

中加科鑫混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:中加基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 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。

基金托管人招商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01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.12 投资组合报告附注	64
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 盈利投资者数量占比	66

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	67
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	67
10.1 基金份额持有人大会决议	67
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	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	68
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	69
10.8 其他重大事件	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	72
12.3 查阅方式	72

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加科鑫混合型证券投资基金	
基金简称	中加科鑫混合	
基金主代码	010543	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021年05月26日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	289,570,113.33份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中加科鑫混合A	中加科鑫混合C
下属分级基金的交易代码	010543	010544
报告期末下属分级基金的份额总额	96,957,261.49份	192,612,851.84份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求超过业绩比较基准的投资回报，力争实现资产的长期、稳健增值。
投资策略	本基金通过前瞻性地判断不同金融资产的相对收益，完成大类资产配置。在大类资产配置的基础上，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。在严格的风险控制基础上，力争实现长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×40%+中债总全价（总值）指数收益率×60%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金。

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	中加基金管理有限公司	招商银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	刘凌	张姗
	联系电话	400-00-95526	400-61-95555
	电子邮箱	service@bobbns.com	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-00-95526	400-61-95555
传真		010-83197627	0755-83195201
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区南纬路35号	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		100050	518040
法定代表人		杨琳	缪建民

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.bobbns.com
基金中期报告置备地点	北京市西城区南纬路35号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中加基金管理有限公司	北京市西城区南纬路35号

§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01月01日-2026年06月30日)	
	中加科鑫混合A	中加科鑫混合C
本期已实现收益	2,228,394.30	3,421,724.71

本期利润	2,772,551.41	4,782,448.50
加权平均基金份额本期利润	0.0335	0.0324
本期加权平均净值利润率	3.21%	3.17%
本期基金份额净值增长率	3.65%	3.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	4,665,649.70	5,159,529.21
期末可供分配基金份额利润	0.0481	0.0268
期末基金资产净值	102,591,172.12	199,657,225.65
期末基金份额净值	1.0581	1.0366
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	5.81%	3.66%

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、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，不是当期发生额）。

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

中加科鑫混合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	2.74%	0.28%	5.03%	0.51%	-2.29%	-0.23%
过去六个月	3.65%	0.28%	3.52%	0.46%	0.13%	-0.18%
过去一年	9.38%	0.25%	9.50%	0.41%	-0.12%	-0.16%
过去三年	13.18%	0.28%	15.16%	0.43%	-1.98%	-0.15%

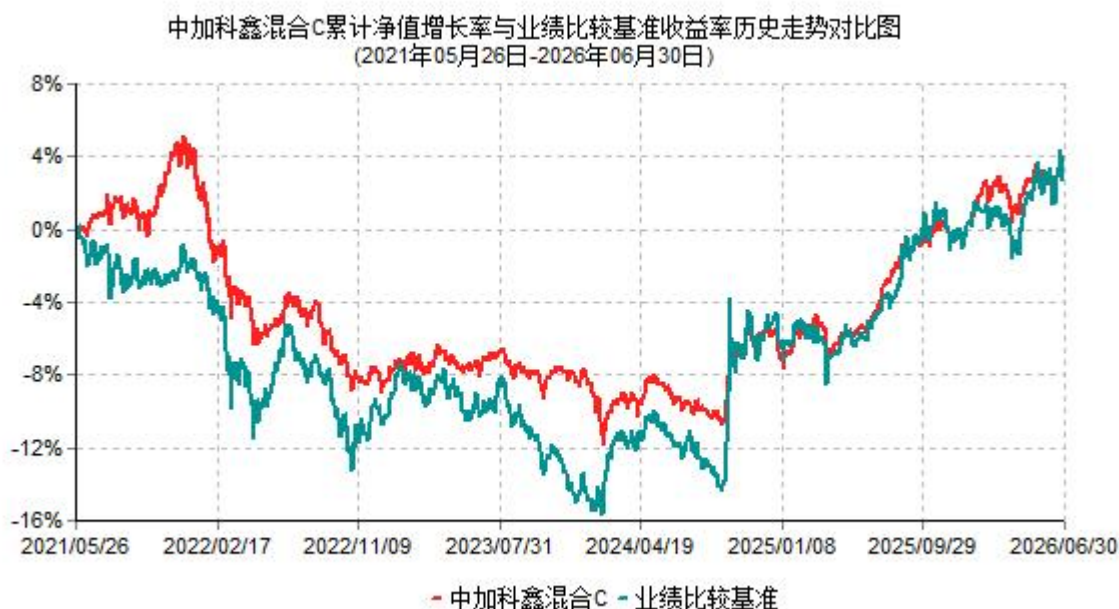
过去五年	4.91%	0.31%	4.53%	0.44%	0.38%	-0.13%
自基金合同生效起至今	5.81%	0.31%	3.73%	0.44%	2.08%	-0.13%

中加科鑫混合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	2.63%	0.28%	5.03%	0.51%	-2.40%	-0.23%
过去六个月	3.45%	0.28%	3.52%	0.46%	-0.07%	-0.18%
过去一年	8.94%	0.25%	9.50%	0.41%	-0.56%	-0.16%
过去三年	11.81%	0.28%	15.16%	0.43%	-3.35%	-0.15%
过去五年	2.82%	0.31%	4.53%	0.44%	-1.71%	-0.13%
自基金合同生效起至今	3.66%	0.31%	3.73%	0.44%	-0.07%	-0.13%

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





§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

本基金的基金管理人为中加基金管理有限公司，成立于2013年3月27日，是第三批银行系基金公司，注册资本为4.65亿元人民币，注册地为北京，股权比例为：北京银行股份有限公司44%、加拿大丰业银行28%、北京乾融投资（集团）有限公司12%、中地种业（集团）有限公司6%、中国有研科技集团有限公司5%、绍兴越华开发经营有限公司5%。

截至报告期末，本基金管理人共管理83只基金，涵盖股票型基金、债券型基金、混合型基金、货币市场基金以及基金中基金等多种基金类型，为投资者提供丰富的选择。

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		
于跃	本基金基金经理	2026-02-25	-	14	于跃先生，伦敦帝国理工大学金融数学硕士。2012年5

					月至2019年11月，曾先后任民生证券股份有限公司固收投资经理助理；中信建投证券股份有限公司固定收益投资经理。2019年12月加入中加基金管理有限公司，现任基金经理。
林沐尘	本基金基金经理	2023-04-27	-	8	林沐尘先生，对外经济贸易大学金融学硕士。2017年7月至2021年3月，就职于工银瑞信基金管理有限公司，任量化研究员。2021年3月至2022年6月，就职于中国国际金融股份有限公司股票业务部，任投资经理。2022年6月加入中加基金管理有限公司,现任基金经理。

注：1、任职日期说明：本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期。

2、离任日期说明：无。

3、证券从业年限的计算标准遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人始终将合规经营与基金运作的规范性置于首位。针对监管部门就2023年现场检查发现问题出具的警示函，基金管理人就检查期间所涉责任人员进行追溯问责。基金管理人召开了年中工作会暨合规工作大会，对合规管理工作进行总结部署，持续强化全员合规意识。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，不存在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

本基金交易过程中严格遵守《中加基金管理有限公司公平交易管理办法》，对买卖债券时候的价格和市场价格差距较大，可能存在操纵股价、利益输送等违法违规情况进行监控。本报告期，本基金的基金管理人不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了同日反向交易控制的规则，并且加强对组合间同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查。同时，公司利用公平交易分析系统，对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控，定期对组合间的同向交易进行分析。本报告期内，本公司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未超过该证券当日成交量的5%。投资组合间虽然存在同向交易行为，但结合交易价差分布统计分析和潜在利益输送金额统计结果，表明投资组合间不存在利益输送的可能性。本基金本报告期内未出现异常交易的情况。

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年上半年债券市场整体呈现“一季度震荡分化、二季度震荡下行”的格局。市场持续在国内基本面、流动性调控、政府债供给、外部风险等多重因素之间博弈，行情阶段性特征显著。资金面整体维持宽松基调，但预期波动加大；品种维度分化持续演绎，中短端信用资产具备较好配置价值，长端利率持续面临各类不确定性扰动。

2026年一季度债市受政策、资金、外部事件多重因素交织，整体震荡分化。1月受股市走强、政府债集中供给冲击，10年期国债收益率冲高至1.9%，后续流动性持续投放带动行情修复；2月宏观数据偏弱、避险情绪升温，利率震荡下行；3月市场走势分化，充裕资金推动短端走强，地缘冲突抬升油价与滞胀担忧压制长端。本季度信用债表现优于利率债，中短端资产收益突出，超长端波动显著，平稳资金环境助力信用利差持续收窄，整体结构性机会凸显。

二季度债市震荡走强，收益率中枢持续下行。4月资金超预期宽松带动长短端利率同步下行，曲线由牛陡转为牛平，季末供给压力带来小幅回调；5月前期各类扰动影响有限，疲软经济数据驱动收益率大幅下行，10年期国债收益率创年内低点；6月资金预期反复，月初流动性收紧压制债市，中下旬央行加码投放并落地隔夜逆回购工具，市场再度回暖。品种方面信用债持续走强、利差收窄，受供给影响，中短端二级资本债表现弱于普通信用债。

纵观上半年，宽松流动性是支撑债市行情的核心主线，但基本面预期、供给压力、外部风险不断制造阶段性波动。行情机会更多集中在中短端与信用品种，长端趋势性行情有限，波段操作与结构性配置成为上半年投资取胜的关键。

固收部分，我们整体保持产品仓位和久期的灵活性。一方面，在严格控制信用风险的前提下，精选中短久期中高等级城投债。另一方面，对于利率债和二级资本债，采用区间震荡的操作思路，为客户赚取资本利得，同时该类品种流动性好，在增强收益的同时也提升了组合流动性，使得产品的安全性提高。

今年一季度A股市场波动较大行业轮动较快，一、二月市场整体情绪较好，赛道主题类风格有较好的表现，有色、通讯设备、商业航天等轮动上涨。但三月由于外围地缘政治扰动，市场产生波动，前期强势板块有明显回调。

今年二季度A股市场极致分化，从五月开始至今，A股只有半导体、通信等行业上涨，其他行业、风格内股票几乎无差别下跌，科技行业从成交额占比、持仓比重等各个维度上看都处在极度亢奋状态。但AI下游其实问题已经日益凸显，包括大厂限制Token使用，数据中心延迟建设等等。因此我们认为后续风格收敛可能性逐渐加大，许多由于流动性被错杀的资产具有较好性价比。量化类策略在这样极致的市场中也受到较大冲击，但其相对低波动的属性在后续行情中会有较好的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加科鑫混合A基金份额净值为1.0581元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.65%，同期业绩比较基准收益率为3.52%；截至报告期末中加科鑫混合C基金份额净值为1.0366元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.45%，同期业绩比较基准收益率为3.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观层面，国内经济维持结构性分化格局，整体呈现温和修复态势，大幅走强与快速失速的概率均较低。通胀保持温和区间，政策保持灵活适度，货币政策以适应性调节为主，资金面维持合理充裕，但波动有所加大。外部扰动、政府债供给节奏、稳增长政策预期将持续交替影响市场情绪。债市方面，多空因素相互制衡，单边趋势行情难以出现，区间震荡将成为主线。一方面内需偏弱、配置资金持续入场对利率形成底部支撑；另一方面，经济边际改善预期、阶段性供给压力、资金边际收紧约束收益率下行空间。操作上，趋势性久期博弈难度提升，重心转向波段把握与结构性机会。后续重点跟踪资金松紧变化、宏观数据边际变化以及政策信号，在震荡行情中做好久期动态管理与流动性预案。

展望后市，我们认为目前市场风格分化较大，后续会有风格收敛回归的可能，依旧看好后续量化类产品超额收益修复的行情。

本基金权益部分持仓目前还是以偏中盘为主，展望未来当市场风格收敛时，量化策略会取得更佳的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值小组，由分管基金运营的公司领导任估值小组负责人，成员由分管风险合规的公司领导、固定收益部、权益投资部、基金运营部（营销服务部）、风险管理部、法律合规与内控部、集中交易部等部门负责人及业务骨干组成，若估值小组认为必要，可适当增减小组成员，业务骨干由估值小组认定和调整。基金经理可依据专业判断就估值政策标准等议题参与讨论并提出意见建议，但不能参与最终估值决策。估值小组主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响，以及对估值时所采用的估值模型、假设、参数及其验证机制进行审核并履行相关信息披露义务。

本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

本公司已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司签订三方协议，采用中债金融估值中心有限公司提供的估值数据对银行间债券进行估值；与中证指数有限公司签订协议，采用其提供的估值数据对交易所债券进行估值。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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发生连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于人民币五千万元的情形。

§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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中加科鑫混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	15,422,779.07	2,790,392.82
结算备付金		482,096.42	566,796.79
存出保证金		30,738.16	14,148.26
交易性金融资产	6.4.7.2	301,115,353.20	234,677,967.97
其中：股票投资		48,085,307.80	31,393,218.89
基金投资		-	-
债券投资		253,030,045.40	203,284,749.08
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		456,687.47	598,179.69
应收股利		-	-

应收申购款		1,441,932.17	135,088.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		318,949,586.49	238,782,573.68
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06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		15,000,678.08	48,013,912.14
应付清算款		-	136,866.34
应付赎回款		1,152,999.42	4,186,562.52
应付管理人报酬		200,991.36	142,295.33
应付托管费		50,247.86	35,573.83
应付销售服务费		67,257.06	49,681.69
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,670.70	9,705.89
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	219,344.24	159,936.39
负债合计		16,701,188.72	52,734,534.13
净资产:			
实收基金	6.4.7.7	289,570,113.33	184,520,268.99
未分配利润	6.4.7.8	12,678,284.44	1,527,770.56
净资产合计		302,248,397.77	186,048,039.55
负债和净资产总计		318,949,586.49	238,782,573.68

注：报告截止日2026年06月30日，A类基金份额净值为1.0581元，A类基金份额总额96,957,261.49份；C类基金份额净值为1.0366元，C类基金份额总额192,612,851.84份，总份额合计289,570,113.33份。

6.2 利润表

会计主体：中加科鑫混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		9,230,184.14	945,229.81
1.利息收入		45,298.30	37,817.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	42,993.17	12,674.30
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		2,305.13	25,143.41
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		7,213,534.70	497,452.82
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,512,015.16	34,754.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,413,175.59	380,269.70
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	288,343.95	82,428.32
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	1,904,880.90	409,372.51
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.17	66,470.24	586.77

号填列)			
减：二、营业总支出		1,675,184.23	266,695.71
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	936,836.06	192,075.09
2.托管费	6.4.10.2.2	234,209.06	48,018.69
3.销售服务费	6.4.10.2.3	298,255.39	1,132.07
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		95,369.13	-
其中：卖出回购金融资产支出		95,369.13	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		5,297.84	282.39
8.其他费用	6.4.7.19	105,216.75	25,187.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,554,999.91	678,534.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,554,999.91	678,534.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,554,999.91	678,534.10

6.3 净资产变动表

会计主体：中加科鑫混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06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	184,520,268.99	1,527,770.56	186,048,039.55
二、本期期初净资产	184,520,268.99	1,527,770.56	186,048,039.55

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	105,049,844.34	11,150,513.88	116,200,358.22
（一）、综合收益总额	-	7,554,999.91	7,554,999.91
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	105,049,844.34	3,595,513.97	108,645,358.31
其中：1.基金申购款	332,572,074.22	9,552,896.47	342,124,970.69
2.基金赎回款	-227,522,229.88	-5,957,382.50	-233,479,612.38
（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	289,570,113.33	12,678,284.44	302,248,397.77
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06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	51,860,412.27	-2,398,388.72	49,462,023.55
二、本期期初净资产	51,860,412.27	-2,398,388.72	49,462,023.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,575,794.41	785,674.97	-1,790,119.44
（一）、综合收益总额	-	678,534.10	678,534.10
（二）、本期基金	-2,575,794.41	107,140.87	-2,468,653.54

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	788,115.26	-39,098.75	749,016.51
2.基金赎回款	-3,363,909.67	146,239.62	-3,217,670.05
（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	49,284,617.86	-1,612,713.75	47,671,904.11

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：

杨琳

于春玲

于春玲

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

中加科鑫混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)依据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)于2020年10月22日证监许可[2020]2671号文准予募集注册，由中加基金管理有限公司(以下简称“中加基金”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》及配套规则和《中加科鑫混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)公开募集。本基金为契约型开放式混合型证券投资基金，存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金，托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金通过中加基金直销中心、招商银行、江苏汇林保大基金销售有限公司、北京度小满基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司等其他销售机构公开发售，募集期为自2021年4月12日起至2021年5月21日。本基金于2021年5月26日成立，成立之日基金实收份额为244,882,953.68份(含利息转份额7,009.57份)，发行价格为人民币1.00元。该资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)审验并出具验资报告。

根据经中国证监会备案的基金合同和《中加科鑫混合型证券投资基金招募说明书》的相关内容，本基金根据认购/申购费、销售服务费的收取方式不同，将基金份额分为不同的类别。认购/申购时收取认购/申购费，不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；认购/申购时不收取认购/申购费，从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置基金代码。由于两类份额的收费方式不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值并单独公告。投资人可自行选择认购、申购的基金份额类别。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、基金合同和《中加科鑫混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称"财政部")颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称"企业会计准则")的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称"基金业协会")颁布的《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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况、2026年度中期的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日至12月31日止。本期财务报表的编制期间为2026年1月1日至2026年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债 (或其一部分) 的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债 (或部分金融负债)。

(4)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回

款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动(包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额)形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行收益分配。每次收益分配比例详见届时基金管理人发布的公告，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配；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对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对

应的可供分配利润将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均保留到小数点后第2位，小数点后第3位开始舍去，舍去部分归基金资产；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司

股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、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号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公司（“挂牌公司”）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。

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。

(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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	15,422,779.07
等于：本金	15,419,806.56
加：应计利息	2,972.51
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	15,422,779.07

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	46,802,030.00	-	48,085,307.80	1,283,277.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	15,950,063.78	132,815.07	15,823,671.47	-259,207.38
	银行间市场	233,759,671.98	2,686,973.93	237,206,373.93	759,728.02
	合计	249,709,735.76	2,819,789.00	253,030,045.40	500,520.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		296,511,765.76	2,819,789.00	301,115,353.20	1,783,798.44

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2.12
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	130,007.08
其中：交易所市场	124,589.08
银行间市场	5,418.00
应付利息	-

预提费用-账户维护费	9,000.00
预提费用-审计费	20,827.67
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	219,344.24

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中加科鑫混合A

金额单位：人民币元

项目 (中加科鑫混合A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	61,793,742.31	61,793,742.31
本期申购	49,976,729.33	49,976,729.33
本期赎回（以“-”号填列）	-14,813,210.15	-14,813,210.15
本期末	96,957,261.49	96,957,261.49

6.4.7.7.2 中加科鑫混合C

金额单位：人民币元

项目 (中加科鑫混合C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	122,726,526.68	122,726,526.68
本期申购	282,595,344.89	282,595,344.89
本期赎回（以“-”号填列）	-212,709,019.73	-212,709,019.73
本期末	192,612,851.84	192,612,851.84

注：申购含红利再投、转换入份（金）额，赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中加科鑫混合A

单位：人民币元

项目 (中加科鑫混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
-----------------	-------	-------	---------

上年度末	1,050,139.33	234,298.28	1,284,437.61
本期期初	1,050,139.33	234,298.28	1,284,437.61
本期利润	2,228,394.30	544,157.11	2,772,551.41
本期基金份额交易产生的变动数	1,387,116.07	189,805.54	1,576,921.61
其中：基金申购款	1,948,407.83	316,269.76	2,264,677.59
基金赎回款	-561,291.76	-126,464.22	-687,755.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,665,649.70	968,260.93	5,633,910.63

6.4.7.8.2 中加科鑫混合C

单位：人民币元

项目 (中加科鑫混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-211,767.63	455,100.58	243,332.95
本期期初	-211,767.63	455,100.58	243,332.95
本期利润	3,421,724.71	1,360,723.79	4,782,448.50
本期基金份额交易产生的变动数	1,949,572.13	69,020.23	2,018,592.36
其中：基金申购款	5,602,424.57	1,685,794.31	7,288,218.88
基金赎回款	-3,652,852.44	-1,616,774.08	-5,269,626.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,159,529.21	1,884,844.60	7,044,373.81

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	42,363.77
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	583.59

其他	45.81
合计	42,993.17

6.4.7.10 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01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	247,957,049.59
减：卖出股票成本总额	243,163,986.42
减：交易费用	281,048.01
买卖股票差价收入	4,512,015.16

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01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	2,435,638.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-22,462.90
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	2,413,175.59

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01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	54,918,686.16
减：卖出债券（债	54,054,700.30

转股及债券到期兑 付) 成本总额	
减: 应计利息总额	883,327.86
减: 交易费用	3,120.90
买卖债券差价收入	-22,462.90

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期内无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金在本报告期内无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	288,343.95
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	288,343.95

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	1,904,880.90
——股票投资	1,178,009.53
——债券投资	726,871.37
——资产支持证券投资	-
——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	1,904,880.90

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	66,464.09
转换费收入	6.15
合计	66,470.24

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	20,827.67
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	6,281.71
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
其他费用	600.00
合计	105,216.75

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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

本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中加基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构及基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构

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

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

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01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	936,836.06	192,075.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	286,796.07	37,071.23
应支付基金管理人的净管理费	650,039.99	155,003.86

注：支付基金管理人中加基金的基金管理费按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管	234,209.06	48,018.69

费		
---	--	--

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 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01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加科鑫混合A	中加科鑫混合C	合计
中加基金 管理有限 公司	-	28.45	28.45
北京银行 股份有限 公司	-	281,931.85	281,931.85
招商银行 股份有限 公司	-	1,160.49	1,160.49
合计	-	283,120.79	283,120.79
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加科鑫混合A	中加科鑫混合C	合计
中加基金 管理有限 公司	-	38.01	38.01
北京银行 股份有限 公司	-	501.14	501.14
招商银行 股份有限	-	500.94	500.94

公司			
合计	-	1,040.09	1,040.09

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日C类资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：C类基金份额销售服务费=前一日C类份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内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

本基金在本报告期内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

中加科鑫混合A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	31,572,863.76	21,676,783.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	31,572,863.76	21,676,783.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比	32.56%	44.35%

例		
---	--	--

报告期内基金管理人未投资本基金C类份额。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	15,422,779.07	42,363.77	1,392,933.41	12,124.93

注：本基金的活期存款由基金托管人招商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计提。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与各关联方承销的证券。

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——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06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

于2026年06月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于2026年06月30日，本基金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06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15,000,678.08元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
250211	25国开11	2026-07-01	101.29	100,000	10,128,657.53
260401	26农发01	2026-07-01	100.82	67,000	6,755,160.28
合计				167,000	16,883,817.81

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日止，本基金无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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于2026年06月30日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。

基金管理人风险管理的政策是保护基金份额持有人的合法权益，确保基金管理人规范经营、稳健运作，防止和减少各类风险的发生。基金管理人建立了在董事会领导下的，由风险管理委员会、督察长、风险控制委员会、法律合规与内控部门、风险管理部门和相关业务部门组成的多层次风险管理组织架构。形成了一个由决策系统、执行系统和监督系统组成的有机整体，对公司的各类风险进行全面有效的控制。

本基金的基金管理人对金融工具的风险管理办法主要通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的可能性。从定量分析的角度，根据本基金的投资目标，结合基金资产运用金融工具特征进行特定的风险量化分析，建立量化模型及相关指标，形成日常量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠的对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指本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。

本基金的银行存款主要存放在本基金的托管人和信用风险较低的商业银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人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；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。

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。

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	12,141,621.37	11,058,941.37
合计	12,141,621.37	11,058,941.37

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2.未评级债券为期限在一年及以内的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。
3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	130,843,739.84	51,343,607.48

AAA以下	27,799,488.83	37,199,766.64
未评级	82,245,195.36	103,682,433.59
合计	240,888,424.03	192,225,807.71

注：1.债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2.未评级债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债及未有第三方机构评级的债务融资工具。
3.以上数据不含同业存单及资产支持证券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资
无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资
无。

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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日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。

于本报告期末，除卖出回购金融资产款余额（如有）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，除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12（如有）外，本基金未持有其他重大流动性风险的投资品种。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

报告期内，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》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等相关监管规定以及公司流动性

风险管理相关制度，对基金组合资产流动性指标与可变现资产进行管理，确保基金流动性管理符合合规内控要求，并使基金组合资产维持充足的流动性以应对开放期间投资者的赎回。报告期内，本基金暂无延期办理巨额赎回申请、延缓支付赎回款项等影响投资者的流动性风险事项。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生的波动的风险。本基金管理人定期对基金面临的利率敏感度缺口进行监控，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0 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	15,422,779.07	-	-	-	15,422,779.07
结算备付金	482,096.42	-	-	-	482,096.42
存出保证金	30,738.16	-	-	-	30,738.16
交易性金融资产	76,753,756.42	174,908,754.76	1,367,534.22	48,085,307.80	301,115,353.20
应收清算款	-	-	-	456,687.47	456,687.47
应收申购款	-	-	-	1,441,932.17	1,441,932.17
资产总计	92,689,370.07	174,908,754.76	1,367,534.22	49,983,927.44	318,949,586.49

负债					
卖出回购金融资产款	15,000,678.08	-	-	-	15,000,678.08
应付赎回款	-	-	-	1,152,999.42	1,152,999.42
应付管理人报酬	-	-	-	200,991.36	200,991.36
应付托管费	-	-	-	50,247.86	50,247.86
应付销售服务费	-	-	-	67,257.06	67,257.06
应交税费	-	-	-	9,670.70	9,670.70
其他负债	-	-	-	219,344.24	219,344.24
负债总计	15,000,678.08	-	-	1,700,510.64	16,701,188.72
利率敏感度缺口	77,688,691.99	174,908,754.76	1,367,534.22	48,283,416.80	302,248,397.77
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	2,790,392.82	-	-	-	2,790,392.82
结算备付金	566,796.79	-	-	-	566,796.79
存出保证金	14,148.26	-	-	-	14,148.26
交易性金融资	49,939,770.13	152,009,252.21	1,335,726.74	31,393,218.89	234,677,967.97

产					
应收清算款	-	-	-	598,179.69	598,179.69
应收申购款	-	-	-	135,088.15	135,088.15
资产总计	53,311,108.00	152,009,252.21	1,335,726.74	32,126,486.73	238,782,573.68
负债					
卖出回购金融资产款	48,013,912.14	-	-	-	48,013,912.14
应付清算款	-	-	-	136,866.34	136,866.34
应付赎回款	-	-	-	4,186,562.52	4,186,562.52
应付管理人报酬	-	-	-	142,295.33	142,295.33
应付托管费	-	-	-	35,573.83	35,573.83
应付销售服务费	-	-	-	49,681.69	49,681.69
应交税费	-	-	-	9,705.89	9,705.89
其他负债	-	-	-	159,936.39	159,936.39
负债总计	48,013,912.14	-	-	4,720,621.99	52,734,534.13
利率敏感度缺口	5,297,195.86	152,009,252.21	1,335,726.74	27,405,864.74	186,048,039.55

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,356,650.39	1,190,907.20
	市场利率上升25个基点	-1,356,650.39	-1,190,907.20

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格的风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06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	48,085,307.80	15.91	31,393,218.89	16.87
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	253,030,045.40	83.72	203,284,749.08	109.26

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	301,115,353.20	99.63	234,677,967.97	126.13

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06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	8,818,134.51	5,471,463.81
	业绩比较基准下降5%	-8,818,134.51	-5,471,463.81

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	57,444,864.72	40,265,709.73

第二层次	243,670,488.48	194,412,258.24
第三层次	-	-
合计	301,115,353.20	234,677,967.97

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（上年度期末：无）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2026年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	48,085,307.80	15.08
	其中：股票	48,085,307.80	15.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	253,030,045.40	79.33
	其中：债券	253,030,045.40	79.33
	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	15,904,875.49	4.99
8	其他各项资产	1,929,357.80	0.60
9	合计	318,949,586.49	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	99,728.00	0.03
B	采矿业	2,111,867.00	0.70
C	制造业	34,135,225.80	11.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	883,650.00	0.29
E	建筑业	286,876.00	0.09
F	批发和零售业	1,511,946.00	0.50
G	交通运输、仓储和邮政业	748,911.00	0.25
H	住宿和餐饮业	138,320.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,449,355.00	0.81
J	金融业	2,765,228.00	0.91
K	房地产业	741,512.00	0.25
L	租赁和商务服务业	703,449.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	466,530.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	406,450.00	0.13
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	589,248.00	0.19

S	综合	47,012.00	0.02
	合计	48,085,307.80	15.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	46,400	1,333,072.00	0.44
2	600487	亨通光电	9,900	1,082,466.00	0.36
3	300857	协创数据	2,260	768,174.00	0.25
4	300604	长川科技	2,100	716,982.00	0.24
5	688525	佰维存储	1,400	692,622.00	0.23
6	002281	光迅科技	2,600	668,044.00	0.22
7	301308	江波龙	900	633,420.00	0.21
8	000776	广发证券	24,100	563,940.00	0.19
9	300223	北京君正	2,100	522,690.00	0.17
10	688347	华虹宏力	1,500	504,450.00	0.17
11	301280	珠城科技	9,700	490,529.00	0.16
12	600498	烽火通信	6,600	485,760.00	0.16
13	300136	信维通信	4,000	477,000.00	0.16
14	600008	首创环保	174,600	474,912.00	0.16
15	600549	厦门钨业	5,400	460,080.00	0.15
16	600018	上港集团	96,800	456,896.00	0.15
17	603676	卫信康	55,400	445,970.00	0.15
18	300054	鼎龙股份	4,200	445,074.00	0.15
19	000657	中钨高新	4,600	440,312.00	0.15
20	002399	海普瑞	47,800	429,244.00	0.14

21	601811	新华文轩	38,400	420,096.00	0.14
22	600887	伊利股份	17,500	419,300.00	0.14
23	603587	地素时尚	35,800	397,738.00	0.13
24	000761	本钢板材	175,800	377,970.00	0.13
25	002436	兴森科技	7,400	377,030.00	0.12
26	002008	大族激光	2,500	375,275.00	0.12
27	603259	药明康德	3,000	373,530.00	0.12
28	688571	杭华股份	42,600	372,750.00	0.12
29	600662	外服控股	92,300	371,969.00	0.12
30	688469	芯联集成-U	34,600	367,106.00	0.12
31	002353	杰瑞股份	2,400	366,000.00	0.12
32	002273	水晶光电	10,000	354,800.00	0.12
33	600988	赤峰黄金	13,400	352,688.00	0.12
34	002851	麦格米特	2,100	351,078.00	0.12
35	600938	中国海油	12,900	350,235.00	0.12
36	000426	兴业银锡	9,900	326,304.00	0.11
37	600690	海尔智家	15,900	324,519.00	0.11
38	300623	捷捷微电	7,200	323,928.00	0.11
39	300757	罗博特科	500	309,500.00	0.10
40	301536	星宸科技	2,300	296,033.00	0.10
41	600601	方正科技	20,900	289,256.00	0.10
42	300390	天华新能	3,000	280,530.00	0.09
43	600019	宝钢股份	51,300	278,559.00	0.09
44	002887	绿茵生态	26,400	276,408.00	0.09
45	688820	盛合晶微	1,400	271,054.00	0.09
46	300475	香农芯创	900	270,000.00	0.09
47	002049	紫光国微	3,000	266,250.00	0.09
48	301666	大普微-UW	400	263,480.00	0.09
49	300285	国瓷材料	2,500	257,950.00	0.09
50	300567	精测电子	800	254,080.00	0.08
51	300308	中际旭创	200	254,000.00	0.08

52	603511	爱慕股份	21,600	248,400.00	0.08
53	000933	神火股份	11,700	248,040.00	0.08
54	603986	兆易创新	300	244,500.00	0.08
55	600150	中国船舶	7,200	243,288.00	0.08
56	688388	嘉元科技	5,500	242,000.00	0.08
57	601121	宝地矿业	41,000	231,240.00	0.08
58	300502	新易盛	380	230,660.00	0.08
59	601901	方正证券	31,400	226,080.00	0.07
60	002532	天山铝业	20,900	224,257.00	0.07
61	002738	中矿资源	3,700	218,263.00	0.07
62	601607	上海医药	14,100	217,140.00	0.07
63	688257	新锐股份	2,100	213,990.00	0.07
64	603111	康尼机电	35,900	203,194.00	0.07
65	688702	盛科通信-U	500	194,995.00	0.06
66	688818	电科蓝天	2,600	192,790.00	0.06
67	600989	宝丰能源	9,400	191,102.00	0.06
68	001389	广合科技	800	189,800.00	0.06
69	301358	湖南裕能	2,500	189,675.00	0.06
70	300154	瑞凌股份	25,200	189,504.00	0.06
71	300990	同飞股份	1,800	189,126.00	0.06
72	601857	中国石油	21,500	186,620.00	0.06
73	300458	全志科技	4,600	181,516.00	0.06
74	688090	瑞松科技	1,700	180,965.00	0.06
75	301559	中集环科	14,700	179,193.00	0.06
76	002837	英维克	2,230	177,418.80	0.06
77	600716	凤凰股份	52,500	176,400.00	0.06
78	000031	大悦城	83,100	176,172.00	0.06
79	001287	中电港	5,600	174,440.00	0.06
80	002917	金奥博	16,500	173,910.00	0.06
81	002340	格林美	26,300	173,843.00	0.06
82	688361	中科飞测	400	172,000.00	0.06

83	600563	法拉电子	900	171,720.00	0.06
84	605577	龙版传媒	19,200	169,152.00	0.06
85	002517	恺英网络	10,400	169,000.00	0.06
86	688629	华丰科技	900	168,759.00	0.06
87	300613	富瀚微	2,100	168,168.00	0.06
88	688017	绿的谐波	400	167,144.00	0.06
89	600816	建元信托	67,000	163,480.00	0.05
90	601279	英利汽车	53,300	162,565.00	0.05
91	003031	中瓷电子	900	162,270.00	0.05
92	601231	环旭电子	5,000	162,000.00	0.05
93	002155	湖南黄金	6,600	157,542.00	0.05
94	600309	万华化学	2,300	157,343.00	0.05
95	002662	峰璟股份	42,400	156,880.00	0.05
96	688002	睿创微纳	1,000	154,690.00	0.05
97	000517	荣安地产	93,100	154,546.00	0.05
98	688416	恒烁股份	1,100	154,000.00	0.05
99	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.05
100	002080	中材科技	1,700	153,000.00	0.05
101	301099	雅创电子	1,600	152,800.00	0.05
102	600361	创新新材	41,700	150,120.00	0.05
103	603706	东方环宇	8,600	148,694.00	0.05
104	300346	南大光电	1,600	148,240.00	0.05
105	603266	天龙股份	8,800	148,104.00	0.05
106	300570	太辰光	600	148,026.00	0.05
107	603708	家家悦	17,200	147,576.00	0.05
108	300512	中亚股份	21,500	146,630.00	0.05
109	301021	英诺激光	1,200	146,280.00	0.05
110	000338	潍柴动力	5,300	144,425.00	0.05
111	300184	力源信息	8,200	143,910.00	0.05
112	605005	合兴股份	9,000	142,290.00	0.05
113	002195	岩山科技	21,600	141,264.00	0.05

114	688025	杰普特	300	141,000.00	0.05
115	301048	金鹰重工	16,300	140,343.00	0.05
116	688059	华锐精密	700	139,797.00	0.05
117	000060	中金岭南	18,300	138,531.00	0.05
118	000428	华天酒店	45,500	138,320.00	0.05
119	301086	鸿富瀚	660	138,124.80	0.05
120	002130	沃尔核材	7,200	136,512.00	0.05
121	688620	安凯微	8,376	135,691.20	0.04
122	000032	深桑达A	5,400	134,730.00	0.04
123	600319	亚星化学	21,600	134,568.00	0.04
124	300450	先导智能	3,300	134,376.00	0.04
125	300768	迪普科技	9,700	133,569.00	0.04
126	002266	浙富控股	25,700	130,042.00	0.04
127	301696	三瑞智能	1,100	129,987.00	0.04
128	603967	中创物流	12,400	128,340.00	0.04
129	300724	捷佳伟创	1,800	127,080.00	0.04
130	603519	立霸股份	8,300	126,990.00	0.04
131	301329	信音电子	5,200	126,308.00	0.04
132	688378	奥来德	2,000	124,000.00	0.04
133	000415	渤海租赁	30,000	122,100.00	0.04
134	000100	TCL科技	20,800	121,056.00	0.04
135	600578	京能电力	18,700	120,615.00	0.04
136	300033	同花顺	500	120,500.00	0.04
137	603970	中农立华	12,500	120,375.00	0.04
138	300395	菲利华	900	120,357.00	0.04
139	600641	先导基电	3,000	119,580.00	0.04
140	300789	唐源电气	6,700	119,059.00	0.04
141	002922	伊戈尔	3,600	118,080.00	0.04
142	002297	博云新材	4,000	115,960.00	0.04
143	000983	山西焦煤	19,700	114,260.00	0.04
144	605155	西大门	9,500	112,480.00	0.04

145	600699	均胜电子	5,100	110,211.00	0.04
146	600392	盛和资源	3,700	110,149.00	0.04
147	688536	思瑞浦	300	109,227.00	0.04
148	301200	大族数控	300	108,195.00	0.04
149	600335	国机汽车	23,100	108,108.00	0.04
150	000651	格力电器	2,800	105,000.00	0.03
151	300697	电工合金	6,900	104,535.00	0.03
152	000792	盐湖股份	3,400	102,646.00	0.03
153	600724	宁波富达	20,200	102,414.00	0.03
154	300602	飞荣达	2,000	102,400.00	0.03
155	603083	剑桥科技	400	101,948.00	0.03
156	300447	全信股份	6,800	101,524.00	0.03
157	603799	华友钴业	2,100	101,346.00	0.03
158	600011	华能国际	13,300	100,947.00	0.03
159	688027	国盾量子	200	100,802.00	0.03
160	002402	和而泰	3,900	100,737.00	0.03
161	002745	木林森	8,000	100,400.00	0.03
162	600598	北大荒	9,200	99,728.00	0.03
163	600536	中国软件	3,500	98,420.00	0.03
164	600958	东方证券	10,400	98,176.00	0.03
165	300324	旋极信息	26,300	97,836.00	0.03
166	300921	南凌科技	4,800	97,488.00	0.03
167	603577	汇金通	10,300	97,026.00	0.03
168	600909	华安证券	8,600	95,546.00	0.03
169	603659	璞泰来	3,300	95,469.00	0.03
170	603680	今创集团	9,700	95,157.00	0.03
171	301380	挖金客	3,400	93,806.00	0.03
172	300822	贝仕达克	8,000	93,600.00	0.03
173	688372	伟测科技	500	93,000.00	0.03
174	601127	赛力斯	1,500	91,875.00	0.03
175	603290	斯达半导	600	91,764.00	0.03

176	605319	无锡振华	4,000	90,760.00	0.03
177	603071	物产环能	8,200	90,692.00	0.03
178	000599	青岛双星	21,000	88,620.00	0.03
179	600489	中金黄金	4,900	88,445.00	0.03
180	603345	安井食品	1,100	88,209.00	0.03
181	688368	晶丰明源	400	86,608.00	0.03
182	601179	中国西电	5,800	86,536.00	0.03
183	688052	纳芯微	300	86,493.00	0.03
184	301439	泓淋电力	5,400	84,888.00	0.03
185	688158	优刻得-W	2,300	84,548.00	0.03
186	688061	灿瑞科技	1,700	84,439.00	0.03
187	600426	华鲁恒升	3,500	83,720.00	0.03
188	688172	燕东微	1,000	83,660.00	0.03
189	002156	通富微电	1,100	83,457.00	0.03
190	002557	洽洽食品	4,600	82,616.00	0.03
191	300115	长盈精密	2,900	81,026.00	0.03
192	600299	安迪苏	10,300	80,855.00	0.03
193	300864	南大环境	4,200	80,556.00	0.03
194	002138	顺络电子	1,100	80,410.00	0.03
195	601512	中新集团	10,200	79,560.00	0.03
196	688183	生益电子	600	79,440.00	0.03
197	002666	德联集团	20,100	79,395.00	0.03
198	603790	雅运股份	3,700	78,958.00	0.03
199	300047	天源迪科	8,700	77,256.00	0.03
200	688195	腾景科技	400	77,032.00	0.03
201	600089	特变电工	3,400	76,500.00	0.03
202	300620	光库科技	200	75,640.00	0.03
203	000807	云铝股份	3,400	75,276.00	0.02
204	001696	宗申动力	3,600	74,916.00	0.02
205	688020	方邦股份	300	74,880.00	0.02
206	300058	蓝色光标	5,400	74,304.00	0.02

207	600939	重庆建工	30,600	71,910.00	0.02
208	300976	达瑞电子	900	71,685.00	0.02
209	600547	山东黄金	3,100	71,579.00	0.02
210	301219	腾远钴业	1,300	71,240.00	0.02
211	688167	炬光科技	200	70,842.00	0.02
212	000975	山金国际	4,100	69,700.00	0.02
213	002429	兆驰股份	6,600	68,574.00	0.02
214	300908	仲景食品	3,100	68,324.00	0.02
215	603320	迪贝电气	3,900	68,055.00	0.02
216	688484	南芯科技	1,200	67,788.00	0.02
217	603217	元利科技	3,000	67,290.00	0.02
218	300408	三环集团	400	66,760.00	0.02
219	000550	江铃汽车	4,100	66,502.00	0.02
220	601107	四川成渝	13,500	65,880.00	0.02
221	600792	云煤能源	20,300	64,351.00	0.02
222	601899	紫金矿业	2,500	62,850.00	0.02
223	300843	胜蓝股份	400	62,500.00	0.02
224	300271	华宇软件	12,900	62,178.00	0.02
225	001872	招商港口	3,200	62,176.00	0.02
226	688008	澜起科技	200	61,980.00	0.02
227	603439	三力制药	4,900	61,789.00	0.02
228	002052	同洲电子	7,800	60,606.00	0.02
229	688678	福立旺	2,500	60,425.00	0.02
230	002600	领益智造	3,400	58,956.00	0.02
231	600196	复星医药	2,600	58,422.00	0.02
232	002736	国信证券	5,800	57,942.00	0.02
233	001314	亿道信息	900	55,620.00	0.02
234	300496	中科创达	900	55,611.00	0.02
235	002111	威海广泰	6,100	54,900.00	0.02
236	688531	日联科技	300	53,352.00	0.02
237	002384	东山精密	200	52,470.00	0.02

238	301020	密封科技	2,400	52,416.00	0.02
239	688235	百济神州	200	50,922.00	0.02
240	001359	平安电工	400	50,100.00	0.02
241	688515	裕太微-U	200	49,752.00	0.02
242	301039	中集车辆	7,000	49,350.00	0.02
243	600499	科达制造	3,500	48,300.00	0.02
244	688800	瑞可达	500	47,985.00	0.02
245	603031	安孚科技	900	47,925.00	0.02
246	688328	深科达	500	47,850.00	0.02
247	002695	煌上煌	4,700	47,705.00	0.02
248	603719	良品铺子	5,500	47,575.00	0.02
249	600673	东阳光	1,400	47,012.00	0.02
250	301526	国际复材	1,000	46,670.00	0.02
251	600711	盛屯矿业	4,200	46,074.00	0.02
252	301100	风光股份	3,300	45,870.00	0.02
253	300951	博硕科技	900	45,450.00	0.02
254	300418	昆仑万维	1,100	44,396.00	0.01
255	300017	网宿科技	3,400	44,234.00	0.01
256	600884	杉杉股份	3,200	43,360.00	0.01
257	301316	慧博云通	1,100	43,318.00	0.01
258	603920	世运电路	900	43,236.00	0.01
259	600846	同济科技	4,300	43,000.00	0.01
260	601500	通用股份	11,500	41,975.00	0.01
261	300451	创业慧康	13,100	41,920.00	0.01
262	601211	国泰海通	2,300	41,860.00	0.01
263	002405	四维图新	6,300	40,761.00	0.01
264	002454	松芝股份	8,500	40,630.00	0.01
265	300590	移为通信	2,800	40,180.00	0.01
266	300031	宝通科技	1,400	39,998.00	0.01
267	002756	永兴材料	700	39,648.00	0.01
268	688628	优利德	400	39,576.00	0.01

269	300919	中伟新材	900	39,375.00	0.01
270	601688	华泰证券	1,900	39,178.00	0.01
271	601126	四方股份	600	37,920.00	0.01
272	301150	中一科技	600	37,866.00	0.01
273	600566	济川药业	1,700	37,723.00	0.01
274	002166	莱茵生物	6,000	37,680.00	0.01
275	603758	秦安股份	4,200	37,548.00	0.01
276	603176	汇通集团	8,700	37,236.00	0.01
277	688035	德邦科技	400	36,720.00	0.01
278	300457	赢合科技	1,700	35,836.00	0.01
279	603839	安正时尚	6,200	35,774.00	0.01
280	002154	报喜鸟	10,000	35,600.00	0.01
281	688258	卓易信息	300	35,562.00	0.01
282	300870	欧陆通	100	34,569.00	0.01
283	301019	宁波色母	1,900	33,877.00	0.01
284	603459	红板科技	300	33,663.00	0.01
285	605056	咸亨国际	2,100	33,600.00	0.01
286	605007	五洲特纸	2,500	33,475.00	0.01
287	300489	光智科技	100	31,195.00	0.01
288	688028	沃尔德	200	31,174.00	0.01
289	600618	氯碱化工	3,100	31,155.00	0.01
290	002712	思美传媒	7,300	30,295.00	0.01
291	301446	福事特	800	29,360.00	0.01
292	001337	四川黄金	800	29,328.00	0.01
293	301371	敷尔佳	1,100	28,600.00	0.01
294	300751	迈为股份	100	28,246.00	0.01
295	603068	博通集成	700	28,161.00	0.01
296	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.01
297	600684	珠江股份	9,000	27,090.00	0.01
298	002757	南兴股份	1,500	27,075.00	0.01
299	002465	海格通信	2,100	26,817.00	0.01

300	688781	视涯科技-U W	500	25,515.00	0.01
301	002961	瑞达期货	1,300	25,454.00	0.01
302	601518	吉林高速	9,000	25,200.00	0.01
303	001257	盛龙股份	900	25,002.00	0.01
304	002131	利欧股份	5,100	24,225.00	0.01
305	300002	神州泰岳	3,000	23,430.00	0.01
306	000600	建投能源	2,600	22,750.00	0.01
307	000156	华数传媒	3,500	22,085.00	0.01
308	000887	中鼎股份	1,200	21,468.00	0.01
309	001323	慕思股份	1,300	20,540.00	0.01
310	603192	汇得科技	1,200	20,328.00	0.01
311	688127	蓝特光学	200	19,520.00	0.01
312	002558	巨人网络	700	19,292.00	0.01
313	603738	泰晶科技	300	18,015.00	0.01
314	688387	信科移动-U	900	17,856.00	0.01
315	603877	太平鸟	1,400	16,562.00	0.01
316	605222	起帆电缆	700	16,324.00	0.01
317	605099	共创草坪	500	16,100.00	0.01
318	300748	金力永磁	500	15,425.00	0.01
319	300207	欣旺达	800	15,192.00	0.01
320	002261	拓维信息	500	14,005.00	0.00
321	601700	风范股份	3,200	13,952.00	0.00
322	601137	博威合金	600	13,398.00	0.00
323	300124	汇川技术	200	13,266.00	0.00
324	301489	思泉新材	80	13,166.40	0.00
325	688182	灿勤科技	300	12,921.00	0.00
326	600126	杭钢股份	2,100	12,873.00	0.00
327	002552	宝鼎科技	200	12,200.00	0.00
328	600726	华电能源	1,700	12,104.00	0.00
329	603515	欧普照明	700	11,438.00	0.00

330	002716	湖南白银	1,400	11,326.00	0.00
331	002484	江海股份	100	10,500.00	0.00
332	601816	京沪高铁	2,300	10,419.00	0.00
333	603312	西典新能	300	10,194.00	0.00
334	300903	科翔股份	100	10,131.00	0.00
335	002236	大华股份	600	9,894.00	0.00
336	600577	精达股份	1,000	9,780.00	0.00
337	300896	爱美客	100	8,720.00	0.00
338	000045	深纺织A	800	8,432.00	0.00
339	600663	陆家嘴	1,300	8,164.00	0.00
340	603013	亚普股份	500	7,895.00	0.00
341	000650	仁和药业	1,500	7,635.00	0.00
342	000697	炼石航空	700	7,266.00	0.00
343	688429	时创能源	700	7,133.00	0.00
344	600961	株冶集团	200	6,478.00	0.00
345	300394	天孚通信	20	6,053.60	0.00
346	601058	赛轮轮胎	500	5,765.00	0.00
347	600875	东方电气	200	5,754.00	0.00
348	301088	戎美股份	500	5,730.00	0.00
349	001360	南矿集团	300	5,307.00	0.00
350	300406	九强生物	300	3,279.00	0.00
351	301208	中亦科技	100	2,849.00	0.00
352	601766	中国中车	500	2,600.00	0.00
353	002335	科华数据	60	2,547.00	0.00
354	600167	联美控股	400	2,236.00	0.00
355	600796	钱江生化	300	1,392.00	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	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金
---	------	------	----------	-------

号				资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	1,865,477.00	1.00
2	600487	亨通光电	1,658,899.00	0.89
3	000761	本钢板材	1,527,551.00	0.82
4	300136	信维通信	1,475,688.00	0.79
5	002281	光迅科技	1,463,559.00	0.79
6	301308	江波龙	1,367,701.00	0.74
7	002399	海普瑞	1,340,490.00	0.72
8	600231	凌钢股份	1,288,870.00	0.69
9	000776	广发证券	1,219,526.00	0.66
10	600988	赤峰黄金	1,216,986.00	0.65
11	601555	东吴证券	1,201,032.00	0.65
12	300857	协创数据	1,174,931.00	0.63
13	002340	格林美	1,163,834.00	0.63
14	002273	水晶光电	1,140,482.00	0.61
15	605577	龙版传媒	1,133,935.00	0.61
16	002517	恺英网络	1,103,855.00	0.59
17	000977	浪潮信息	1,094,683.00	0.59
18	603053	成都燃气	1,091,897.00	0.59
19	000100	TCL科技	1,081,422.00	0.58
20	000517	荣安地产	1,078,301.00	0.58

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	688055	龙腾光电	1,843,343.19	0.99
2	000725	京东方A	1,470,317.00	0.79
3	000100	TCL科技	1,454,393.00	0.78

4	002340	格林美	1,410,922.00	0.76
5	002156	通富微电	1,328,427.00	0.71
6	002399	海普瑞	1,302,153.00	0.70
7	600231	凌钢股份	1,296,927.00	0.70
8	688012	中微公司	1,258,486.88	0.68
9	000761	本钢板材	1,170,701.00	0.63
10	601555	东吴证券	1,146,298.00	0.62
11	600487	亨通光电	1,128,563.00	0.61
12	600118	中国卫星	1,128,366.00	0.61
13	300136	信维通信	1,128,134.00	0.61
14	688525	佰维存储	1,110,185.24	0.60
15	002517	恺英网络	1,086,614.00	0.58
16	002273	水晶光电	1,079,318.00	0.58
17	002281	光迅科技	1,063,487.00	0.57
18	000977	浪潮信息	1,060,227.00	0.57
19	600549	厦门钨业	1,047,084.00	0.56
20	600988	赤峰黄金	1,039,047.00	0.56

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	258,678,065.80
卖出股票收入（成交）总额	247,957,049.59

注：买入股票成本、卖出股票收入均按照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	3,380,498.06	1.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	145,118,263.47	48.01

	其中：政策性金融债	20,210,986.30	6.69
4	企业债券	8,171,138.41	2.70
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	87,000,588.54	28.78
7	可转债(可交换债)	9,359,556.92	3.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	253,030,045.40	83.72

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	1928008	19农业银行二级03	100,000	10,910,198.36	3.61
2	232380076	23建行二级资本债03 A	100,000	10,599,186.30	3.51
3	232380084	23中行二级资本债04 A	100,000	10,589,443.84	3.50
4	232380089	23中信银行二级资本 债01A	100,000	10,547,640.55	3.49
5	232400028	24天津农商行二级资 本债01	100,000	10,412,955.62	3.45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未运用国债期货进行投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国工商银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和中国人民银行处罚。中国农业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。中国建设银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和中国人民银行处罚。中国银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。中信银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局、中国人民银行处罚。天津农村商业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局处罚。浙商银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和中国人民银行处罚。兴业银行在报告编制日前一年内受到国家金融监督管理总局和中国人民银行处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其他主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本报告期内，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	30,738.16
2	应收清算款	456,687.47
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,441,932.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,929,357.80

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	113697	应流转债	794,857.40	0.26
2	127064	杭氧转债	609,158.58	0.20
3	128136	立讯转债	564,008.22	0.19
4	127084	柳工转2	550,022.47	0.18
5	113051	节能转债	543,255.34	0.18
6	113046	金田转债	533,530.96	0.18
7	118059	顾中转债	528,441.92	0.17
8	110077	洪城转债	381,175.07	0.13
9	127067	恒逸转2	289,108.49	0.10
10	110099	福能转债	280,848.82	0.09
11	110098	南药转债	264,329.64	0.09
12	127110	广核转债	263,392.99	0.09
13	132026	G三峡EB2	257,533.15	0.09
14	113062	常银转债	253,606.85	0.08
15	127040	国泰转债	244,412.66	0.08
16	127089	晶澳转债	244,035.29	0.08
17	110087	天业转债	238,443.12	0.08
18	113054	绿动转债	237,174.19	0.08
19	127045	牧原转债	234,717.53	0.08
20	113052	兴业转债	230,175.29	0.08
21	127027	能化转债	222,699.73	0.07
22	110075	南航转债	219,370.68	0.07
23	113616	韦尔转债	217,844.46	0.07
24	127049	希望转2	217,190.30	0.07
25	113066	平煤转债	141,341.42	0.05
26	113067	燃23转债	122,554.41	0.04

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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 级别	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 比例	持有份额	占总份 额比例
中加 科鑫 混合A	344	281,852.50	31,572,863.76	32.56%	65,384,397.73	67.44%
中加 科鑫 混合C	1,699	113,368.36	0.00	0.00%	192,612,851.84	100.00%
合计	2,043	141,737.70	31,572,863.76	10.90%	257,997,249.57	89.10%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	78.31%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中加科鑫混合A	103,390.96	0.11%

	中加科鑫混合C	10,499.11	0.01%
	合计	113,890.07	0.04%

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	份额级别	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	中加科鑫混合A	0~10
	中加科鑫混合C	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中加科鑫混合A	-
	中加科鑫混合C	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中加科鑫混合A	中加科鑫混合C
基金合同生效日(2021年05月26日)基金份额总额	200,964,647.30	43,918,306.38
本报告期期初基金份额总额	61,793,742.31	122,726,526.68
本报告期基金总申购份额	49,976,729.33	282,595,344.89
减：本报告期基金总赎回份额	14,813,210.15	212,709,019.73
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	96,957,261.49	192,612,851.84

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

基金管理人本报告期内重大人事变动情况：无。
本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

无。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金成立日起至今聘任毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变动。

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

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	中加基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月30日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会北京监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	合规内控等
受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》、 《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》
管理人采取整改措施的情况（如 提出整改意见）	公司高度重视监管检查指出的问题，已及时通过完 善制度、优化流程和系统功能等措施完成整改。
其他	-

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，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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券(原海通)	2	506,635,115.39	100.00%	124,589.08	100.00%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1.公司选择提供交易单元的券商时，考虑以下几方面：

- （1）基本情况：公司资本充足、财务指标等符合监管要求且经营行为规范；
- （2）公司治理：公司治理完善，内部管理规范，内控制度健全；
- （3）研究服务实力：研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、个股、债券、策略等各

项领域，研究报告分析严谨，观点独立、客观；在符合相关法规及执业规范的前提下，能根据公司的特定要求提供专题研究报告；具备较强的服务意识，能主动为公司投资组合提供及时的市场信息及各种路演、公司联合调研、券商会议的信息和参加机会等；

（4）交易能力：证券交易的交易委托和成交回报的及时性和有效性。

2.券商及交易单元的选择流程如下：

（1）权益投资部根据日常券商研究服务情况提议开立（含首次开立和新增开立）或关闭相关席位，挑选时应考虑在证券交易所都租用足够多的席位以保障交易安全，并符合监管要求；

（2）总经理办公会负责审批、确定券商席位的首次开立事宜，投资决策委员会负责审批券商除首次开立以外新增及关闭席位事宜；

（3）券商名单及相应的席位租用安排确定后，权益投资部负责协调办理咨询服务协议或研究服务协议签署等相关事宜，集中交易部负责协调办理正式租用席位协议签署等相关事宜。

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
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券(原海通)	16,168,421.82	100.00%	4,200,000.00	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中加科鑫混合型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-20
2	中加科鑫混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-02-25

3	中加科鑫混合型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2026-02-27
4	中加科鑫混合型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026-02-27
5	中加科鑫混合型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要更新	中国证监会指定报刊及网站	2026-02-27
6	中加科鑫混合型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-27
7	中加科鑫混合型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-21

§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	20260112-20260113	31,572,863.76	0.00	0.00	31,572,863.76	10.90%
产品特有风险							
本基金报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，该投资者所持有的基金份额的占比较大，该投资者在赎回所持有的基金份额时，存在基金份额净值波动的风险；另外，该投资者在大额赎回其所持有的基金份额时，基金可能存在为应对赎回证券变现产生的冲击成本。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中加科鑫混合型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加科鑫混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加科鑫混合型证券投资基金托管协议》

4、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

基金管理人处

12.3 查阅方式

基金管理人办公地址：北京市西城区南纬路35号综合办公楼

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中加基金管理有限公司

客服电话：400-00-95526（免长途费）

基金管理人网址：www.bobbns.com

中加基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日