

中加聚享增盈债券型证券投资基金

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:平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
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	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
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	82
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	82
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	82
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	83
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	83
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	83
7.12 投资组合报告附注	83
§8 基金份额持有人信息	85
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	85

8.3 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	85
§9 开放式基金份额变动	86
§10 重大事件揭示	86
10.1 基金份额持有人大会决议	86
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	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
10.4 基金投资策略的改变	87
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	87
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	87
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	88
10.8 其他重大事件	89
§11 影响投资者决策的其他重要信息	89
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	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	89
§12 备查文件目录	89
12.1 备查文件目录	89
12.2 存放地点	89
12.3 查阅方式	90

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中加聚享增盈债券型证券投资基金	
基金简称	中加聚享增盈债券	
基金主代码	015371	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月05日	
基金管理人	中加基金管理有限公司	
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	340,415,124.30份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中加聚享增盈债券A	中加聚享增盈债券C
下属分级基金的交易代码	015371	015372
报告期末下属分级基金的份额总额	258,931,031.23份	81,484,093.07份

2.2 基金产品说明

投资目标	力争在严格控制投资风险的前提下，长期内实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	（一）大类资产配置策略 本基金通过及时跟踪市场环境变化，根据对国际及国内宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况等因素的深入研究，判断证券市场的发展趋势，结合行业状况、公司价值性和成长性分析，综合评价各类资产的风险收益水平。在充分的宏观形势判断和策略分析的基础上，执行“自上而下”的资产配置及动态调整策略，力求实现基金资产组合收益的最大化，有效提高不同市场状况下基金资产的整体收益水平。 其它策略还有：（二）债券投资策略；（三）同业存单投资策略；（四）资产支持证券投资策略；（五）国债期货投资策略；（六）现金管理策略；（七）股票投资策略。

业绩比较基准	中债综合全价（总值）指数收益率*90%+沪深300指数收益率*5%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益和预期风险水平高于货币市场基金，低于混合型基金与股票型基金。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘凌	潘琦
	联系电话	400-00-95526	0755-22168257
	电子邮箱	service@bobbns.com	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-00-95526	95511-3
传真		010-83197627	0755-82080387
注册地址		北京市顺义区仁和镇顺泽大街65号317室	广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
办公地址		北京市西城区南纬路35号	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		100050	518001
法定代表人		杨琳	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	《上海证券报》
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)	
	中加聚享增盈债券 A	中加聚享增盈债券 C
本期已实现收益	8,162,086.53	4,157,584.98
本期利润	7,268,690.48	4,812,231.99
加权平均基金份额本期利润	0.0279	0.0418
本期加权平均净值利润率	2.53%	3.85%
本期基金份额净值增长率	3.07%	2.87%
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	26,770,694.79	6,884,382.58
期末可供分配基金份额利润	0.1034	0.0845
期末基金资产净值	289,215,803.09	89,504,497.88
期末基金份额净值	1.1170	1.0984
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	15.91%	14.02%

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

中加聚享增盈债券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	2.83%	0.31%	0.69%	0.12%	2.14%	0.19%
过去六个月	3.07%	0.31%	0.46%	0.11%	2.61%	0.20%
过去一年	4.15%	0.25%	0.39%	0.10%	3.76%	0.15%
过去三年	9.48%	0.20%	7.18%	0.11%	2.30%	0.09%
自基金合同 生效起至今	15.91%	0.19%	8.49%	0.11%	7.42%	0.08%

中加聚享增盈债券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	2.72%	0.31%	0.69%	0.12%	2.03%	0.19%
过去六个月	2.87%	0.31%	0.46%	0.11%	2.41%	0.20%
过去一年	3.73%	0.25%	0.39%	0.10%	3.34%	0.15%
过去三年	8.20%	0.20%	7.18%	0.11%	1.02%	0.09%
自基金合同 生效起至今	14.02%	0.19%	8.49%	0.11%	5.53%	0.08%

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

中加聚享增盈债券A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年05月05日-2026年06月30日)



中加聚享增盈债券C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年05月05日-2026年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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		
钟伟	本基金基金经理	2023-07-13	-	16	钟伟先生，复旦大学数学博士。2009年7月至2016年5月，先后在广发基金管理有限公司金融工程部、数量投资部任研究员、基金经理。2013年11月7日至2015年8月任广发中债金融债指数基金的基金经理。2015年2月至2016年5月任广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。2016年5月至2020年3月，任吉富创业投资股份有限公司量化投资部总经理、基金经理。2020年3月加入中加基金管理有限公司，现任基金经理。
邹天培	本基金基金经理	2025-09-04	-	13	邹天培先生，北京大学法文学士、经济学学士，北京大学管理学硕士，香港大学金融学硕士。2012年7月至2021年7月，任职于嘉实基金管理有限公司，先后担任研究

					员、投资经理；2021年8月至2023年10月，任职于山东省国际信托股份有限公司，任投资经理、组合投资部总经理。2023年10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遵规守信情况的说明

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

固收部分：

上半年资本市场的叙事与去年下半年有了不小的变化，一是地缘事件又一轮持续冲击能源价格，二是人工智能浪潮助推下，资本开支需求高涨，市场观察到从制造业到上游周期品不少细分行业的涨价潮。从资本市场表现看，年初全球资本市场仍然热衷于流动性宽松下的风险偏好提升叙事，大宗商品与股票市场同涨，3月随着伊朗局势变化，出现了少见的全球股、债、商同涨同跌，二季度开始，美元指数强势，资本市场资金开始淡化货币降息预期，大宗品涨价逻辑被削弱，美债下跌，资金向AI相关标的集中，应该说二季度的市场风格是非常典型的景气投资，强大的财富效应带来了极强的结构性行情。

回到国内市场，股票市场资金的头部集中效应同样明显。但国内债券市场并未持续定价全球流动性转紧，信用债从年初开始表现不俗，到二季度行情向着填平利差，寻找收益高地扩展，整体行情延续性明显好于去年，背后原因可能部分在于国内银行间市场流动性的持续宽松为套利者提供了持续配置债券的底气，人民币汇率的强势应该是其中重要的流动性来源。可转债市场在权益市场极强的结构性行情下表现偏弱，只有少数股性标的收益跟随科技股取得良好收益。

组合表现方面，我们的组合在年初的收益较好，在2-3月受大类资产同步调整出现净值波动后我们对持仓结构做出调整，二季度净值得到较快修复。出于对当前宏观基本面、汇率、产业、政策等方面的理解，我们在二季度仍判断当前市场权益资产相对纯债资产收益空间更大，但在二季度我们进一步主动控制仓位并调整持仓结构，增加了对抗市场整体风险的能力。

权益部分：

今年上半年，A股市场呈现大盘震荡上行、成长赛道结构性牛市、市场极致分化的特征。年初在全球降息预期与流动性宽松的背景下，A股市场延续了去年底的上涨行情，商业航天和AI应用等题材活跃，引领“春季躁动”行情。2月底，美伊冲突爆发，中东地缘政治风险冲击，油价上涨引发全球通胀担忧，市场避险情绪浓厚，资金涌向能源与红利板块。A股受此外部利空影响，市场震荡下行。4月份中东地缘冲突局势缓和后市场回暖，CPO和存储率先启动，沪指探底回升。5月份海外存储龙头业绩超预期催化，半导体设备、光通信连续放量，AI科技产业链业绩兑现带动成长板块持续走强。6月份科技主线全面爆发，创业板、科创50指数创下阶段新高乃至历史新高，月末科技板块高潮后出现获利回吐。

本报告期，沪深300指数上涨7.55%，中证500指数上涨20.97%，中证1000上涨15.99%。本基金采用量化多因子选股模型对股票投资价值做定量分析，在此基础上构建股票投资组合，基金的持股非常分散。力求在较小的回撤幅度下获得稳健的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中加聚享增盈债券A基金份额净值为1.1170元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为3.07%，同期业绩比较基准收益率为0.46%；截至报告期末中加聚享增盈债券C基金份额净值为1.0984元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为2.87%，同期业绩比较基准收益率为0.46%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

固收部分：

对后市我们几点想法，第一从全球角度看，目前可能仍然不是流动性的拐点，事件冲击下的通胀高企终有回落之时，目前还难下进入加息周期的判断；第二，市场本身可能会有波动，但是人工智能引领的本轮投资周期确实创造了实在的投资需求，并且开始影响千行百业，对行业趋势确实要保持敬畏和关注；第三，资金抱团的背面是很多业绩优秀的公司动态估值处于低位，这是市场实现更均衡上涨的良好基础，对固收增强策略的操作有利。

展望后市，我们看好中国产业升级下的市场估值提升，权益资产仍然是当前的高胜率资产，债券票息打底+股票或可转债提供分散的收益来源有助于做好收益、风险的平衡，相比单一资产策略更容易接近绝对收益的目标。

权益部分：

在经历了上半年的科技板块的极致抱团后，下半年A股面临“外紧内松”的宏观环境，企业盈利修复与AI产业大趋势仍然会是支撑上涨上行的核心支柱。市场风格料由极致的分化走向以科技为主的更为均衡的风格。市场投资者也会更青睐能在科技浪潮中有业绩支撑的公司。

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

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：中加聚享增盈债券型证券投资基金

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	10,912,353.92	360,070.63
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	411,435,007.64	532,486,974.93
其中：股票投资		68,536,649.72	81,453,056.15
基金投资		-	-
债券投资		342,898,357.92	451,033,918.78
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		18,959,313.74	8,845.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		441,306,675.30	532,855,891.34
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		62,019,024.66	107,035,535.29
应付清算款		-	-
应付赎回款		206,696.54	2,052,898.69
应付管理人报酬		189,880.53	222,582.50
应付托管费		31,646.75	37,097.07
应付销售服务费		26,583.02	79,889.21
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17,581.03	21,128.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	94,961.80	195,385.00
负债合计		62,586,374.33	109,644,516.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	340,415,124.30	393,505,293.92
未分配利润	6.4.7.8	38,305,176.67	29,706,081.25
净资产合计		378,720,300.97	423,211,375.17
负债和净资产总计		441,306,675.30	532,855,891.34

注：报告截止日2026年06月30日，A类基金份额净值为1.1170元，A类基金份额总额258,931,031.23份；C类基金份额净值为1.0984元，C类基金份额总额81,484,093.07份，总份额合计340,415,124.30份。

6.2 利润表

会计主体：中加聚享增盈债券型证券投资基金

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		14,390,052.91	2,729,936.84
1.利息收入		45,597.22	21,778.92
其中：存款利息收入	6.4.7.9	14,916.36	5,402.73

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		30,680.86	16,376.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,564,437.01	3,904,481.28
其中：股票投资收益	6.4.7.10	9,227,624.02	-512,076.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,832,342.62	3,878,703.45
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	504,470.37	537,854.57
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	-238,749.04	-1,207,679.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,767.72	11,356.28
减：二、营业总支出		2,309,130.44	1,400,255.54
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,220,048.41	783,288.71
2.托管费	6.4.10.2.2	203,341.37	130,548.18
3.销售服务费	6.4.10.2.3	250,129.00	208,464.82
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		525,049.14	172,892.29
其中：卖出回购金融资产支出		525,049.14	172,892.29
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-

7.税金及附加		10,139.66	4,638.68
8.其他费用	6.4.7.19	100,422.86	100,422.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,080,922.47	1,329,681.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,080,922.47	1,329,681.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,080,922.47	1,329,681.30

6.3 净资产变动表

会计主体：中加聚享增盈债券型证券投资基金

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	393,505,293.92	29,706,081.25	423,211,375.17
二、本期期初净资产	393,505,293.92	29,706,081.25	423,211,375.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-53,090,169.62	8,599,095.42	-44,491,074.20
（一）、综合收益总额	-	12,080,922.47	12,080,922.47
（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）	-53,090,169.62	-3,481,827.05	-56,571,996.67

其中：1.基金申购款	313,276,076.92	30,562,897.16	343,838,974.08
2.基金赎回款	-366,366,246.54	-34,044,724.21	-400,410,970.75
（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	340,415,124.30	38,305,176.67	378,720,300.97
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	372,643,630.74	21,628,527.02	394,272,157.76
二、本期期初净资产	372,643,630.74	21,628,527.02	394,272,157.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-181,012,574.95	-8,484,080.99	-189,496,655.94
（一）、综合收益总额	-	1,329,681.30	1,329,681.30
（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）	-181,012,574.95	-9,813,762.29	-190,826,337.24
其中：1.基金申购款	78,218,800.64	4,414,611.08	82,633,411.72
2.基金赎回款	-259,231,375.59	-14,228,373.37	-273,459,748.96
（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	191,631,055.79	13,144,446.03	204,775,501.82

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

中加聚享增盈债券型证券投资基金(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2022年2月23日证监许可[2022]390号《关于准予中加聚享增盈债券型证券投资基金注册的批复》核准,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《中加聚享增盈债券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债券型证券投资基金,存续期限为不定期。本基金的管理人为中加基金,托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

本基金通过中加基金直销中心、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、江苏汇林保大基金销售有限公司、腾安基金销售(深圳)有限公司及平安银行等其他销售机构公开发售,募集期为2022年4月15日起至2022年4月28日。本基金于2022年5月5日成立,成立之日基金实收份额为242,256,734.38份(含利息转份额5,076.94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《中加聚享增盈债券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《中加聚享增盈债券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(含主板、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)、

内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许投资的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、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(含分离交易可转债)、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、国债期货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》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信(2021)20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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。

对证券投资基金从中国内地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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

(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。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	1,991,763.29
等于：本金	1,991,166.30
加：应计利息	596.99
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	8,920,590.63
等于：本金	8,920,504.00
加：应计利息	86.63
合计	10,912,353.92

注：其他存款为本基金存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		67,748,645.63	-	68,536,649.72	788,004.09
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	40,046,043.85	312,578.82	39,908,896.37	-449,726.30
	银行间市场	299,450,164.61	4,045,661.55	302,989,461.55	-506,364.61
	合计	339,496,208.46	4,358,240.37	342,898,357.92	-956,090.91
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		407,244,854.09	4,358,240.37	411,435,007.64	-168,086.82

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,286.00
其中：交易所市场	-
银行间市场	3,286.00
应付利息	-
预提费用-审计费	22,315.49
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-账户维护费	9,000.00
其他应付	852.94
合计	94,961.80

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中加聚享增盈债券A

金额单位：人民币元

项目 (中加聚享增盈债券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	190,631,581.98	190,631,581.98
本期申购	199,400,695.53	199,400,695.53
本期赎回（以“-”号填列）	-131,101,246.28	-131,101,246.28
本期末	258,931,031.23	258,931,031.23

6.4.7.7.2 中加聚享增盈债券C

金额单位：人民币元

项目 (中加聚享增盈债券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	202,873,711.94	202,873,711.94
本期申购	113,875,381.39	113,875,381.39
本期赎回（以“-”号填列）	-235,265,000.26	-235,265,000.26
本期末	81,484,093.07	81,484,093.07

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 中加聚享增盈债券A

单位：人民币元

项目 (中加聚享增盈债券A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,001,813.92	2,948,349.14	15,950,163.06
本期期初	13,001,813.92	2,948,349.14	15,950,163.06
本期利润	8,162,086.53	-893,396.05	7,268,690.48
本期基金份额交易产生的变动数	5,606,794.34	1,459,123.98	7,065,918.32
其中：基金申购款	17,525,429.81	2,776,103.35	20,301,533.16
基金赎回款	-11,918,635.47	-1,316,979.37	-13,235,614.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,770,694.79	3,514,077.07	30,284,771.86

6.4.7.8.2 中加聚享增盈债券C

单位：人民币元

项目 (中加聚享增盈债券C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,548,587.74	3,207,330.45	13,755,918.19
本期期初	10,548,587.74	3,207,330.45	13,755,918.19
本期利润	4,157,584.98	654,647.01	4,812,231.99
本期基金份额交易产生的变动数	-7,821,790.14	-2,725,955.23	-10,547,745.37
其中：基金申购款	8,539,212.18	1,722,151.82	10,261,364.00
基金赎回款	-16,361,002.32	-4,448,107.05	-20,809,109.37

本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,884,382.58	1,136,022.23	8,020,404.81

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	13,036.89
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,685.02
结算备付金利息收入	-
其他	194.45
合计	14,916.36

注：其他存款利息收入为券商保证金利息收入。

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	483,953,495.85
减：卖出股票成本总额	474,006,035.20
减：交易费用	719,836.63
买卖股票差价收入	9,227,624.02

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	4,848,644.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-16,301.98

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	4,832,342.62

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	142,650,220.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	140,637,729.56
减：应计利息总额	2,027,231.46
减：交易费用	1,561.49
买卖债券差价收入	-16,301.98

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	504,470.37
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	504,470.37

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	-238,749.04
——股票投资	-525,890.61
——债券投资	287,141.57
——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	-238,749.04

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	17,331.21
转换费收入	1,436.51
合计	18,767.72

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	22,315.49
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
上交所账户维护费	9,600.00
中债登账户维护费	9,000.00
合计	100,422.86

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
平安银行股份有限公司	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
北银丰业资产管理有限公司	基金管理人控股的子公司

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20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,220,048.41	783,288.71

其中：应支付销售机构的客户维护费	286,740.56	167,515.65
应支付基金管理人的净管理费	933,307.85	615,773.06

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0.60%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×0.60%/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费	203,341.37	130,548.18

注：支付基金托管人平安银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/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		
	中加聚享增盈债券A	中加聚享增盈债券C	合计
北京银行 股份有限 公司	-	206,362.36	206,362.36
平安银行 股份有限 公司	-	1.58	1.58
合计	-	206,363.94	206,363.94
获得销售 服务费的	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中加聚享增盈债券A	中加聚享增盈债券C	合计
北京银行股份有限公司	-	201,637.46	201,637.46
平安银行股份有限公司	-	2,251.65	2,251.65
合计	-	203,889.11	203,889.11

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

单位：人民币元

本期 2026年01月01日至2026年06月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
平安银行股份有限公司	-	20,128,360.00	-	-	-	-

本基金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

中加聚享增盈债券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	42,471,920.72	42,471,920.72
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	42,471,920.72	42,471,920.72
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	16.40%	31.03%

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

中加聚享增盈债券A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
北银丰业资产管理 有限公司	4,626,990.00	1.79%	4,626,990.00	2.43%

报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金C类份额。

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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	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
平安银行股份有限公司	1,991,763.29	13,036.89	941,355.46	3,977.39

注：本基金的活期存款由基金托管人平安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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
110101	宝钛转债	2026-06-24	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	60	6,000.00	6,000.09	-
127114	宜化转债	2026-06-26	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	24	2,400.00	2,400.05	-

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62,019,024.66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
102281460	22华发实业MTN001A	2026-07-01	102.80	100,000	10,280,093.15
102381113	23华发实业MTN002(并购)	2026-07-01	100.92	100,000	10,091,589.04
102481580	24电建地产MTN001	2026-07-01	101.90	100,000	10,189,604.93
102583887	25电建地产MTN002	2026-07-01	102.67	100,000	10,266,858.08
102584026	25海尔金盈MTN005	2026-07-01	102.18	200,000	20,436,991.78
232480011	24农行二级资本债02A	2026-07-01	102.29	86,000	8,796,999.37
合计				686,000	70,062,136.35

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	19,827,693.78	54,321,139.17
合计	19,827,693.78	54,321,139.17

- 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	164,141,789.21	180,185,312.67
AAA以下	15,164,796.93	20,416,400.00
未评级	143,764,078.00	196,111,066.94
合计	323,070,664.14	396,712,779.61

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	10,912,353.92	-	-	-	10,912,353.92

交易性金融资产	120,765,360.36	200,476,092.05	21,656,905.51	68,536,649.72	411,435,007.64
应收申购款	-	-	-	18,959,313.74	18,959,313.74
资产总计	131,677,714.28	200,476,092.05	21,656,905.51	87,495,963.46	441,306,675.30
负债					
卖出回购金融资产款	62,019,024.66	-	-	-	62,019,024.66
应付赎回款	-	-	-	206,696.54	206,696.54
应付管理人报酬	-	-	-	189,880.53	189,880.53
应付托管费	-	-	-	31,646.75	31,646.75
应付销售服务费	-	-	-	26,583.02	26,583.02
应交税费	-	-	-	17,581.03	17,581.03
其他负债	-	-	-	94,961.80	94,961.80
负债总计	62,019,024.66	-	-	567,349.67	62,586,374.33
利率敏感度缺口	69,658,689.62	200,476,092.05	21,656,905.51	86,928,613.79	378,720,300.97
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	360,070.63	-	-	-	360,070.63

金					
交易性金融资产	160,795,257.90	268,903,306.11	21,335,354.77	81,453,056.15	532,486,974.93
应收申购款	-	-	-	8,845.78	8,845.78
资产总计	161,155,328.53	268,903,306.11	21,335,354.77	81,461,901.93	532,855,891.34
负债					
卖出回购金融资产款	107,035,535.29	-	-	-	107,035,535.29
应付赎回款	-	-	-	2,052,898.69	2,052,898.69
应付管理人报酬	-	-	-	222,582.50	222,582.50
应付托管费	-	-	-	37,097.07	37,097.07
应付销售服务费	-	-	-	79,889.21	79,889.21
应交税费	-	-	-	21,128.41	21,128.41
其他负债	-	-	-	195,385.00	195,385.00
负债总计	107,035,535.29	-	-	2,608,980.88	109,644,516.17
利率敏感度缺口	54,119,793.24	268,903,306.11	21,335,354.77	78,852,921.05	423,211,375.17

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	1,734,174.40	2,168,581.53
	市场利率上升25个基点	-1,734,174.40	-2,168,581.53

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	68,536,649.72	18.10	81,453,056.15	19.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	342,898,357.92	90.54	451,033,918.78	106.57

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	411,435,007.64	108.64	532,486,974.93	125.82

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%	19,969,386.60	18,948,667.63
	业绩比较基准下降5%	-19,969,386.60	-18,948,667.63

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	78,348,724.50	98,515,427.99

第二层次	333,086,283.14	433,971,546.94
第三层次	-	-
合计	411,435,007.64	532,486,974.93

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	68,536,649.72	15.53
	其中：股票	68,536,649.72	15.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	342,898,357.92	77.70
	其中：债券	342,898,357.92	77.70
	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	10,912,353.92	2.47
8	其他各项资产	18,959,313.74	4.30
9	合计	441,306,675.30	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	436,992.80	0.12
B	采矿业	1,373,485.40	0.36
C	制造业	50,547,646.74	13.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,572,687.00	0.42
E	建筑业	904,628.00	0.24
F	批发和零售业	2,210,016.80	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	843,297.68	0.22
H	住宿和餐饮业	56,427.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,389,590.20	1.42
J	金融业	2,406,327.50	0.64
K	房地产业	567,069.00	0.15
L	租赁和商务服务业	901,626.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	498,410.20	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	623,574.40	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,569.00	0.00
Q	卫生和社会工作	10,829.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	175,207.00	0.05

S	综合	11,266.00	0.00
	合计	68,536,649.72	18.10

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	300857	协创数据	5,720	1,944,228.00	0.51
2	001309	德明利	1,400	1,320,060.00	0.35
3	600320	振华重工	298,200	1,231,566.00	0.33
4	002396	星网锐捷	44,170	846,738.90	0.22
5	002947	恒铭达	11,000	836,550.00	0.22
6	300613	富瀚微	10,300	824,824.00	0.22
7	688469	芯联集成-U	74,400	789,384.00	0.21
8	600150	中国船舶	23,000	777,170.00	0.21
9	301308	江波龙	1,100	774,180.00	0.20
10	300323	华灿光电	37,800	771,120.00	0.20
11	002922	伊戈尔	23,100	757,680.00	0.20
12	603876	鼎胜新材	28,000	728,280.00	0.19
13	688525	佰维存储	1,400	692,622.00	0.18
14	601899	紫金矿业	26,600	668,724.00	0.18
15	301489	思泉新材	4,000	658,320.00	0.17
16	600739	辽宁成大	64,600	653,106.00	0.17
17	600577	精达股份	62,800	614,184.00	0.16
18	300458	全志科技	15,380	606,894.80	0.16
19	600037	歌华有线	94,600	593,142.00	0.16
20	688158	优刻得-W	16,000	588,160.00	0.16

21	603588	高能环境	28,200	541,440.00	0.14
22	601677	明泰铝业	32,300	536,180.00	0.14
23	300073	当升科技	10,800	518,832.00	0.14
24	601360	三六零	58,900	511,841.00	0.14
25	002250	联化科技	37,300	509,891.00	0.13
26	300308	中际旭创	400	508,000.00	0.13
27	300034	钢研高纳	29,300	502,202.00	0.13
28	601038	一拖股份	46,400	491,376.00	0.13
29	603986	兆易创新	600	489,000.00	0.13
30	601126	四方股份	7,700	486,640.00	0.13
31	600116	三峡水利	86,700	485,520.00	0.13
32	688503	聚和材料	3,400	451,180.00	0.12
33	688728	格科微	21,400	450,256.00	0.12
34	600183	生益科技	2,500	433,500.00	0.11
35	600487	亨通光电	3,900	426,426.00	0.11
36	601108	财通证券	48,700	421,255.00	0.11
37	000338	潍柴动力	15,400	419,650.00	0.11
38	603680	今创集团	41,500	407,115.00	0.11
39	000938	紫光股份	13,800	398,268.00	0.11
40	002414	高德红外	29,700	393,822.00	0.10
41	688498	源杰科技	200	377,200.00	0.10
42	600961	株冶集团	11,600	375,724.00	0.10
43	002497	雅化集团	17,900	364,623.00	0.10
44	600482	中国动力	11,000	360,800.00	0.10
45	603186	华正新材	1,600	360,480.00	0.10
46	002061	浙江交科	108,600	358,380.00	0.09
47	603118	共进股份	29,500	357,245.00	0.09
48	600884	杉杉股份	25,700	348,235.00	0.09
49	688213	思特威-W	3,200	342,624.00	0.09
50	002458	益生股份	44,020	342,035.40	0.09
51	601766	中国中车	65,100	338,520.00	0.09

52	002738	中矿资源	5,600	330,344.00	0.09
53	603950	长源东谷	3,900	329,277.00	0.09
54	300672	国科微	1,100	324,500.00	0.09
55	300953	震裕科技	2,340	312,858.00	0.08
56	688127	蓝特光学	3,200	312,320.00	0.08
57	002063	远光软件	61,012	311,161.20	0.08
58	002838	道恩股份	10,000	306,200.00	0.08
59	002405	四维图新	46,900	303,443.00	0.08
60	000166	申万宏源	67,500	297,000.00	0.08
61	300098	高新兴	63,300	290,547.00	0.08
62	002384	东山精密	1,100	288,585.00	0.08
63	600335	国机汽车	60,900	285,012.00	0.08
64	603083	剑桥科技	1,100	280,357.00	0.07
65	300358	楚天科技	34,900	279,200.00	0.07
66	600305	恒顺醋业	43,900	277,009.00	0.07
67	600098	广州发展	46,600	275,406.00	0.07
68	002185	华天科技	11,700	261,027.00	0.07
69	000933	神火股份	12,300	260,760.00	0.07
70	601138	工业富联	3,600	259,740.00	0.07
71	603323	苏农银行	66,670	258,012.90	0.07
72	301536	星宸科技	2,000	257,420.00	0.07
73	002602	世纪华通	18,100	255,210.00	0.07
74	002768	国恩股份	4,604	239,684.24	0.06
75	600572	康恩贝	60,700	237,944.00	0.06
76	002747	埃斯顿	6,100	227,713.00	0.06
77	605056	咸亨国际	14,200	227,200.00	0.06
78	002966	苏州银行	32,400	225,504.00	0.06
79	002493	荣盛石化	20,800	223,600.00	0.06
80	688372	伟测科技	1,200	223,200.00	0.06
81	600875	东方电气	7,600	218,652.00	0.06
82	301031	中熔电气	1,822	217,637.90	0.06

83	688400	凌云光	3,200	211,840.00	0.06
84	600361	创新新材	58,800	211,680.00	0.06
85	688275	万润新能	1,600	204,080.00	0.05
86	601059	信达证券	12,600	203,994.00	0.05
87	603025	大豪科技	14,700	200,508.00	0.05
88	300590	移为通信	13,900	199,465.00	0.05
89	601231	环旭电子	6,100	197,640.00	0.05
90	000703	恒逸石化	14,500	196,765.00	0.05
91	000415	渤海租赁	46,200	188,034.00	0.05
92	000553	安道麦A	34,900	186,715.00	0.05
93	000792	盐湖股份	6,100	184,159.00	0.05
94	603112	华翔股份	11,000	184,030.00	0.05
95	002475	立讯精密	2,500	176,000.00	0.05
96	601333	广深铁路	63,800	175,450.00	0.05
97	688220	翱捷科技-U	1,400	174,048.00	0.05
98	000636	风华高科	2,400	173,376.00	0.05
99	600808	马钢股份	69,100	172,750.00	0.05
100	600535	天士力	13,000	171,990.00	0.05
101	002010	传化智联	38,400	171,648.00	0.05
102	688111	金山办公	800	170,440.00	0.05
103	603160	汇顶科技	2,700	166,617.00	0.04
104	600570	恒生电子	7,800	165,282.00	0.04
105	601139	深圳燃气	29,200	165,272.00	0.04
106	605123	派克新材	1,700	164,917.00	0.04
107	603663	三祥新材	1,700	163,710.00	0.04
108	300298	三诺生物	11,600	161,820.00	0.04
109	301662	宏工科技	1,595	161,605.40	0.04
110	600395	盘江股份	35,000	159,600.00	0.04
111	300171	东富龙	14,300	158,158.00	0.04
112	301382	蜂助手	3,400	156,400.00	0.04
113	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.04

114	600372	中航机载	14,100	152,985.00	0.04
115	600801	华新建材	9,800	152,880.00	0.04
116	688390	固德威	1,400	151,914.00	0.04
117	301268	铭利达	10,800	150,984.00	0.04
118	603061	金海通	300	150,666.00	0.04
119	301217	铜冠铜箔	900	148,563.00	0.04
120	601880	辽港股份	107,300	148,074.00	0.04
121	300395	菲利华	1,100	147,103.00	0.04
122	002169	智光电气	10,000	146,400.00	0.04
123	603225	新凤鸣	7,300	143,445.00	0.04
124	605020	永和股份	3,500	142,520.00	0.04
125	300184	力源信息	8,100	142,155.00	0.04
125	000967	盈峰环境	13,500	142,155.00	0.04
126	000600	建投能源	16,200	141,750.00	0.04
127	688167	炬光科技	400	141,684.00	0.04
128	600109	国金证券	16,000	140,480.00	0.04
129	688567	孚能科技	13,200	138,600.00	0.04
130	600654	中安科	52,100	138,586.00	0.04
131	600155	华创云信	25,000	138,000.00	0.04
132	688002	睿创微纳	891	137,828.79	0.04
133	600072	中船科技	16,100	136,689.00	0.04
134	300604	长川科技	400	136,568.00	0.04
135	601600	中国铝业	16,500	135,630.00	0.04
136	000977	浪潮信息	1,900	133,000.00	0.04
137	603308	应流股份	2,200	132,880.00	0.04
138	688717	艾罗能源	1,600	132,112.00	0.03
139	600489	中金黄金	7,300	131,765.00	0.03
140	002859	洁美科技	1,200	131,412.00	0.03
141	688049	炬芯科技	2,800	131,348.00	0.03
142	603124	江南新材	700	130,886.00	0.03
143	600869	远东股份	3,900	130,533.00	0.03

144	688331	荣昌生物	1,000	130,260.00	0.03
145	603305	旭升集团	10,700	129,684.00	0.03
146	000672	上峰材料	5,300	125,504.00	0.03
147	600331	宏达股份	11,400	125,286.00	0.03
148	603236	移远通信	2,420	123,831.40	0.03
149	600641	先导基电	3,100	123,566.00	0.03
150	688110	东芯股份	600	122,220.00	0.03
151	000810	创维数字	9,200	121,900.00	0.03
152	603063	禾望电气	2,300	121,647.00	0.03
153	002668	TCL智家	10,900	120,772.00	0.03
154	601699	潞安环能	8,400	119,952.00	0.03
155	601117	中国化学	16,300	119,805.00	0.03
156	000682	东方电子	9,400	118,722.00	0.03
157	001914	招商积余	14,500	118,320.00	0.03
158	600509	天富能源	13,800	116,610.00	0.03
159	600268	国电南自	10,000	116,200.00	0.03
160	301606	绿联科技	1,900	115,938.00	0.03
161	002558	巨人网络	4,200	115,752.00	0.03
162	002049	紫光国微	1,300	115,375.00	0.03
163	000623	吉林敖东	6,500	115,245.00	0.03
164	688388	嘉元科技	2,610	114,840.00	0.03
165	002060	广东建工	37,900	114,837.00	0.03
166	300769	德方纳米	1,700	113,050.00	0.03
167	300274	阳光电源	700	111,314.00	0.03
168	002222	福晶科技	1,200	110,736.00	0.03
169	603699	纽威股份	2,200	110,660.00	0.03
170	600741	华域汽车	7,100	110,192.00	0.03
171	300428	立中集团	6,000	109,080.00	0.03
172	002531	天顺风能	12,800	107,904.00	0.03
173	600210	紫江企业	17,400	107,880.00	0.03
174	301246	宏源药业	4,000	107,600.00	0.03

175	003022	联泓新科	4,100	106,190.00	0.03
176	000539	粤电力A	15,300	104,193.00	0.03
177	600397	江钨装备	3,800	103,474.00	0.03
178	002281	光迅科技	400	102,776.00	0.03
179	600989	宝丰能源	5,000	101,650.00	0.03
180	000729	燕京啤酒	10,000	101,300.00	0.03
181	603108	润达医疗	11,200	99,680.00	0.03
182	600927	永安期货	8,000	99,600.00	0.03
183	002048	宁波华翔	4,300	98,900.00	0.03
184	002436	兴森科技	1,900	96,805.00	0.03
185	000657	中钨高新	1,000	95,720.00	0.03
186	300132	青松股份	16,200	92,016.00	0.02
187	300773	拉卡拉	5,980	91,494.00	0.02
188	301358	湖南裕能	1,200	91,044.00	0.02
189	002008	大族激光	600	90,066.00	0.02
190	605300	佳禾食品	9,200	89,700.00	0.02
191	600575	淮河能源	28,000	89,320.00	0.02
192	600645	中源协和	5,200	88,972.00	0.02
193	600663	陆家嘴	14,100	88,548.00	0.02
194	002004	华邦健康	22,500	88,425.00	0.02
195	002134	天津普林	2,900	88,218.00	0.02
196	600929	雪天盐业	19,400	88,076.00	0.02
197	000951	中国重汽	4,500	87,795.00	0.02
198	002648	卫星化学	3,700	86,913.00	0.02
199	600282	南钢股份	18,700	85,833.00	0.02
200	002415	海康威视	2,500	85,500.00	0.02
201	300432	富临精工	4,200	84,378.00	0.02
202	600026	中远海能	4,700	84,318.00	0.02
203	600662	外服控股	20,700	83,421.00	0.02
204	600872	中炬高新	4,700	81,592.00	0.02
205	002382	蓝帆医疗	15,800	80,264.00	0.02

206	688059	华锐精密	400	79,884.00	0.02
207	002115	三维通信	7,700	79,310.00	0.02
208	600019	宝钢股份	14,500	78,735.00	0.02
209	603966	法兰泰克	9,660	78,729.00	0.02
210	000950	重药控股	15,700	78,657.00	0.02
211	600717	天津港	20,100	78,189.00	0.02
212	002979	雷赛智能	1,400	78,092.00	0.02
213	301060	兰卫医学	9,400	76,798.00	0.02
214	688519	南亚新材	200	76,008.00	0.02
215	600266	城建发展	19,300	75,463.00	0.02
216	300142	沃森生物	5,800	75,342.00	0.02
217	300077	国民技术	2,400	75,240.00	0.02
218	600623	华谊集团	9,300	75,051.00	0.02
219	600552	凯盛科技	2,300	74,934.00	0.02
220	688321	微芯生物	2,800	73,724.00	0.02
221	600452	涪陵电力	7,900	73,707.00	0.02
222	002120	韵达股份	11,400	72,504.00	0.02
223	600887	伊利股份	3,000	71,880.00	0.02
224	300699	光威复材	2,500	71,625.00	0.02
225	688779	五矿新能	8,800	71,368.00	0.02
225	002545	东方铁塔	4,400	71,368.00	0.02
226	300012	华测检测	5,100	70,686.00	0.02
227	688001	华兴源创	821	70,359.70	0.02
228	002563	森马服饰	13,900	70,056.00	0.02
229	002487	大金重工	1,200	69,564.00	0.02
230	000708	中信特钢	5,500	69,410.00	0.02
231	300970	华绿生物	3,780	69,098.40	0.02
232	600352	浙江龙盛	5,700	69,027.00	0.02
233	601377	兴业证券	11,400	68,856.00	0.02
234	000028	国药一致	3,630	68,643.30	0.02
235	601949	中国出版	14,600	67,890.00	0.02

236	000800	一汽解放	11,400	67,830.00	0.02
237	600369	西南证券	16,800	67,536.00	0.02
238	000156	华数传媒	10,700	67,517.00	0.02
239	600216	浙江医药	5,900	67,260.00	0.02
240	688221	前沿生物-U	3,000	67,200.00	0.02
241	688559	海目星	800	67,136.00	0.02
242	600185	珠免集团	14,900	67,050.00	0.02
243	601128	常熟银行	11,520	67,046.40	0.02
244	600328	中盐化工	11,100	66,600.00	0.02
245	600460	士兰微	1,200	65,592.00	0.02
246	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.02
247	002624	完美世界	5,200	64,584.00	0.02
248	002993	奥海科技	900	64,449.00	0.02
249	600686	金龙汽车	5,700	64,353.00	0.02
250	603345	安井食品	800	64,152.00	0.02
251	600710	苏美达	6,700	64,052.00	0.02
252	301219	腾远钴业	1,160	63,568.00	0.02
253	300134	大富科技	7,400	63,270.00	0.02
254	002488	金固股份	7,100	63,261.00	0.02
255	601179	中国西电	4,200	62,664.00	0.02
256	300206	理邦仪器	5,100	62,373.00	0.02
257	603259	药明康德	500	62,255.00	0.02
258	600426	华鲁恒升	2,600	62,192.00	0.02
259	002709	天赐材料	1,200	61,716.00	0.02
260	688257	新锐股份	600	61,140.00	0.02
260	300573	兴齐眼药	1,500	61,140.00	0.02
261	600141	兴发集团	1,300	61,061.00	0.02
262	000778	新兴铸管	16,400	60,844.00	0.02
263	600196	复星医药	2,700	60,669.00	0.02
264	001322	箭牌家居	10,000	60,400.00	0.02
265	601068	中铝国际	13,900	60,048.00	0.02

266	300475	香农芯创	200	60,000.00	0.02
267	603969	银龙股份	8,200	59,614.00	0.02
268	000725	京东方A	6,800	59,024.00	0.02
269	002245	蔚蓝锂芯	3,124	58,450.04	0.02
270	002011	盾安环境	5,500	58,355.00	0.02
271	302132	中航成飞	1,000	58,320.00	0.02
272	600997	开滦股份	12,200	57,950.00	0.02
273	603583	捷昌驱动	2,500	57,000.00	0.02
274	002745	木林森	4,500	56,475.00	0.01
275	002641	公元股份	14,000	54,040.00	0.01
276	002897	意华股份	600	52,788.00	0.01
277	000983	山西焦煤	9,100	52,780.00	0.01
278	601890	亚星锚链	6,400	52,288.00	0.01
279	600233	圆通速递	3,300	51,975.00	0.01
280	601019	山东出版	8,000	51,200.00	0.01
280	300602	飞荣达	1,000	51,200.00	0.01
281	688235	百济神州	200	50,922.00	0.01
282	600230	沧州大化	3,900	50,778.00	0.01
283	601878	浙商证券	5,300	50,350.00	0.01
284	300296	利亚德	8,800	49,280.00	0.01
285	600114	东睦股份	1,300	49,088.00	0.01
286	688653	康希通信	2,800	48,664.00	0.01
287	600685	中船防务	1,900	48,336.00	0.01
288	002428	云南锗业	400	48,072.00	0.01
289	002636	金安国纪	400	47,988.00	0.01
290	000589	贵州轮胎	11,800	47,908.00	0.01
291	002511	中顺洁柔	7,200	47,880.00	0.01
292	301201	诚达药业	1,300	47,268.00	0.01
293	601577	长沙银行	5,400	47,034.00	0.01
294	603218	日月股份	4,600	47,012.00	0.01
295	301526	国际复材	1,000	46,670.00	0.01

296	002444	巨星科技	1,500	46,650.00	0.01
297	002410	广联达	5,700	46,512.00	0.01
298	000059	华锦股份	12,400	46,500.00	0.01
299	000783	长江证券	4,700	45,825.00	0.01
300	002916	深南电路	100	45,790.00	0.01
301	603915	国茂股份	3,200	45,408.00	0.01
302	002378	章源钨业	1,300	43,524.00	0.01
303	300776	帝尔激光	200	42,992.00	0.01
304	601991	大唐发电	6,000	42,480.00	0.01
305	300054	鼎龙股份	400	42,388.00	0.01
306	603456	九洲药业	3,100	42,346.00	0.01
307	002092	中泰化学	11,000	42,130.00	0.01
308	603127	昭衍新药	1,100	42,042.00	0.01
309	688612	威迈斯	1,400	41,426.00	0.01
310	603979	金诚信	700	41,321.00	0.01
311	301290	东星医疗	1,500	40,875.00	0.01
312	300909	汇创达	700	40,754.00	0.01
313	603486	科沃斯	800	40,600.00	0.01
314	600105	永鼎股份	600	40,488.00	0.01
315	603516	淳中科技	300	40,383.00	0.01
316	688208	道通科技	1,600	40,304.00	0.01
317	600827	百联股份	5,400	40,014.00	0.01
318	603239	浙江仙通	2,700	39,987.00	0.01
319	002967	广电计量	2,200	39,710.00	0.01
320	301215	中汽股份	7,600	39,444.00	0.01
321	600704	物产中大	8,300	39,176.00	0.01
322	002534	西子洁能	2,100	38,955.00	0.01
323	601665	齐鲁银行	6,700	38,659.00	0.01
324	603920	世运电路	800	38,432.00	0.01
325	603009	北特科技	800	38,376.00	0.01
326	688173	希荻微	2,000	38,280.00	0.01

327	000680	山推股份	3,800	38,190.00	0.01
328	688097	博众精工	600	37,830.00	0.01
329	600675	中华企业	18,000	37,080.00	0.01
330	002925	盈趣科技	1,500	36,990.00	0.01
331	300563	神宇股份	1,300	36,907.00	0.01
332	301116	益客食品	4,300	36,808.00	0.01
333	000709	河钢股份	18,900	36,666.00	0.01
334	300682	朗新科技	3,700	36,630.00	0.01
335	301238	瑞泰新材	1,500	36,600.00	0.01
336	002056	横店东磁	1,200	36,576.00	0.01
337	600176	中国巨石	500	36,440.00	0.01
338	603336	宏辉果蔬	4,600	36,432.00	0.01
339	600601	方正科技	2,600	35,984.00	0.01
340	002373	千方科技	5,000	35,900.00	0.01
341	002412	汉森制药	6,500	35,750.00	0.01
342	300331	苏大维格	500	35,555.00	0.01
343	601818	光大银行	12,300	35,547.00	0.01
344	601828	美凯龙	17,300	35,292.00	0.01
345	002798	帝欧水华	7,000	34,930.00	0.01
346	688301	奕瑞科技	280	34,720.00	0.01
347	600941	中国移动	400	34,452.00	0.01
348	300058	蓝色光标	2,500	34,400.00	0.01
349	603196	璞源材料	1,400	34,216.00	0.01
350	002399	海普瑞	3,800	34,124.00	0.01
351	603179	新泉股份	680	33,762.00	0.01
352	600490	鹏欣资源	5,800	33,756.00	0.01
353	600966	博汇纸业	7,000	33,460.00	0.01
354	000831	中国稀土	600	33,294.00	0.01
355	600038	中直股份	1,300	32,877.00	0.01
356	000899	赣能股份	3,400	32,844.00	0.01
357	600916	中国黄金	4,800	32,832.00	0.01

358	002921	联诚精密	1,200	32,808.00	0.01
359	600546	山煤国际	3,000	32,790.00	0.01
360	603014	威高血净	1,000	32,730.00	0.01
361	603328	依顿电子	2,600	32,578.00	0.01
362	603279	景津装备	2,700	32,400.00	0.01
363	688045	必易微	400	32,312.00	0.01
364	601061	中信金属	3,000	32,310.00	0.01
365	002429	兆驰股份	3,100	32,209.00	0.01
366	600332	白云山	1,600	32,064.00	0.01
367	002110	三钢闽光	11,100	31,968.00	0.01
368	603818	曲美家居	10,700	31,779.00	0.01
369	300756	金马游乐	960	31,728.00	0.01
370	002284	亚太股份	3,300	31,317.00	0.01
371	300489	光智科技	100	31,195.00	0.01
372	603719	良品铺子	3,600	31,140.00	0.01
373	600885	宏发股份	900	31,041.00	0.01
374	600198	大唐电信	3,200	30,880.00	0.01
375	688336	三生国健	580	30,798.00	0.01
376	002354	天娱数科	3,300	30,690.00	0.01
377	600754	锦江酒店	1,700	30,583.00	0.01
378	001236	弘业期货	4,400	30,580.00	0.01
379	003018	金富科技	400	30,492.00	0.01
380	301090	华润材料	4,800	30,096.00	0.01
381	300382	斯莱克	1,300	30,043.00	0.01
382	600126	杭钢股份	4,900	30,037.00	0.01
383	603317	天味食品	2,300	29,923.00	0.01
384	600787	中储股份	7,100	29,678.00	0.01
385	002434	万里扬	4,900	29,645.00	0.01
386	300201	海伦哲	1,400	29,498.00	0.01
387	603615	茶花股份	1,800	29,070.00	0.01
388	002283	天润工业	3,000	28,950.00	0.01

389	002244	滨江集团	3,800	28,880.00	0.01
390	600682	南京新百	5,600	28,840.00	0.01
391	000807	云铝股份	1,300	28,782.00	0.01
392	601958	金钼股份	1,000	28,110.00	0.01
393	600153	建发股份	3,500	27,755.00	0.01
394	601858	中国科传	1,600	27,696.00	0.01
395	002456	欧菲光	2,900	27,434.00	0.01
396	000962	东方钽业	300	27,180.00	0.01
397	600129	太极集团	2,000	27,140.00	0.01
398	605376	博迁新材	100	27,130.00	0.01
399	301161	唯万密封	700	27,027.00	0.01
400	002721	金一文化	12,000	26,640.00	0.01
401	001339	智微智能	260	26,592.80	0.01
402	002043	兔宝宝	2,400	26,592.00	0.01
403	603071	物产环能	2,400	26,544.00	0.01
404	601865	福莱特	2,500	26,275.00	0.01
405	600499	科达制造	1,900	26,220.00	0.01
406	600100	同方股份	3,700	25,345.00	0.01
407	600502	安徽建工	5,700	24,795.00	0.01
408	002085	万丰奥威	2,200	24,398.00	0.01
409	300693	盛弘股份	500	24,375.00	0.01
410	601339	百隆东方	3,600	24,372.00	0.01
411	002034	旺能环境	1,600	24,240.00	0.01
412	600639	浦东金桥	2,600	23,712.00	0.01
413	688266	泽璟制药-U	200	23,332.00	0.01
414	600740	山西焦化	7,300	23,287.00	0.01
415	002402	和而泰	900	23,247.00	0.01
416	000877	天山股份	6,400	23,232.00	0.01
417	600143	金发科技	1,500	23,175.00	0.01
418	600521	华海药业	1,600	23,040.00	0.01
419	002831	裕同科技	643	22,865.08	0.01

420	002603	以岭药业	1,500	22,500.00	0.01
421	601717	中创智领	1,600	22,256.00	0.01
422	688218	江苏北人	400	21,984.00	0.01
423	002096	易普力	2,500	21,950.00	0.01
424	600456	宝钛股份	800	21,880.00	0.01
425	002364	中恒电气	400	21,520.00	0.01
426	002518	科士达	400	21,436.00	0.01
427	688063	派能科技	400	21,308.00	0.01
428	002701	奥瑞金	5,000	21,300.00	0.01
429	000519	中兵红箭	1,000	21,070.00	0.01
430	000935	四川双马	800	20,872.00	0.01
431	688548	广钢气体	400	20,840.00	0.01
432	002472	双环传动	500	20,755.00	0.01
433	000012	南玻A	4,000	20,640.00	0.01
434	002171	楚江新材	1,500	20,355.00	0.01
435	000498	山东路桥	4,300	20,339.00	0.01
436	002027	分众传媒	4,200	20,328.00	0.01
437	601916	浙商银行	7,600	19,988.00	0.01
438	000839	国安股份	7,600	19,684.00	0.01
439	000969	安泰科技	800	19,632.00	0.01
440	002073	软控股份	3,800	19,532.00	0.01
441	600497	驰宏锌锗	1,600	19,376.00	0.01
442	600563	法拉电子	100	19,080.00	0.01
443	601969	海南矿业	2,400	18,984.00	0.01
444	002536	飞龙股份	400	18,872.00	0.00
445	000035	中国天楹	3,900	18,837.00	0.00
446	603638	艾迪精密	800	18,760.00	0.00
446	002152	广电运通	2,000	18,760.00	0.00
447	300390	天华新能	200	18,702.00	0.00
448	603728	鸣志电器	300	18,276.00	0.00
449	301371	敷尔佳	700	18,200.00	0.00

449	301073	君亭酒店	1,000	18,200.00	0.00
450	300623	捷捷微电	400	17,996.00	0.00
451	603939	益丰药房	1,000	17,980.00	0.00
452	600008	首创环保	6,600	17,952.00	0.00
452	002015	协鑫能科	1,100	17,952.00	0.00
453	603050	科林电气	900	17,604.00	0.00
454	600104	上汽集团	1,800	17,568.00	0.00
455	603301	振德医疗	200	17,432.00	0.00
456	002345	潮宏基	1,900	17,423.00	0.00
457	002795	永和智控	2,600	17,394.00	0.00
457	002297	博云新材	600	17,394.00	0.00
458	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.00
459	301075	多瑞医药	300	17,103.00	0.00
460	000733	振华科技	300	16,992.00	0.00
461	300726	宏达电子	200	16,914.00	0.00
462	600132	重庆啤酒	400	16,520.00	0.00
463	601200	上海环境	2,500	16,500.00	0.00
464	601326	秦港股份	5,200	16,432.00	0.00
465	002292	奥飞娱乐	2,500	16,400.00	0.00
466	002204	大连重工	3,100	16,368.00	0.00
467	301196	唯科科技	130	16,304.60	0.00
468	001359	平安电工	130	16,282.50	0.00
469	300327	中颖电子	500	16,025.00	0.00
470	603881	数据港	640	16,000.00	0.00
471	600170	上海建工	7,200	15,984.00	0.00
472	688387	信科移动-U	800	15,872.00	0.00
473	600511	国药股份	600	15,624.00	0.00
474	601512	中新集团	2,000	15,600.00	0.00
475	600120	浙江东方	3,600	15,480.00	0.00
476	603889	新澳股份	3,000	15,330.00	0.00
477	603290	斯达半导	100	15,294.00	0.00

478	600649	城投控股	4,400	15,180.00	0.00
479	002625	光启技术	500	15,160.00	0.00
480	688472	阿特斯	1,400	15,148.00	0.00
481	600021	上海电力	1,000	15,070.00	0.00
482	002675	东诚药业	1,200	15,060.00	0.00
483	600480	凌云股份	1,800	14,958.00	0.00
484	000917	电广传媒	2,200	14,718.00	0.00
485	688029	南微医学	200	14,360.00	0.00
486	603991	领先股份	100	14,115.00	0.00
487	301018	申菱环境	120	13,873.20	0.00
488	002078	太阳纸业	1,100	13,739.00	0.00
489	603608	天创时尚	600	13,698.00	0.00
490	600309	万华化学	200	13,682.00	0.00
491	000923	河钢资源	1,100	13,651.00	0.00
492	002755	奥赛康	1,000	13,620.00	0.00
493	000728	国元证券	1,800	13,482.00	0.00
494	002041	登海种业	1,700	13,379.00	0.00
495	000034	神州数码	480	13,320.00	0.00
496	002379	宏桥控股	900	13,293.00	0.00
497	600458	时代新材	800	13,240.00	0.00
498	688609	九联科技	1,200	13,212.00	0.00
499	300715	凯伦股份	800	13,168.00	0.00
500	601375	中原证券	3,300	13,167.00	0.00
501	600388	龙净环保	900	13,095.00	0.00
502	301510	固高科技	400	12,772.00	0.00
503	688349	三一重能	840	12,751.20	0.00
504	603093	南华期货	700	12,705.00	0.00
505	000088	盐田港	3,100	12,679.00	0.00
506	002595	豪迈科技	270	12,582.00	0.00
507	600375	汉马科技	3,400	12,546.00	0.00
508	600500	中化国际	1,600	12,528.00	0.00

509	300772	运达股份	1,000	12,300.00	0.00
510	601966	玲珑轮胎	1,200	12,228.00	0.00
511	600425	青松建化	3,700	12,099.00	0.00
512	600251	冠农股份	1,400	12,096.00	0.00
513	002400	省广集团	1,900	11,989.00	0.00
514	001203	大中矿业	400	11,980.00	0.00
515	603085	天成自控	1,100	11,957.00	0.00
516	601618	中国中冶	4,900	11,956.00	0.00
517	600707	彩虹股份	700	11,823.00	0.00
518	301316	慧博云通	300	11,814.00	0.00
519	688772	珠海冠宇	600	11,778.00	0.00
520	300487	蓝晓科技	200	11,770.00	0.00
521	002961	瑞达期货	600	11,748.00	0.00
522	600516	方大炭素	1,900	11,723.00	0.00
523	300257	开山股份	400	11,472.00	0.00
524	000039	中集集团	1,400	11,354.00	0.00
525	603170	宝立食品	1,000	11,300.00	0.00
526	600867	通化东宝	1,400	11,256.00	0.00
527	000422	湖北宜化	800	11,240.00	0.00
528	600633	浙数文化	1,100	11,198.00	0.00
529	600350	山东高速	1,000	11,130.00	0.00
530	301381	赛维时代	600	11,064.00	0.00
531	688778	厦钨新能	200	10,880.00	0.00
532	000400	许继电气	500	10,850.00	0.00
533	601609	金田股份	1,000	10,800.00	0.00
533	001227	兰州银行	5,400	10,800.00	0.00
534	600475	华光环能	700	10,675.00	0.00
535	300003	乐普医疗	900	10,665.00	0.00
536	603997	继峰股份	900	10,647.00	0.00
537	603416	信捷电气	200	10,574.00	0.00
538	688726	拉普拉斯	200	10,570.00	0.00

539	600528	中铁工业	1,600	10,544.00	0.00
540	603306	华懋科技	100	10,369.00	0.00
541	000801	四川九洲	800	10,352.00	0.00
542	002635	安洁科技	500	10,225.00	0.00
543	688690	纳微科技	230	10,143.00	0.00
544	600125	铁龙物流	2,000	10,140.00	0.00
545	600158	中体产业	1,500	10,110.00	0.00
545	300738	奥飞数据	500	10,110.00	0.00
546	601611	中国核建	900	10,035.00	0.00
547	002351	漫步者	1,100	9,999.00	0.00
548	300409	道氏技术	500	9,965.00	0.00
549	605111	新洁能	100	9,914.00	0.00
550	600539	狮头股份	600	9,786.00	0.00
551	600861	北京人力	800	9,760.00	0.00
552	300454	深信服	100	9,620.00	0.00
553	000830	鲁西化工	800	9,600.00	0.00
554	002958	青农商行	3,500	9,590.00	0.00
555	002837	英维克	120	9,547.20	0.00
556	600619	海立股份	600	9,510.00	0.00
557	300207	欣旺达	500	9,495.00	0.00
558	000987	越秀资本	1,200	9,384.00	0.00
559	300855	图南股份	300	9,378.00	0.00
560	300244	迪安诊断	500	9,370.00	0.00
561	001301	尚太科技	100	9,351.00	0.00
562	600094	大名城	2,700	9,342.00	0.00
563	002968	新大正	1,100	9,306.00	0.00
564	002290	禾盛新材	100	9,187.00	0.00
565	000738	航发控制	500	9,145.00	0.00
566	603681	永冠新材	400	9,140.00	0.00
567	688107	安路科技	200	9,120.00	0.00
568	603612	索通发展	500	9,065.00	0.00

569	600962	国投中鲁	300	9,051.00	0.00
570	000786	北新建材	500	9,045.00	0.00
571	300779	惠城环保	180	9,036.00	0.00
572	603816	顾家家居	400	8,944.00	0.00
573	002192	融捷股份	100	8,940.00	0.00
574	300767	震安科技	400	8,916.00	0.00
575	600356	恒丰纸业	1,200	8,892.00	0.00
576	600750	华润江中	400	8,828.00	0.00
577	300775	三角防务	400	8,816.00	0.00
578	600017	日照港	3,500	8,750.00	0.00
579	600629	华建集团	720	8,719.20	0.00
580	002170	芭田股份	800	8,688.00	0.00
581	600459	贵研铂业	300	8,664.00	0.00
582	688182	灿勤科技	200	8,614.00	0.00
583	002628	成都路桥	1,600	8,560.00	0.00
584	002669	康达新材	500	8,545.00	0.00
585	600595	中孚实业	1,500	8,430.00	0.00
586	603937	丽岛新材	600	8,412.00	0.00
587	002239	奥特佳	3,400	8,398.00	0.00
588	600316	洪都航空	300	8,382.00	0.00
589	603596	伯特利	336	8,346.24	0.00
590	000932	华菱钢铁	2,400	8,328.00	0.00
591	603678	火炬电子	100	8,300.00	0.00
592	688568	中科星图	200	8,294.00	0.00
593	603688	石英股份	100	8,261.00	0.00
594	605069	正和生态	500	8,240.00	0.00
595	600724	宁波富达	1,600	8,112.00	0.00
596	600968	海油发展	2,400	7,992.00	0.00
597	601528	瑞丰银行	1,800	7,956.00	0.00
598	688403	汇成股份	200	7,940.00	0.00
599	000061	农产品	1,400	7,840.00	0.00

600	601857	中国石油	900	7,812.00	0.00
601	300002	神州泰岳	1,000	7,810.00	0.00
602	688593	新相微	200	7,784.00	0.00
603	601778	晶科科技	1,800	7,740.00	0.00
603	002500	山西证券	1,500	7,740.00	0.00
604	600339	中油工程	2,500	7,675.00	0.00
605	600258	首旅酒店	700	7,644.00	0.00
606	002335	科华数据	180	7,641.00	0.00
607	688116	天奈科技	200	7,640.00	0.00
608	002443	金洲管道	800	7,624.00	0.00
609	002025	航天电器	100	7,622.00	0.00
610	603901	永创智能	700	7,609.00	0.00
611	300752	隆利科技	560	7,543.20	0.00
612	600380	健康元	800	7,536.00	0.00
613	000032	深桑达A	300	7,485.00	0.00
614	603589	口子窖	400	7,472.00	0.00
615	600496	精工钢构	2,400	7,440.00	0.00
616	603682	锦和商管	1,000	7,400.00	0.00
617	601016	节能风电	1,900	7,372.00	0.00
618	300818	耐普矿机	390	7,371.00	0.00
619	002046	国机精工	100	7,365.00	0.00
620	002007	华兰生物	600	7,314.00	0.00
621	603858	步长制药	500	7,300.00	0.00
622	688050	爱博医疗	200	7,290.00	0.00
623	600862	中航高科	400	7,212.00	0.00
624	600363	联创光电	200	7,156.00	0.00
625	601666	平煤股份	1,000	7,150.00	0.00
626	688088	虹软科技	200	7,110.00	0.00
626	002588	史丹利	900	7,110.00	0.00
627	002986	宇新股份	600	7,098.00	0.00
628	300055	万邦达	1,100	7,073.00	0.00

629	002432	九安医疗	100	7,068.00	0.00
630	300483	首华燃气	400	7,032.00	0.00
631	600985	淮北矿业	500	7,025.00	0.00
632	688113	联测科技	200	7,020.00	0.00
633	603055	台华新材	900	7,011.00	0.00
634	300357	我武生物	300	6,996.00	0.00
635	000922	佳电股份	500	6,980.00	0.00
636	600901	江苏金租	1,200	6,900.00	0.00
637	600390	五矿资本	1,500	6,840.00	0.00
638	002051	中工国际	600	6,792.00	0.00
639	603217	元利科技	300	6,729.00	0.00
640	600727	鲁北化工	1,000	6,720.00	0.00
641	300320	海达股份	700	6,678.00	0.00
642	603606	东方电缆	160	6,641.60	0.00
643	002340	格林美	1,000	6,610.00	0.00
644	002145	钛能化学	1,400	6,594.00	0.00
645	603667	五洲新春	100	6,552.00	0.00
646	600598	北大荒	600	6,504.00	0.00
647	002075	沙钢股份	1,900	6,460.00	0.00
648	002913	奥士康	100	6,394.00	0.00
649	002465	海格通信	500	6,385.00	0.00
650	600963	岳阳林纸	2,100	6,384.00	0.00
651	600470	六国化工	1,100	6,380.00	0.00
652	600888	新疆众和	400	6,356.00	0.00
653	002828	贝肯能源	600	6,342.00	0.00
654	301109	军信股份	500	6,230.00	0.00
655	601996	丰林集团	3,000	6,210.00	0.00
656	600051	宁波联合	1,100	6,193.00	0.00
657	601568	北元化工	1,800	6,120.00	0.00
658	002397	梦洁股份	1,600	6,112.00	0.00
659	300854	中兰环保	320	6,105.60	0.00

660	002408	齐翔腾达	1,300	6,097.00	0.00
661	000420	吉林化纤	1,500	6,075.00	0.00
662	600035	楚天高速	1,800	6,066.00	0.00
663	603505	金石资源	300	6,045.00	0.00
664	605189	富春染织	500	6,025.00	0.00
665	000885	城发环境	500	6,015.00	0.00
666	603233	大参林	400	6,012.00	0.00
667	603167	渤海轮渡	700	5,999.00	0.00
668	603605	珀莱雅	100	5,992.00	0.00
669	600758	辽宁能源	1,900	5,985.00	0.00
670	601083	锦江航运	600	5,964.00	0.00
671	600782	新钢股份	2,400	5,952.00	0.00
672	600798	宁波海运	1,900	5,909.00	0.00
673	600617	国新能源	2,200	5,896.00	0.00
674	600059	古越龙山	800	5,856.00	0.00
675	603162	海通发展	644	5,776.68	0.00
676	688289	圣湘生物	400	5,760.00	0.00
677	002338	奥普光电	100	5,720.00	0.00
678	300031	宝通科技	200	5,714.00	0.00
679	600716	凤凰股份	1,700	5,712.00	0.00
679	000545	金浦钛业	2,400	5,712.00	0.00
680	000811	冰轮环境	100	5,622.00	0.00
681	001298	好上好	270	5,602.50	0.00
682	603689	皖天然气	800	5,544.00	0.00
682	000906	浙商中拓	1,100	5,544.00	0.00
683	002312	川发龙蟒	600	5,502.00	0.00
684	300829	金丹科技	400	5,492.00	0.00
685	300113	顺网科技	300	5,463.00	0.00
686	601598	中国外运	1,100	5,456.00	0.00
687	002442	龙星科技	1,100	5,423.00	0.00
688	002757	南兴股份	300	5,415.00	0.00

689	002632	道明光学	600	5,406.00	0.00
690	002454	松芝股份	1,120	5,353.60	0.00
691	600655	豫园股份	1,300	5,343.00	0.00
692	000901	航天科技	300	5,337.00	0.00
693	002389	航天彩虹	300	5,331.00	0.00
694	600052	东望时代	1,500	5,310.00	0.00
695	688139	海尔生物	200	5,284.00	0.00
696	002917	金奥博	500	5,270.00	0.00
697	000637	茂化实华	1,500	5,250.00	0.00
698	002984	森麒麟	400	5,228.00	0.00
699	002998	优彩资源	800	5,208.00	0.00
700	600606	绿地控股	4,300	5,203.00	0.00
701	002629	仁智股份	1,200	5,160.00	0.00
702	601918	新集能源	600	5,154.00	0.00
703	603708	家家悦	600	5,148.00	0.00
704	605177	东亚药业	300	5,133.00	0.00
705	001228	永泰运	200	5,110.00	0.00
706	000581	威孚高科	300	5,106.00	0.00
707	002688	金河生物	1,100	5,082.00	0.00
708	001286	陕西能源	500	5,070.00	0.00
709	002439	启明星辰	400	5,060.00	0.00
710	600223	福瑞达	1,000	5,030.00	0.00
711	002783	凯龙股份	700	4,977.00	0.00
712	688303	大全能源	285	4,967.55	0.00
713	000050	深天马A	500	4,955.00	0.00
714	600751	海航科技	1,700	4,947.00	0.00
715	600737	中粮糖业	400	4,932.00	0.00
716	600067	冠城新材	1,700	4,930.00	0.00
717	002556	辉隆股份	1,100	4,928.00	0.00
718	002760	凤形股份	300	4,926.00	0.00
719	002672	东江环保	1,500	4,920.00	0.00

720	300917	特发服务	200	4,876.00	0.00
721	301040	中环海陆	200	4,874.00	0.00
722	600657	信达地产	2,100	4,851.00	0.00
723	603059	倍加洁	200	4,850.00	0.00
724	300913	兆龙互连	100	4,791.00	0.00
725	600918	中泰证券	900	4,788.00	0.00
726	600231	凌钢股份	3,000	4,770.00	0.00
727	600587	新华医疗	400	4,752.00	0.00
728	002666	德联集团	1,200	4,740.00	0.00
729	600981	苏豪汇鸿	2,100	4,725.00	0.00
730	600728	佳都科技	1,100	4,686.00	0.00
731	000833	粤桂股份	200	4,684.00	0.00
732	600517	国网英大	1,000	4,680.00	0.00
733	000905	厦门港务	600	4,656.00	0.00
734	300144	宋城演艺	800	4,648.00	0.00
735	000707	双环科技	1,100	4,642.00	0.00
736	300641	正丹股份	300	4,614.00	0.00
737	600731	湖南海利	900	4,608.00	0.00
738	603496	恒为科技	200	4,596.00	0.00
739	000719	中原传媒	400	4,572.00	0.00
740	600461	洪城环境	500	4,530.00	0.00
741	601366	利群股份	1,400	4,522.00	0.00
742	603049	中策橡胶	100	4,481.00	0.00
743	600559	老白干酒	400	4,480.00	0.00
744	000655	金岭矿业	700	4,452.00	0.00
745	600566	济川药业	200	4,438.00	0.00
746	002705	新宝股份	400	4,432.00	0.00
747	300901	中胤时尚	300	4,431.00	0.00
748	000069	华侨城A	2,700	4,428.00	0.00
749	001218	丽臣实业	200	4,412.00	0.00
750	600366	宁波韵升	300	4,404.00	0.00

751	000537	绿发电力	600	4,386.00	0.00
752	003041	真爱美家	100	4,365.00	0.00
753	000027	深圳能源	700	4,340.00	0.00
754	601233	桐昆股份	200	4,330.00	0.00
755	300680	隆盛科技	190	4,316.80	0.00
756	002942	新农股份	300	4,299.00	0.00
757	603338	浙江鼎力	100	4,250.00	0.00
758	600018	上港集团	900	4,248.00	0.00
759	000635	英力特	700	4,228.00	0.00
760	000850	华茂股份	1,200	4,212.00	0.00
761	300130	新国都	200	4,208.00	0.00
762	600835	上海机电	200	4,120.00	0.00
763	002659	凯文教育	1,100	4,114.00	0.00
764	603585	苏利股份	300	4,101.00	0.00
765	601187	厦门银行	600	4,098.00	0.00
766	603871	嘉友国际	400	4,084.00	0.00
767	600690	海尔智家	200	4,082.00	0.00
768	600582	天地科技	900	4,005.00	0.00
769	603568	伟明环保	260	3,998.80	0.00
770	603171	税友股份	100	3,985.00	0.00
771	600262	北方股份	200	3,958.00	0.00
772	002441	众业达	500	3,900.00	0.00
773	300049	福瑞医科	100	3,888.00	0.00
774	001296	长江材料	200	3,834.00	0.00
775	002029	七匹狼	500	3,820.00	0.00
776	605555	德昌股份	300	3,750.00	0.00
777	605090	九丰能源	100	3,717.00	0.00
778	600409	三友化工	600	3,666.00	0.00
779	688382	益方生物-U	200	3,600.00	0.00
780	688298	东方生物	200	3,572.00	0.00
781	301039	中集车辆	500	3,525.00	0.00

782	603299	苏盐井神	400	3,516.00	0.00
783	300070	碧水源	1,100	3,509.00	0.00
784	600056	中国医药	400	3,500.00	0.00
785	300887	谱尼测试	500	3,480.00	0.00
786	600661	昂立教育	500	3,455.00	0.00
787	002498	汉缆股份	500	3,410.00	0.00
788	002539	云图控股	300	3,396.00	0.00
789	600673	东阳光	100	3,358.00	0.00
790	601921	浙版传媒	500	3,345.00	0.00
791	300660	江苏雷利	120	3,343.20	0.00
792	603711	香飘飘	300	3,333.00	0.00
793	301363	美好医疗	180	3,299.40	0.00
794	002649	博彦科技	400	3,256.00	0.00
795	601808	中海油服	300	3,243.00	0.00
796	600578	京能电力	500	3,225.00	0.00
797	600805	悦达投资	800	3,224.00	0.00
798	300957	贝泰妮	100	3,151.00	0.00
799	002226	江南化工	700	3,143.00	0.00
800	601311	骆驼股份	400	3,116.00	0.00
801	600556	天下秀	700	3,094.00	0.00
802	601607	上海医药	200	3,080.00	0.00
803	601096	宏盛华源	700	3,038.00	0.00
804	002276	万马股份	300	3,033.00	0.00
805	000998	隆平高科	400	3,016.00	0.00
806	000089	深圳机场	500	3,015.00	0.00
807	603477	巨星农牧	200	2,960.00	0.00
808	601801	皖新传媒	600	2,958.00	0.00
809	600933	爱柯迪	200	2,956.00	0.00
810	002328	新朋股份	400	2,936.00	0.00
811	600667	太极实业	100	2,918.00	0.00
812	300759	康龙化成	100	2,893.00	0.00

813	000513	丽珠集团	100	2,889.00	0.00
814	300809	华辰装备	100	2,705.00	0.00
815	300777	中简科技	100	2,628.00	0.00
816	002252	上海莱士	600	2,604.00	0.00
817	300655	晶瑞电材	120	2,570.40	0.00
818	601997	贵阳银行	500	2,565.00	0.00
819	002582	好想你	300	2,535.00	0.00
820	000563	陕国投A	900	2,484.00	0.00
821	002324	普利特	200	2,414.00	0.00
822	000029	深深房A	100	2,205.00	0.00
823	003039	顺控发展	200	2,202.00	0.00
824	601069	西部黄金	100	2,200.00	0.00
825	603883	老百姓	200	2,192.00	0.00
826	600057	厦门象屿	400	2,168.00	0.00
827	601619	嘉泽新能	500	2,150.00	0.00
828	002266	浙富控股	400	2,024.00	0.00
829	688306	均普智能	200	2,020.00	0.00
830	600783	鲁信创投	100	1,992.00	0.00
831	301551	无线传媒	100	1,973.00	0.00
832	605116	奥锐特	100	1,892.00	0.00
833	002882	金龙羽	100	1,889.00	0.00
834	002287	奇正藏药	100	1,884.00	0.00
835	300633	开立医疗	100	1,839.00	0.00
836	002557	洽洽食品	100	1,796.00	0.00
837	300047	天源迪科	200	1,776.00	0.00
838	600312	平高电气	100	1,766.00	0.00
839	600278	东方创业	300	1,764.00	0.00
840	605333	沪光股份	100	1,705.00	0.00
841	601860	紫金银行	700	1,694.00	0.00
841	002960	青鸟智控	200	1,694.00	0.00
842	300446	航天智造	100	1,683.00	0.00

843	002752	昇兴股份	300	1,656.00	0.00
844	300369	绿盟科技	300	1,632.00	0.00
845	000997	新大陆	100	1,630.00	0.00
846	301207	华兰疫苗	100	1,629.00	0.00
847	600508	上海能源	220	1,621.40	0.00
848	000425	徐工机械	200	1,618.00	0.00
849	301091	深城交	100	1,550.00	0.00
850	002461	珠江啤酒	200	1,514.00	0.00
851	600095	湘财股份	200	1,506.00	0.00
852	601952	苏垦农发	200	1,498.00	0.00
853	002017	东信和平	100	1,463.00	0.00
854	600757	长江传媒	200	1,462.00	0.00
855	301267	华夏眼科	100	1,459.00	0.00
856	601026	道生天合	100	1,458.00	0.00
857	002468	申通快递	100	1,456.00	0.00
858	300026	红日药业	500	1,450.00	0.00
859	301602	超研股份	100	1,374.00	0.00
860	600373	中文传媒	200	1,326.00	0.00
861	300341	麦克奥迪	100	1,325.00	0.00
862	002258	利尔化学	100	1,271.00	0.00
863	002093	国脉科技	200	1,260.00	0.00
864	600995	南网储能	100	1,230.00	0.00
865	003816	中国广核	300	1,173.00	0.00
866	000030	富奥股份	300	1,161.00	0.00
867	000685	中山公用	100	1,116.00	0.00
868	002867	周大生	100	1,115.00	0.00
869	002948	青岛银行	200	1,016.00	0.00
870	601107	四川成渝	200	976.00	0.00
871	002727	一心堂	100	959.00	0.00
872	601789	宁波建工	200	802.00	0.00
873	601022	宁波远洋	100	762.00	0.00

874	000927	中国铁物	300	681.00	0.00
875	600998	九州通	100	469.00	0.00
876	002807	江阴银行	120	445.20	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	600577	精达股份	3,656,790.00	0.86
2	600320	振华重工	2,792,198.00	0.66
3	688525	佰维存储	2,708,786.78	0.64
4	601899	紫金矿业	2,572,448.00	0.61
5	603236	移远通信	2,311,998.00	0.55
6	688469	芯联集成-U	2,234,290.14	0.53
7	300857	协创数据	2,200,236.00	0.52
8	001309	德明利	2,155,163.00	0.51
9	000792	盐湖股份	2,095,781.00	0.50
10	600037	歌华有线	2,009,389.00	0.47
11	600372	中航机载	1,938,687.00	0.46
12	600487	亨通光电	1,845,290.00	0.44
13	688779	五矿新能	1,844,148.01	0.44
14	688766	普冉股份	1,835,828.73	0.43
15	300604	长川科技	1,834,112.00	0.43
16	600183	生益科技	1,819,520.00	0.43
17	600395	盘江股份	1,812,484.00	0.43
18	002008	大族激光	1,806,967.00	0.43
19	300308	中际旭创	1,789,722.00	0.42
20	002738	中矿资源	1,779,956.00	0.42

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	603929	亚翔集成	5,143,993.00	1.22
2	002415	海康威视	4,242,943.00	1.00
3	600096	云天化	3,769,553.00	0.89
4	301031	中熔电气	3,517,585.00	0.83
5	300033	同花顺	3,412,874.90	0.81
6	688111	金山办公	3,229,256.10	0.76
7	603444	吉比特	3,220,787.00	0.76
8	601336	新华保险	3,087,564.00	0.73
9	300957	贝泰妮	3,040,268.00	0.72
10	603486	科沃斯	3,017,320.00	0.71
11	688525	佰维存储	2,963,776.14	0.70
12	603259	药明康德	2,931,211.00	0.69
13	605499	东鹏饮料	2,807,514.00	0.66
14	688799	华纳药厂	2,804,600.68	0.66
15	600577	精达股份	2,792,870.00	0.66
16	300693	盛弘股份	2,763,012.00	0.65
17	603816	顾家家居	2,725,729.00	0.64
18	603893	瑞芯微	2,621,998.00	0.62
19	000423	东阿阿胶	2,523,206.00	0.60
20	601900	南方传媒	2,513,647.00	0.59

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	461,615,519.38
卖出股票收入（成交）总额	483,953,495.85

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	41,484,599.29	10.95
2	央行票据	-	-
3	金融债券	64,960,008.76	17.15
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	30,610,815.34	8.08
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	196,022,459.61	51.76
7	可转债(可交换债)	9,820,474.92	2.59
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	342,898,357.92	90.54

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

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	102483737	24金茂投资MTN 002	200,000	20,681,265.75	5.46
2	102584026	25海尔金盈MTN 005	200,000	20,436,991.78	5.40
3	2280439	22华发集团01	200,000	20,350,087.67	5.37
4	019827	26国债01	197,000	19,827,693.78	5.24
5	230023	23付息国债23	100,000	11,642,114.75	3.07

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。成都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。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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	18,959,313.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,959,313.74

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	128136	立讯转债	761,411.10	0.20
2	127084	柳工转2	669,652.35	0.18
3	127040	国泰转债	596,366.88	0.16
4	127064	杭氧转债	525,399.27	0.14
5	132026	G三峡EB2	515,066.30	0.14
6	113049	长汽转债	498,117.55	0.13
7	113616	韦尔转债	496,326.04	0.13
8	127030	盛虹转债	474,634.06	0.13
9	123107	温氏转债	454,080.20	0.12
10	113697	应流转债	426,573.47	0.11
11	127085	韵达转债	407,341.42	0.11
12	127089	晶澳转债	390,456.46	0.10
13	127110	广核转债	362,165.36	0.10
14	113053	隆22转债	339,408.53	0.09
15	123257	安克转债	337,877.25	0.09
16	127045	牧原转债	329,778.14	0.09
17	127102	浙建转债	326,997.16	0.09
18	127049	希望转2	318,183.79	0.08
19	110075	南航转债	292,859.86	0.08
20	127083	山路转债	270,239.38	0.07
21	113043	财通转债	261,666.48	0.07
22	113062	常银转债	254,874.88	0.07
23	113051	节能转债	247,181.18	0.07
24	110085	通22转债	158,970.48	0.04
25	127067	恒逸转2	92,514.72	0.02

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 聚享 增盈 债券A	369	701,710.11	241,794,265.95	93.3 8%	17,136,765.28	6.62%
中加 聚享 增盈 债券C	817	99,735.73	16,796,754.20	20.6 1%	64,687,338.87	79.39%
合计	1,1 86	287,027.93	258,591,020.15	75.9 6%	81,824,104.15	24.04%

8.2 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	中加聚享增盈 债券A	93,132.96	0.04%
	中加聚享增盈 债券C	46,747.96	0.06%
	合计	139,880.92	0.04%

8.3 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	中加聚享增盈债券A	0~10
	中加聚享增盈债券C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中加聚享增盈债券A	-
	中加聚享增盈债券C	-
	合计	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中加聚享增盈债券A	中加聚享增盈债券C
基金合同生效日(2022年05月05日)基金份额总额	187,856,083.73	54,400,650.65
本报告期期初基金份额总额	190,631,581.98	202,873,711.94
本报告期基金总申购份额	199,400,695.53	113,875,381.39
减：本报告期基金总赎回份额	131,101,246.28	235,265,000.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	258,931,031.23	81,484,093.07

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。

基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况：2026年6月23日，根据托管人工作安排，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

自本基金成立之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》
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，基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
平安证券	4	945,569,015.23	100.00%	417,064.15	100.00%	-

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
平安证券	33,438,166.41	100.00%	4,050,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	中加聚享增盈债券型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-20
2	中加聚享增盈债券型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-27
3	中加聚享增盈债券型证券投资基金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

本报告期内不存在单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情况。

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聚享增盈债券型证券投资基金设立的文件
- 2、《中加聚享增盈债券型证券投资基金基金合同》
- 3、《中加聚享增盈债券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