	安克创新	1,100	114,950.00	0.01
291	601319	中国人保	16,800	113,568.00	0.01
292	688278	特宝生物	2,076	112,934.40	0.01
293	601881	中国银河	8,900	111,873.00	0.01
294	688281	华秦科技	2,216	111,309.68	0.01
295	688063	派能科技	2,064	109,949.28	0.01
296	601698	中国卫通	3,600	108,900.00	0.01
297	601077	渝农商行	17,500	106,925.00	0.01
298	600048	保利发展	23,000	106,490.00	0.01
299	688111	金山办公	498	106,098.90	0.01
300	688006	杭可科技	2,848	104,094.40	0.01
301	688029	南微医学	1,447	103,894.60	0.01
302	600372	中航机载	9,400	101,990.00	0.01
303	688363	华熙生物	2,825	101,050.25	0.01
304	601800	中国交建	17,500	99,925.00	0.01
305	688798	艾为电子	1,357	99,495.24	0.01
306	688506	百利天恒	336	98,794.08	0.01
307	600039	四川路桥	12,600	98,532.00	0.01
308	600436	片仔癀	900	98,352.00	0.01
309	600115	中国东航	25,800	98,298.00	0.01
310	688336	三生国健	1,851	98,288.10	0.01
311	600438	通威股份	8,100	98,091.00	0.01
312	600875	东方电气	3,400	97,818.00	0.01
313	688088	虹软科技	2,743	97,513.65	0.01
314	601878	浙商证券	10,200	96,900.00	0.01
315	600011	华能国际	12,500	94,875.00	0.01
316	002493	荣盛石化	8,800	94,600.00	0.01
317	600741	华域汽车	6,000	93,120.00	0.01
318	688382	益方生物	5,155	92,790.00	0.01
319	000002	万科 A	31,300	92,648.00	0.01
320	300236	上海新阳	700	92,050.00	0.01
321	688567	孚能科技	8,709	91,444.50	0.01
322	688612	威迈斯	3,081	91,166.79	0.01
323	300438	鹏辉能源	1,100	91,135.00	0.01
324	600015	华夏银行	14,100	90,099.00	0.01
325	601669	中国电建	18,900	88,830.00	0.01

326	600930	华电新能	18,300	87,291.00	0.01
327	300602	飞荣达	1,700	87,040.00	0.01
328	001979	招商蛇口	13,500	86,805.00	0.01
329	688584	上海合晶	2,408	86,567.60	0.01
330	688709	成都华微	2,226	84,788.34	0.01
331	688192	迪哲医药	2,095	83,653.35	0.01
332	688349	三一重能	5,503	83,535.54	0.01
333	600188	兖矿能源	4,700	83,519.00	0.01
334	601111	中国国航	13,700	82,885.00	0.01
335	601238	广汽集团	16,300	82,804.00	0.01
336	688223	晶科能源	17,377	82,540.75	0.01
337	688563	航材股份	1,592	81,558.16	0.01
338	601633	长城汽车	5,400	81,486.00	0.01
339	000166	申万宏源	18,400	80,960.00	0.01
340	003816	中国广核	20,700	80,937.00	0.01
341	002422	科伦药业	2,100	80,892.00	0.01
342	688425	铁建重工	20,061	80,645.22	0.01
343	300003	乐普医疗	6,800	80,580.00	0.01
344	600570	恒生电子	3,800	80,522.00	0.01
345	002648	卫星化学	3,400	79,866.00	0.01
346	300684	中石科技	1,300	79,300.00	0.01
347	600600	青岛啤酒	1,500	78,345.00	0.01
348	600886	国投电力	5,800	77,198.00	0.01
349	601898	中煤能源	6,200	75,516.00	0.01
350	600588	用友网络	8,200	75,276.00	0.01
351	688561	奇安信	3,134	75,153.32	0.01
352	001965	招商公路	8,200	75,112.00	0.01
353	601058	赛轮轮胎	6,500	74,945.00	0.01
354	688523	航天环宇	1,425	74,670.00	0.01
355	300413	芒果超媒	5,100	74,613.00	0.01
356	300346	南大光电	800	74,120.00	0.01
357	688708	佳驰科技	1,447	73,507.60	0.01
358	002236	大华股份	4,400	72,556.00	0.01
359	688036	传音控股	1,212	71,447.40	0.01
360	300458	全志科技	1,800	71,028.00	0.01
361	600026	中远海能	3,800	68,172.00	0.01
362	600027	华电国际	15,100	67,195.00	0.01
363	001391	国货航	16,500	67,155.00	0.01
364	688789	宏华数科	1,259	66,941.03	0.01
365	301205	联特科技	200	66,820.00	0.01
366	603392	万泰生物	2,400	64,728.00	0.01
367	000301	东方盛虹	5,600	64,120.00	0.01
368	688153	唯捷创芯	1,992	63,983.04	0.01

369	300409	道氏技术	3,200	63,776.00	0.01
370	301236	软通动力	1,500	63,675.00	0.01
371	605499	东鹏饮料	510	62,949.30	0.01
372	002736	国信证券	6,300	62,937.00	0.01
373	300139	晓程科技	1,700	62,135.00	0.01
374	300850	新强联	2,300	61,640.00	0.01
375	601618	中国中冶	25,200	61,488.00	0.01
376	601360	三六零	7,000	60,830.00	0.01
377	688068	热景生物	691	59,840.60	0.01
378	000975	山金国际	3,500	59,500.00	0.01
379	603369	今世缘	2,500	59,275.00	0.01
380	688326	经纬恒润	818	57,979.84	0.01
381	688100	威胜信息	1,873	57,295.07	0.01
382	600023	浙能电力	10,800	56,808.00	0.01
383	301165	锐捷网络	700	56,315.00	0.01
384	688520	神州细胞	1,611	55,112.31	0.01
385	300102	乾照光电	2,100	54,684.00	0.01
386	601607	上海医药	3,500	53,900.00	0.01
387	000617	中油资本	8,100	53,379.00	0.01
388	300573	兴齐眼药	1,300	52,988.00	0.01
389	002074	国轩高科	1,900	52,269.00	0.01
390	688032	禾迈股份	597	50,458.44	0.01
391	300832	新产业	1,200	50,400.00	0.01
392	600025	华能水电	5,600	49,784.00	0.01
393	600918	中泰证券	9,300	49,476.00	0.01
394	688475	萤石网络	1,793	49,038.55	0.01
395	600803	新奥股份	3,000	47,400.00	0.00
396	600061	国投资本	7,200	47,160.00	0.00
397	000963	华东医药	1,600	44,992.00	0.00
398	600219	南山铝业	11,100	44,289.00	0.00
399	000895	双汇发展	1,900	42,560.00	0.00
400	002920	德赛西威	500	40,750.00	0.00
401	300251	光线传媒	3,600	39,924.00	0.00
402	600085	同仁堂	1,700	39,287.00	0.00
403	600515	海南机场	13,700	37,538.00	0.00
404	688819	天能股份	1,661	36,874.20	0.00
405	688472	阿特斯	3,240	35,056.80	0.00
406	002304	洋河股份	900	34,335.00	0.00
407	001280	中国铀业	500	33,350.00	0.00
408	688198	佰仁医疗	354	31,590.96	0.00
409	601021	春秋航空	673	30,675.34	0.00
410	601059	信达证券	1,800	29,142.00	0.00
411	000999	华润三九	1,200	26,988.00	0.00

412	601808	中海油服	2,300	24,863.00	0.00
413	601298	青岛港	2,800	22,540.00	0.00
414	600377	宁沪高速	1,900	21,983.00	0.00
415	300979	华利集团	700	20,825.00	0.00
416	600845	宝信软件	1,200	19,956.00	0.00
417	000708	中信特钢	1,500	18,930.00	0.00
418	600018	上港集团	3,500	16,520.00	0.00
419	300999	金龙鱼	700	16,282.00	0.00
420	300122	智飞生物	1,200	14,028.00	0.00
421	300896	爱美客	100	8,720.00	0.00
422	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
423	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
424	920189	康美特	200	1,628.00	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	300750	宁德时代	9,091,067.00	6.04
2	300308	中际旭创	8,131,489.00	5.40
3	300502	新易盛	5,819,008.80	3.87
4	600519	贵州茅台	4,636,545.00	3.08
5	601899	紫金矿业	2,955,999.64	1.96
6	600036	招商银行	2,691,240.00	1.79
7	300476	胜宏科技	2,613,516.00	1.74
8	300486	东杰智能	2,377,642.00	1.58
9	600900	长江电力	2,369,512.00	1.57
10	000333	美的集团	2,352,738.00	1.56
11	300394	天孚通信	2,347,693.00	1.56
12	688256	寒武纪	2,264,633.67	1.51
13	300274	阳光电源	2,157,344.00	1.43
14	688002	睿创微纳	2,125,205.81	1.41
15	688313	仕佳光子	2,013,028.36	1.34
16	601398	工商银行	1,953,830.00	1.30
17	688347	华虹宏力	1,937,621.54	1.29
18	688037	芯源微	1,854,527.18	1.23
19	688981	中芯国际	1,826,931.43	1.21
20	688777	中控技术	1,823,831.34	1.21

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	4,043,121.00	2.69
2	301486	致尚科技	2,641,895.00	1.76
3	688347	华虹宏力	2,260,853.96	1.50
4	688256	寒武纪	1,998,224.50	1.33
5	688002	睿创微纳	1,968,947.07	1.31
6	688110	东芯股份	1,936,096.90	1.29
7	300486	东杰智能	1,867,720.00	1.24
8	688498	源杰科技	1,797,818.40	1.19
9	600519	贵州茅台	1,649,140.00	1.10
10	688361	中科飞测	1,445,772.77	0.96
11	688313	仕佳光子	1,432,292.01	0.95
12	688981	中芯国际	1,419,833.86	0.94
13	688027	国盾量子	1,358,825.64	0.90
14	600900	长江电力	1,344,063.00	0.89
15	601398	工商银行	1,334,560.00	0.89
16	688385	复旦微电	1,330,118.71	0.88
17	600036	招商银行	1,314,654.00	0.87
18	688568	中科星图	1,275,355.55	0.85
19	688676	金盘科技	1,167,007.70	0.78
20	000333	美的集团	1,151,952.00	0.77

注：本项的“卖出金额”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。

7.4.3 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	252,564,908.37
卖出股票收入（成交）总额	140,086,091.81

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	48,591,254.19	5.00
2	央行票据	-	-
3	金融债券	344,893,854.79	35.52
	其中：政策性金融债	344,893,854.79	35.52

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）	50,188,974.35	5.17
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	443,674,083.33	45.70

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	260203	26 国开 03	2,100,000	212,580,008.22	21.89
2	260205	26 国开 05	1,100,000	112,040,997.26	11.54
3	019785	25 国债 13	237,000	23,999,223.86	2.47
4	019827	26 国债 01	113,000	11,373,245.67	1.17
5	250220	25 国开 20	100,000	10,220,186.30	1.05

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

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，届时将根据风险管理原则，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本报告期间，根据市场走势及股指期货基差水平，本基金进行了少量套期保值操作，未对组合净值产生重大影响，符合既定投资政策和投资目标。

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

在法律法规允许的范围内，本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，投资于国债期货合约，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本期国债期货投资通过买入套保调整组合久期，对基金总体风险影响不大，符合既定投资政策和投资目标。

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本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 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	20,894,343.20
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	1,190,765.39
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	22,085,108.59

注：本基金持有的存出保证金包含存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

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	113042	上银转债	5,358,116.21	0.55
2	118053	正帆转债	4,635,253.33	0.48

3	118040	宏微转债	4,411,669.65	0.45
4	113062	常银转债	4,367,109.95	0.45
5	127067	恒逸转 2	3,887,063.69	0.40
6	118024	冠宇转债	3,202,328.77	0.33
7	113624	正川转债	2,981,441.52	0.31
8	123178	花园转债	2,847,493.22	0.29
9	123251	华医转债	2,566,055.03	0.26
10	113658	密卫转债	2,548,744.34	0.26
11	110085	通 22 转债	1,615,453.52	0.17
12	123213	天源转债	1,552,262.13	0.16
13	127030	盛虹转债	1,457,392.18	0.15
14	127040	国泰转债	1,456,699.44	0.15
15	113056	重银转债	1,454,953.60	0.15
16	113051	节能转债	1,454,566.18	0.15
17	113631	皖天转债	1,190,186.14	0.12
18	113070	渝水转债	1,182,305.96	0.12
19	123165	回天转债	418,468.62	0.04
20	113667	春 23 转债	364,999.60	0.04
21	113673	岱美转债	352,775.59	0.04
22	110098	南药转债	313,230.63	0.03
23	110093	神马转债	220,902.68	0.02
24	123245	集智转债	166,428.98	0.02
25	113636	甬金转债	117,040.24	0.01
26	123122	富瀚转债	47,758.39	0.00
27	127064	杭氧转债	18,274.76	0.00

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。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，各比例的分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额类别	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	持有份额	占总份额

				比例		比例
同泰同欣混合 A	97	1,071,269.75	86,785,548.50	83.52%	17,127,617.46	16.48%
同泰同欣混合 C	1,048	831,703.88	278,480,176.93	31.95%	593,145,485.02	68.05%
合计	1,145	851,998.98	365,265,725.43	37.44%	610,273,102.48	62.56%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比	94.40

注：以上数值为百分比（%）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额类别	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	同泰同欣混合 A	0.00	0.0000%
	同泰同欣混合 C	10.02	0.0000%
	合计	10.02	0.0000%

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的情况

无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	同泰同欣混合 A	同泰同欣混合 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 27 日）基金份额总额	17,892,451.23	189,131,268.36
本报告期期初基金份额总额	50,693,226.48	105,253,343.30
本报告期基金总申购份额	76,645,894.49	1,272,791,237.23
减：本报告期基金总赎回份额	23,425,955.01	506,418,918.58
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	103,913,165.96	871,625,661.95

注：总申购份额含红利再投、转换入份额等；总赎回份额含转换出份额等。

§ 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2026 年 6 月 23 日，根据基金托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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、公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金提供审计服务的会计师事务所为上会会计师事务所（特殊普通合伙），本报告期内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

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无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，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无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	
华安证券	2	389,385,496.41	99.26%	194,363.76	98.69%	-
东方财富证券	4	2,581,308.64	0.66%	2,292.73	1.16%	-
平安证券	4	323,472.26	0.08%	286.15	0.15%	-

- 注：1、本基金使用券商结算模式。
- 2、本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。证券经纪商的选择标准主要包括：公司基本面评价（财务状况、资信状况、经营状况）；公司信息服务评价（全面性、及时性和高效性）等方面。
- 3、统计区间为本年度 1 月 1 日至 6 月 30 日。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华安证券	697,355,542.75	96.27%	2,145,850,000.00	73.33%	-	-	-	-
东方财富证券	22,273,865.95	3.07%	780,500,000.00	26.67%	-	-	-	-
平安证券	4,756,805.60	0.66%	-	-	-	-	-	-

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	同泰基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 9 日
2	同泰基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 21 日
3	同泰同欣混合型证券投资基金 2025 年	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 21 日

	第 4 季度报告		
4	同泰同欣混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 24 日
5	同泰同欣混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定的媒介	2026 年 1 月 24 日
6	同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 2 月 11 日
7	同泰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）	中国证监会规定的媒介	2026 年 3 月 5 日
8	同泰基金管理有限公司旗下基金年度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 3 月 27 日
9	同泰同欣混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 3 月 27 日
10	同泰基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 16 日
11	同泰基金管理有限公司关于同泰同欣混合型证券投资基金基金经理变更的公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 16 日
12	同泰同欣混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 16 日
13	同泰同欣混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 18 日
14	同泰同欣混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 18 日
15	同泰基金管理有限公司旗下基金季度报告提示性公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 21 日
16	同泰基金管理有限公司对外行使投票表决权(2025 年度)情况信息披露	中国证监会规定的媒介	2026 年 4 月 30 日
17	同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 5 月 22 日
18	同泰基金管理有限公司关于旗下基金新增代销机构并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 5 月 27 日
19	同泰基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定的媒介	2026 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260101-20260120	41,886,681.72	0.00	9,900,991.00	31,985,690.72	3.28%
	2	20260101-20260120	52,317,672.91	50,408,307.29	39,000,000.00	63,725,980.20	6.53%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，存在基金资产无法以合理价格及时变现以支付投资者赎回款的风险，以及基金份额净值出现大幅波动等风险，此外，还存在因巨额赎回或集中赎回导致连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，基金合同终止的风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《同泰同欣混合型证券投资基金基金合同》；
- 2、《同泰同欣混合型证券投资基金托管协议》；
- 3、报告期内同泰同欣混合型证券投资基金公告的各项原稿。

12.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人的住所或办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录中国证监会基金电子披露网站 (<http://eid.csrc.gov.cn/fund>) 或者基金管理人网站 (www.tongtaiamc.com) 查阅, 或在营业时间内至基金管理人住所免费查阅。

同泰基金管理有限公司

2026 年 8 月 27 日