

国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金
2026 年中期报告
2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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
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	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	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	12
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	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	53
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	53
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	53
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	54
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.11 投资组合报告附注	54
8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	55

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
9 开放式基金份额变动	56
10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	57
10.8 其他重大事件	58
11 影响投资者决策的其他重要信息	58
12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录	59
12.2 存放地点	59
12.3 查阅方式	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	国泰兴益灵活配置混合	
基金主代码	001265	
交易代码	001265	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015 年 5 月 14 日	
基金管理人	国泰基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,814,808.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国泰兴益灵活配置混合 A	国泰兴益灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	001265	002055
报告期末下属分级基金的份额总额	45,666,690.06 份	70,148,118.91 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，追求稳健的绝对回报。
投资策略	1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、存托凭证投资策略；4、固定收益类投资工具投资策略；5、中小企业私募债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、权证投资策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，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		国泰基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	倪莹	冯萌
	联系电话	021-31081600转	021-52629999-213310
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95561
传真		021-31081800	021-62159217
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	福建省福州市台江区江滨中大

	浦东大道1200号2层225室	道398号兴业银行大厦
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦15-20层	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码	200082	200120
法定代表人	周向勇	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告置备地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层和本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国泰基金管理有限公司	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15 层-20 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	国泰兴益灵活配置混合 A	国泰兴益灵活配置混合 C
本期已实现收益	10,027,511.08	8,215,376.41
本期利润	7,277,605.22	7,197,187.67
加权平均基金份额本期利润	0.1561	0.1728
本期加权平均净值利润率	10.56%	11.21%
本期基金份额净值增长率	11.05%	10.99%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	国泰兴益灵活配置混合 A	国泰兴益灵活配置混合 C
期末可供分配利润	25,940,895.43	43,926,999.29
期末可供分配基金份额利润	0.5680	0.6262
期末基金资产净值	71,607,585.49	114,075,118.20
期末基金份额净值	1.568	1.626
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	国泰兴益灵活配置混合 A	国泰兴益灵活配置混合 C

基金份额累计净值增长率	103.59%	97.08%
-------------	---------	--------

注：(1)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

(2)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。

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

国泰兴益灵活配置混合 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	13.71%	1.30%	1.18%	0.01%	12.53%	1.29%
过去六个月	11.05%	1.21%	2.36%	0.02%	8.69%	1.19%
过去一年	35.74%	1.06%	4.75%	0.02%	30.99%	1.04%
过去三年	39.39%	0.73%	14.25%	0.01%	25.14%	0.72%
过去五年	33.82%	0.58%	23.75%	0.02%	10.07%	0.56%
过去七年	63.85%	0.53%	33.25%	0.01%	30.60%	0.52%
过去十年	95.95%	0.58%	47.49%	0.01%	48.46%	0.57%
自基金合同生效起至今	103.59%	0.55%	53.09%	0.01%	50.50%	0.54%

国泰兴益灵活配置混合 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	13.71%	1.29%	1.18%	0.01%	12.53%	1.28%
过去六个月	10.99%	1.20%	2.36%	0.02%	8.63%	1.18%
过去一年	35.56%	1.06%	4.75%	0.02%	30.81%	1.04%
过去三年	38.84%	0.73%	14.25%	0.01%	24.59%	0.72%
过去五年	33.00%	0.58%	23.75%	0.02%	9.25%	0.56%
过去七年	62.57%	0.53%	33.25%	0.01%	29.32%	0.52%
过去十年	93.29%	0.58%	47.49%	0.01%	45.80%	0.57%
自新增 C 类份额起至今	97.08%	0.57%	50.45%	0.01%	46.63%	0.56%

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

国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 5 月 14 日至 2026 年 6 月 30 日)

国泰兴益灵活配置混合 A



注：(1)本基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日；

(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

国泰兴益灵活配置混合 C



注：(1)本基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日；

(2)本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定；

(3)自 2015 年 11 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 319 只公开募集证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
王琳	国泰兴益灵活配置混合、国泰安益灵活配置混合、国泰佳益混合、国泰悦益六个月持有混合、国泰慧益一年持有混合、国泰融丰外延增长灵活配置混合（LOF）、国泰医药健康股票的基金经理	2017-01-25	-	17 年	博士研究生。2009 年 2 月加入国泰基金，历任研究员、基金经理助理。2017 年 1 月起任国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 8 月任国泰添益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 1 月至 2018 年 4 月任国泰福益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 6 月至 2018 年 3 月任国泰睿信平衡混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2018 年 3 月任国泰鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月至 2024 年 1 月任国泰安康定期支付混合型证券投资基

					金(原国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金)的基金经理, 2017 年 8 月至 2018 年 5 月任国泰泽益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 5 月至 2025 年 9 月任国泰多策略收益灵活配置混合型证券投资基金和国泰鑫策略价值灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月起兼任国泰安益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月至 2024 年 8 月任国泰普益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 8 月至 2021 年 2 月任国泰招惠收益定期开放债券型证券投资基金的基金经理, 2020 年 3 月至 2021 年 3 月任国泰双利债券证券投资基金的基金经理, 2021 年 6 月起兼任国泰佳益混合型证券投资基金的基金经理, 2025 年 1 月起兼任国泰悦益六个月持有期混合型证券投资基金的基金经理, 2025 年 2 月起兼任国泰融丰外延增长灵活配置混合型证券投资基金(LOF)和国泰慧益一年持有期混合型证券投资基金的基金经理, 2025 年 4 月至 2026 年 4 月任国泰国策驱动灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2026 年 1 月起兼任国泰医药健康股票型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场 and 不当关联交易及其他违规行为

为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 10 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2026 年上半年，国内资本市场各大指数呈现显著的 K 型分化。具体而言，上证指数上涨 3.16%，深证成指上涨 19.82%，创业板指上涨 35.58%，科创 50 指数上涨 64.25%。从行业表现来看，电子、通信、建材等板块涨幅居前；反之，消费者服务、综合金融、农林牧渔等板块跌幅居前。结构上的 K 型分化主要发生在二季度。

国际宏观环境方面，美伊冲突进入到二季度之后一度趋于和缓，最终停战，霍尔木兹海峡重启，石油价格下行，市场风偏上行。与此同时，AI 产业景气度持续高歌猛进，大厂大幅提升资本开支、产业链相关硬件价格持续大比例提价、政策配套明确支持产业发展。而宏观经济数据稳中偏弱，与科技的迅猛发展形成对比。在此背景下，资本市场呈现出显著的结构性差异走势，科技一枝独秀。

回顾本基金在 2026 年上半年的投资操作，本基金重视股票底仓的结构性配置，并积极参与科创板、主板、创业板新股投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类本报告期内的净值增长率为 11.05%，同期业绩比较基准收益率为 2.36%。

本基金 C 类本报告期内的净值增长率为 10.99%，同期业绩比较基准收益率为 2.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度，霍尔木兹海峡已经重启，美伊冲突对能源价格等影响已经阶段性结束。同时人工智能、机器人、创新药等产业周期继续上行。基于对国内外经济形势的综合研判，我们认为市场后续具有较好的结构性投资机会。以下几个关键要素值得持续关注：其一，美国加息预期的波动；其二，国内经济修复进程如何进一步深化，重点关注投资、消费等高频经济数据的动态变化；其三，产业资本在人工智能（AI）、机器人、智能驾驶以及创新药等新兴行业的投资进展，涵盖全球产业技术革新成果、新技术路线产品的研发推出情况，以及国内外项目合作推进程度等；其四，各行业及上市公司的经营状况变化，尤其是业绩增长的可持续性与经营风险管控能力，短期关注中报情况。

综合以上因素，我们对后续市场重点关注以下投资方向：

1) 医药板块。国内创新药的产业趋势仍在上行期。相比于 2025 年投资创新药本身，2026 年创新药产业链的投资机会更为明确。随着创新药企融资环境的持续改善，创新药产业链企业（包括上游、临床 CRO 等）的订单情况已经在 2025 年开始显现拐点迹象，进入上行通道。进入 2026 年后，上行趋势加速，该板块具备较为明确的投资价值。相关上市公司 2026 年一季报的披露使得该趋势进一步明朗，未来中报的披露将进一步验证我们对行业周期的预期。部分创新药股价已经回调明显，后续创新管线数据的读出、BD 的进展也是我们重点关注的方向。此外，AI 医疗、脑机接口等处于产业发展早期阶段，存有主题性投资机会，重点关注技术突破，产业投融资事件等。

2) 科技成长赛道：AI 软硬件、人形机器人、智能驾驶等全球共进的产业领域蕴含短中长期投资机遇。

3) 顺周期板块：对经济周期的变化保持关注，CPI/PPI 保持持续跟进。上海二手房市场持续情况较好，保持关注。相关板块包括化工、有色、建材、轻工以及消费等，2026 年后续或有较好的投资机会，保持跟踪行业数据，做好个股挖掘。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相

关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

无。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,206,734.03	40,860,317.09
结算备付金		658,042.13	30,852.89
存出保证金		89,154.15	30,502.41
交易性金融资产	6.4.7.2	184,238,634.95	168,128,154.51
其中：股票投资		174,351,335.06	160,425,735.52
基金投资		-	-
债券投资		9,887,299.89	7,702,418.99
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		597.45	2,866.24
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	225.00	225.00
资产总计		186,193,387.71	209,052,918.14
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		247.68	29,605,442.96
应付赎回款		297,561.66	4,260.96
应付管理人报酬		73,481.17	75,595.18
应付托管费		14,696.22	15,119.04
应付销售服务费		8,974.90	9,756.93
应付投资顾问费		-	-
应交税费		298.84	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	115,423.55	100,260.02
负债合计		510,684.02	29,810,435.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	115,814,808.97	124,050,130.48

未分配利润	6.4.7.8	69,867,894.72	55,192,352.57
净资产合计		185,682,703.69	179,242,483.05
负债和净资产总计		186,193,387.71	209,052,918.14

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 115,814,808.97 份，其中 A 类基金份额净值 1.568 元，份额总额 45,666,690.06 份；C 类基金份额净值 1.626 元，份额总额 70,148,118.91 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,990,304.73	6,379,570.76
1.利息收入		8,166.07	54,586.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,166.07	18,385.58
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		-	36,200.93
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,748,670.63	3,359,452.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	17,648,262.68	821,117.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	37,951.58	609,146.31
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	1,062,456.37	1,929,188.61
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-3,768,094.60	2,961,727.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,562.63	3,804.42
减：二、营业总支出		515,511.84	466,148.73
1. 管理人报酬		331,142.51	346,039.64
2. 托管费		66,228.49	60,091.15
3. 销售服务费		32,093.22	34,454.04
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		200.00	1,191.83
其中：卖出回购金融资产支出		200.00	1,191.83
6. 信用减值损失		-	-

7. 税金及附加		46.31	528.61
8. 其他费用	6.4.7.16	85,801.31	23,843.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,474,792.89	5,913,422.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,474,792.89	5,913,422.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,474,792.89	5,913,422.03

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	124,050,130.48	55,192,352.57	179,242,483.05
二、本期期初净资产	124,050,130.48	55,192,352.57	179,242,483.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-8,235,321.51	14,675,542.15	6,440,220.64
（一）、综合收益总额	-	14,474,792.89	14,474,792.89
（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）	-8,235,321.51	200,749.26	-8,034,572.25
其中：1.基金申购款	69,409,180.58	40,197,339.51	109,606,520.09
2.基金赎回款	-77,644,502.09	-39,996,590.25	-117,641,092.34
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	115,814,808.97	69,867,894.72	185,682,703.69
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	41,886,514.56	8,512,372.63	50,398,887.19
二、本期期初净资产	41,886,514.56	8,512,372.63	50,398,887.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	128,607,528.38	34,458,267.51	163,065,795.89
（一）、综合收益总额	-	5,913,422.03	5,913,422.03
（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）	128,607,528.38	28,544,845.48	157,152,373.86
其中：1.基金申购款	137,064,911.14	30,360,835.75	167,425,746.89
2.基金赎回款	-8,457,382.76	-1,815,990.27	-10,273,373.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	170,494,042.94	42,970,640.14	213,464,683.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：吴洪涛，会计机构负责人：张洁清

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015] 631 号《关于准予国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰兴益灵

活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 6,867,028,709.46 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第 483 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 5 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,867,318,490.81 份基金份额，其中认购资金利息折合 289,781.35 份基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据 2015 年 11 月 14 日发布的《关于国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金增加 C 类基金份额并修改基金合同的公告》，自 2015 年 11 月 16 日起，本基金增加 C 类基金份额并分别设置对应的基金代码，投资人申购时可以自主选择 A 类基金份额(现有份额)或 C 类基金份额对应的基金代码进行申购。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。新增 C 类基金份额前已持有本基金基金份额的投资人，其基金账户中保留的本基金基金份额余额为 A 类基金份额。由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 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，在收益分配数额方面可能有所不同。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、权证等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等)，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0%-95%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不高于 20%；每个交易日日终持有的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准：三年期银行定期存款利率(税后)+2%。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2026 年 8 月 27 日批准报出。

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 2026 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据中华人民共和国主席令第 41 号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财政部、税务总局公告 2026 年第 12 号《关于

明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，公开募集证券投资基金管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对公募证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入以及金融同业往来利息收入免征增值税。

(2)自 2025 年 8 月 8 日起，对基金取得的在该日期之后(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(包含在 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。

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

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

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

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,206,734.03
等于：本金	1,206,672.94
加：应计利息	61.09

定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,206,734.03

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		154,810,742.76	-	174,351,335.06	19,540,592.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		61,454.29		
	市场	9,822,042.00		9,887,299.89	3,803.60
	银行间		-		
	市场	-		-	-
合计		9,822,042.00	61,454.29	9,887,299.89	3,803.60
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		164,632,784.76	61,454.29	184,238,634.95	19,544,395.90

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	225.00
待摊费用	-
其他	-
合计	225.00

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	50,956.78
其中：交易所市场	50,956.78
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,466.77
合计	115,423.55

6.4.7.7 实收基金

国泰兴益灵活配置混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	47,199,659.97	47,199,659.97
本期申购	328,342.82	328,342.82
本期赎回（以“-”号填列）	-1,861,312.73	-1,861,312.73
本期末	45,666,690.06	45,666,690.06

国泰兴益灵活配置混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	76,850,470.51	76,850,470.51
本期申购	69,080,837.76	69,080,837.76
本期赎回（以“-”号填列）	-75,783,189.36	-75,783,189.36
本期末	70,148,118.91	70,148,118.91

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国泰兴益灵活配置混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,079,415.05	2,370,608.99	19,450,024.04
本期期初	17,079,415.05	2,370,608.99	19,450,024.04
本期利润	10,027,511.08	-2,749,905.86	7,277,605.22
本期基金份额交易产生的变动数	-813,279.80	26,545.97	-786,733.83
其中：基金申购款	166,160.34	-2,648.35	163,511.99
基金赎回款	-979,440.14	29,194.32	-950,245.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,293,646.33	-352,750.90	25,940,895.43

国泰兴益灵活配置混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,705,243.87	4,037,084.66	35,742,328.53
本期期初	31,705,243.87	4,037,084.66	35,742,328.53
本期利润	8,215,376.41	-1,018,188.74	7,197,187.67
本期基金份额交易产生的变动数	4,539,286.15	-3,551,803.06	987,483.09
其中：基金申购款	41,598,945.96	-1,565,118.44	40,033,827.52
基金赎回款	-37,059,659.81	-1,986,684.62	-39,046,344.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,459,906.43	-532,907.14	43,926,999.29

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,641.09
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	231.57
其他	293.41
合计	8,166.07

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	110,681,667.75
减：卖出股票成本总额	92,863,188.32
减：交易费用	170,216.75
买卖股票差价收入	17,648,262.68

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	41,058.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,107.00
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	37,951.58

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,622,041.71
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	9,503,534.00

成本总额	
减：应计利息总额	121,614.71
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-3,107.00

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,062,456.37
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	1,062,456.37

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-3,768,094.60
——股票投资	-3,764,523.40
——债券投资	-3,571.20
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-3,768,094.60

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	1,555.36
转换费收入	7.27

合计	1,562.63
----	----------

注：1.本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2.本基金的转换费由转出基金赎回费和转入基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25%归入基金资产。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	4,959.40
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
上清所查询服务费	600.00
银行汇划费用	2,734.54
合计	85,801.31

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	331,142.51	346,039.64
其中：应支付销售机构的客户维护费	56,840.58	65,153.57
应支付基金管理人的净管理费	274,301.93	280,886.07

注：自 2025 年 03 月 18 日起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50% / 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1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	66,228.49	60,091.15

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 X 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1月1日至2026年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰兴益灵活配置 混合 A	国泰兴益灵活配置混合 C	合计
国泰基金管理有限公司	-	10,213.99	10,213.99
合计	-	10,213.99	10,213.99
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国泰兴益灵活配置混合A	国泰兴益灵活配置混合C	合计
国泰基金管理有限公司	-	15,367.99	15,367.99
合计	-	15,367.99	15,367.99

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日各类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国泰基金管理有限公司，再由国泰基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。C 类基金份额约定的销售服务费年费率为 0.10%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 X0.10% / 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均无与关联方进行的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	国泰兴益灵活配置混合A	国泰兴益灵活配置混合C	国泰兴益灵活配置混合A	国泰兴益灵活配置混合C
期初持有的基金份额	28,267,844.52	-	2,441,752.22	-
期间申购/买入总份额	-	-	29,361,577.18	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额	28,267,844.52	-	31,803,329.40	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	24.41%	-	18.65%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	1,206,734.03	7,641.09	1,125,961.40	16,194.33

注：本基金的活期银行存款由基金托管人兴业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688783	西安奕材	2025-10-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	8.62	57.42	9,449.00	81,450.38	542,561.58	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	114.28	676.94	689.00	78,738.92	466,411.66	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	6 个月以上	新股锁定流通	104.66	768.89	533.00	55,783.78	409,818.37	-

				受限						
688765	禾元生物	2025-10-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.06	48.56	3,805.00	110,573.30	184,770.80	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.11	10.11	5,966.00	60,316.26	60,316.26	-
688781	视涯科技	2026-03-18	6 个月以上	新股锁定流通受限	22.68	42.16	996.00	22,589.28	41,991.36	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.56	468.67	69.00	3,074.64	32,338.23	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	17.52	35.92	742.00	12,999.84	26,652.64	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月内(含)	网下中签流通受限	10.11	10.11	2,556.00	25,841.16	25,841.16	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.28	172.09	79.00	2,076.12	13,595.11	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月以上	新股锁定流通受限	21.93	77.78	144.00	3,157.92	11,200.32	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月以上	新股锁定流通受限	58.00	112.16	48.00	2,784.00	5,383.68	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月以上	新股锁定流通受限	55.95	57.10	71.00	3,972.45	4,054.10	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	17.59	187.00	2,090.66	3,289.33	-

001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月以上	新股锁定流通受限	28.00	27.78	52.00	1,456.00	1,444.56	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月以上	新股锁定流通受限	37.88	34.87	34.00	1,287.92	1,185.58	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项停牌	879.53	2026-07-13	890.99	513.00	201,811.03	451,198.89	-

注：本基金截至 2026 年 06 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

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

本基金为混合型基金，其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资及债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这

些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是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。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地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的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.01%(2025 年 12 月 31 日：0.01%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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 2026 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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，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。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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、债券投资、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,206,734.03	-	-	-	1,206,734.03
结算备付金	658,042.13	-	-	-	658,042.13
存出保证金	89,154.15	-	-	-	89,154.15
交易性金融资产	9,863,899.89	-	23,400.00	174,351,335.06	184,238,634.95
应收申购款	-	-	-	597.45	597.45
其他资产	-	-	-	225.00	225.00
资产总计	11,817,830.20	-	23,400.00	174,352,157.51	186,193,387.71
负债					
应付清算款	-	-	-	247.68	247.68
应付赎回款	-	-	-	297,561.66	297,561.66
应付管理人报酬	-	-	-	73,481.17	73,481.17

应付托管费	-	-	-	14,696.22	14,696.22
应付销售服务费	-	-	-	8,974.90	8,974.90
应交税费	-	-	-	298.84	298.84
其他负债	-	-	-	115,423.55	115,423.55
负债总计	-	-	-	510,684.02	510,684.02
利率敏感度缺口	11,817,830.20	-	23,400.00	173,841,473.49	185,682,703.69
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	40,860,317.09	-	-	-	40,860,317.09
结算备付金	30,852.89	-	-	-	30,852.89
存出保证金	30,502.41	-	-	-	30,502.41
交易性金融资产	7,676,732.93	-	25,686.06	160,425,735.52	168,128,154.51
应收申购款	-	-	-	2,866.24	2,866.24
其他资产	-	-	-	225.00	225.00
资产总计	48,598,405.32	-	25,686.06	160,428,826.76	209,052,918.14
负债					
应付清算款	-	-	-	29,605,442.96	29,605,442.96
应付赎回款	-	-	-	4,260.96	4,260.96
应付管理人报酬	-	-	-	75,595.18	75,595.18
应付托管费	-	-	-	15,119.04	15,119.04
应付销售服务费	-	-	-	9,756.93	9,756.93
其他负债	-	-	-	100,260.02	100,260.02
负债总计	-	-	-	29,810,435.09	29,810,435.09
利率敏感度缺口	48,598,405.32	-	25,686.06	130,618,391.67	179,242,483.05

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并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

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-	-
	市场利率下降 25 个基点	-	-

注：于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 5.32%（2025 年 12 月 31 日：4.30%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日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对基金进行风险度量，及时可靠地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		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		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	174,351,335.06	93.90	160,425,735.52	89.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

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	174,351,335.06	93.90	160,425,735.52	89.50

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 112,469,196.65	增加约 24,485,529.64
	业绩比较基准下降 5%	减少约 112,469,196.65	减少约 24,485,529.64

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	172,092,681.43	158,195,325.63
第二层次	10,401,256.20	8,759,177.43
第三层次	1,744,697.32	1,173,651.45
合计	184,238,634.95	168,128,154.51

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，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,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据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,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日:同)。

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	174,351,335.06	93.64
	其中:股票	174,351,335.06	93.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	9,887,299.89	5.31
	其中:债券	9,887,299.89	5.31
	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	1,864,776.16	1.00
8	其他各项资产	89,976.60	0.05

9	合计	186,193,387.71	100.00
---	----	----------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	580,104.00	0.31
B	采矿业	7,419,837.00	4.00
C	制造业	122,014,726.68	65.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,195,316.42	1.72
E	建筑业	2,190,623.00	1.18
F	批发和零售业	883,575.00	0.48
G	交通运输、仓储和邮政业	3,706,599.56	2.00
H	住宿和餐饮业	112,490.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,814,180.42	5.82
J	金融业	17,938,032.00	9.66
K	房地产业	758,445.00	0.41
L	租赁和商务服务业	1,204,506.60	0.65
M	科学研究和技术服务业	2,220,064.18	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	355,251.20	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	346,892.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	211,090.00	0.11
S	综合	399,602.00	0.22
	合计	174,351,335.06	93.90

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	5,100	6,477,000.00	3.49
2	300750	宁德时代	13,840	5,439,258.40	2.93
3	300502	新易盛	7,248	4,399,536.00	2.37

4	600519	贵州茅台	3,300	3,912,117.00	2.11
5	601318	中国平安	61,400	2,931,236.00	1.58
6	688256	寒武纪	1,669	2,662,972.95	1.43
7	600036	招商银行	72,500	2,573,750.00	1.39
8	603986	兆易创新	2,900	2,363,500.00	1.27
9	601899	紫金矿业	87,000	2,187,180.00	1.18
10	000333	美的集团	27,700	2,092,181.00	1.13
11	688041	海光信息	5,140	1,903,342.00	1.03
12	002475	立讯精密	26,700	1,879,680.00	1.01
13	002371	北方华创	2,080	1,839,884.80	0.99
14	603259	药明康德	14,600	1,817,846.00	0.98
15	002384	东山精密	6,200	1,626,570.00	0.88
16	600030	中信证券	54,500	1,565,785.00	0.84
17	600276	恒瑞医药	29,000	1,509,160.00	0.81
18	601838	成都银行	82,900	1,467,330.00	0.79
19	300059	东方财富	69,700	1,420,486.00	0.77
20	000725	京东方 A	160,200	1,390,536.00	0.75
21	688012	中微公司	2,874	1,346,469.00	0.73
22	688008	澜起科技	4,344	1,346,205.60	0.73
23	600900	长江电力	50,000	1,323,500.00	0.71
24	601398	工商银行	185,200	1,309,364.00	0.71
25	300408	三环集团	7,800	1,301,820.00	0.70
26	688981	中芯国际	8,165	1,296,765.30	0.70
27	600487	亨通光电	11,700	1,279,278.00	0.69
28	600183	生益科技	7,000	1,213,800.00	0.65
29	300476	胜宏科技	3,500	1,212,505.00	0.65
30	002594	比亚迪	14,500	1,155,650.00	0.62
31	002463	沪电股份	7,100	1,084,880.00	0.58
32	601211	国泰海通	58,900	1,071,980.00	0.58
33	600522	中天科技	17,600	1,067,968.00	0.58
34	300274	阳光电源	6,300	1,001,826.00	0.54
35	601288	农业银行	161,300	979,091.00	0.53
36	000651	格力电器	25,900	971,250.00	0.52
37	600176	中国巨石	13,300	969,304.00	0.52
38	601328	交通银行	150,500	967,715.00	0.52
39	688521	芯原股份	2,595	963,108.30	0.52
40	300394	天孚通信	3,052	923,779.36	0.50
41	600584	长电科技	8,800	911,240.00	0.49
42	600150	中国船舶	26,148	883,540.92	0.48
43	000858	五 粮 液	11,500	851,000.00	0.46
44	601088	中国神华	21,700	847,168.00	0.46
45	000063	中兴通讯	22,600	817,894.00	0.44
46	002916	深南电路	1,770	810,483.00	0.44
47	600160	巨化股份	15,200	805,752.00	0.43

48	600309	万华化学	11,500	786,715.00	0.42
49	603019	中科曙光	7,300	782,779.00	0.42
50	002415	海康威视	21,700	742,140.00	0.40
51	600111	北方稀土	15,200	730,360.00	0.39
52	601816	京沪高铁	161,100	729,783.00	0.39
53	000338	潍柴动力	26,300	716,675.00	0.39
54	300136	信维通信	5,800	691,650.00	0.37
55	000001	平安银行	68,200	685,410.00	0.37
56	000988	华工科技	3,700	683,057.00	0.37
57	600089	特变电工	29,800	670,500.00	0.36
58	300124	汇川技术	10,100	669,933.00	0.36
59	000100	TCL 科技	114,200	664,644.00	0.36
60	603993	洛阳钼业	36,500	640,575.00	0.34
61	600031	三一重工	36,520	631,065.60	0.34
62	300433	蓝思科技	11,700	627,822.00	0.34
63	600887	伊利股份	25,200	603,792.00	0.33
64	688783	西安奕材	10,157	586,400.94	0.32
65	002050	三花智控	13,000	569,790.00	0.31
66	000792	盐湖股份	18,300	552,477.00	0.30
67	002230	科大讯飞	13,500	551,340.00	0.30
68	002353	杰瑞股份	3,600	549,000.00	0.30
69	600549	厦门钨业	6,400	545,280.00	0.29
70	002714	牧原股份	15,200	531,848.00	0.29
71	601857	中国石油	60,800	527,744.00	0.28
72	000425	徐工机械	65,100	526,659.00	0.28
73	002008	大族激光	3,500	525,385.00	0.28
74	300604	长川科技	1,500	512,130.00	0.28
75	600660	福耀玻璃	10,100	509,444.00	0.27
76	300014	亿纬锂能	7,800	507,234.00	0.27
77	601988	中国银行	88,400	505,648.00	0.27
78	600406	国电南瑞	21,800	498,130.00	0.27
79	002409	雅克科技	2,200	493,900.00	0.27
80	601668	中国建筑	113,800	493,892.00	0.27
81	601225	陕西煤业	24,200	492,470.00	0.27
82	300760	迈瑞医疗	3,600	488,988.00	0.26
83	002281	光迅科技	1,900	488,186.00	0.26
84	002156	通富微电	6,400	485,568.00	0.26
85	688777	中控技术	4,060	477,050.00	0.26
86	300285	国瓷材料	4,600	474,628.00	0.26
87	300223	北京君正	1,900	472,910.00	0.25
88	002436	兴森科技	9,200	468,740.00	0.25
89	601919	中远海控	35,300	468,078.00	0.25
90	688795	摩尔线程	689	466,411.66	0.25
91	600000	浦发银行	53,200	458,052.00	0.25

92	688072	拓荆科技	513	451,198.89	0.24
93	600941	中国移动	5,200	447,876.00	0.24
94	002709	天赐材料	8,700	447,441.00	0.24
95	300567	精测电子	1,400	444,640.00	0.24
96	601012	隆基绿能	33,300	436,896.00	0.24
97	002028	思源电气	2,500	432,500.00	0.23
98	601728	中国电信	82,700	429,213.00	0.23
99	603501	豪威集团	4,500	426,825.00	0.23
100	300054	鼎龙股份	4,000	423,880.00	0.23
101	002851	麦格米特	2,500	417,950.00	0.23
102	600460	士兰微	7,600	415,416.00	0.22
103	601985	中国核电	45,900	414,477.00	0.22
104	000977	浪潮信息	5,900	413,000.00	0.22
105	688802	沐曦股份	533	409,818.37	0.22
106	601601	中国太保	14,200	404,984.00	0.22
107	300395	菲利华	3,000	401,190.00	0.22
108	600673	东阳光	11,900	399,602.00	0.22
109	002460	赣锋锂业	6,100	398,940.00	0.21
110	600028	中国石化	87,500	390,250.00	0.21
111	688271	联影医疗	3,807	385,382.61	0.21
112	300442	润泽科技	4,600	382,122.00	0.21
113	300033	同花顺	1,580	380,780.00	0.21
114	300346	南大光电	4,100	379,865.00	0.20
115	002185	华天科技	17,000	379,270.00	0.20
116	601100	恒立液压	3,500	376,460.00	0.20
117	002466	天齐锂业	6,100	374,052.00	0.20
118	300390	天华新能	4,000	374,040.00	0.20
119	688396	华润微	3,828	373,421.40	0.20
120	002179	中航光电	8,000	369,600.00	0.20
121	002938	鹏鼎控股	3,500	368,830.00	0.20
122	601766	中国中车	70,900	368,680.00	0.20
123	601628	中国人寿	10,200	360,570.00	0.19
124	002241	歌尔股份	15,900	358,227.00	0.19
125	000408	藏格矿业	5,100	353,532.00	0.19
126	000568	泸州老窖	4,500	348,840.00	0.19
127	601600	中国铝业	42,300	347,706.00	0.19
128	600050	中国联通	84,400	337,600.00	0.18
129	600690	海尔智家	16,500	336,765.00	0.18
130	002138	顺络电子	4,600	336,260.00	0.18
131	600989	宝丰能源	16,100	327,313.00	0.18
132	688002	睿创微纳	2,111	326,550.59	0.18
133	688213	思特威	3,036	325,064.52	0.18
134	300037	新宙邦	3,500	324,975.00	0.18
135	603799	华友钴业	6,700	323,342.00	0.17

136	600489	中金黄金	17,900	323,095.00	0.17
137	002352	顺丰控股	10,100	315,726.00	0.17
138	002837	英维克	3,920	311,875.20	0.17
139	603288	海天味业	9,400	311,704.00	0.17
140	601006	大秦铁路	67,400	310,714.00	0.17
141	002049	紫光国微	3,500	310,625.00	0.17
142	000938	紫光股份	10,700	308,802.00	0.17
143	601127	赛力斯	5,000	306,250.00	0.16
144	000630	铜陵有色	48,100	305,916.00	0.16
145	688126	沪硅产业	7,661	305,597.29	0.16
146	600118	中国卫星	3,700	303,585.00	0.16
147	600879	航天电子	14,200	302,318.00	0.16
148	600905	三峡能源	81,200	301,252.00	0.16
149	600893	航发动力	7,800	299,052.00	0.16
150	688120	华海清科	921	296,727.78	0.16
151	300661	圣邦股份	2,030	291,264.40	0.16
152	600019	宝钢股份	52,900	287,247.00	0.15
153	688266	泽璟制药	2,461	287,100.26	0.15
154	600498	烽火通信	3,900	287,040.00	0.15
155	600362	江西铜业	6,600	285,780.00	0.15
156	601658	邮储银行	57,700	284,461.00	0.15
157	300058	蓝色光标	20,660	284,281.60	0.15
158	002202	金风科技	11,800	282,020.00	0.15
159	002027	分众传媒	58,200	281,688.00	0.15
160	600938	中国海油	10,300	279,645.00	0.15
161	002625	光启技术	9,200	278,944.00	0.15
162	002821	凯莱英	1,700	275,400.00	0.15
163	000807	云铝股份	12,400	274,536.00	0.15
164	000426	兴业银锡	8,300	273,568.00	0.15
165	000960	锡业股份	6,400	273,216.00	0.15
166	688111	金山办公	1,279	272,490.95	0.15
167	002407	多氟多	5,400	271,242.00	0.15
168	600418	江淮汽车	10,200	263,466.00	0.14
169	600885	宏发股份	7,600	262,124.00	0.14
170	002422	科伦药业	6,800	261,936.00	0.14
171	605589	圣泉集团	4,100	260,637.00	0.14
172	300450	先导智能	6,400	260,608.00	0.14
173	600104	上汽集团	26,600	259,616.00	0.14
174	601689	拓普集团	4,600	259,532.00	0.14
175	600141	兴发集团	5,400	253,638.00	0.14
176	605117	德业股份	2,376	252,283.68	0.14
177	600346	恒力石化	14,200	251,482.00	0.14
178	000538	云南白药	5,300	251,061.00	0.14
179	600426	华鲁恒升	10,400	248,768.00	0.13

180	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.13
181	002001	新 和 成	8,700	247,254.00	0.13
182	002648	卫星化学	10,400	244,296.00	0.13
183	002738	中矿资源	4,100	241,859.00	0.13
184	300438	鹏辉能源	2,900	240,265.00	0.13
185	600010	宝钢股份	107,300	239,279.00	0.13
186	002273	水晶光电	6,700	237,716.00	0.13
187	600667	太极实业	8,100	236,358.00	0.13
188	002812	恩捷股份	3,500	234,185.00	0.13
189	600580	卧龙电驱	7,000	231,700.00	0.12
190	600988	赤峰黄金	8,800	231,616.00	0.12
191	600585	海螺水泥	13,600	230,520.00	0.12
192	601727	上海电气	32,800	229,600.00	0.12
193	688122	西部超导	3,638	228,502.78	0.12
194	000831	中国稀土	4,100	227,509.00	0.12
195	600795	国电电力	48,500	226,495.00	0.12
196	300751	迈为股份	800	225,968.00	0.12
197	601888	中国中免	4,200	225,582.00	0.12
198	601168	西部矿业	8,300	225,262.00	0.12
199	601390	中国中铁	53,600	223,512.00	0.12
200	002129	TCL 中环	18,300	219,966.00	0.12
201	605499	东鹏饮料	1,770	218,471.10	0.12
202	600482	中国动力	6,600	216,480.00	0.12
203	600547	山东黄金	9,300	214,737.00	0.12
204	000933	神火股份	10,100	214,120.00	0.12
205	601669	中国电建	45,400	213,380.00	0.11
206	600438	通威股份	17,600	213,136.00	0.11
207	600096	云天化	7,000	212,800.00	0.11
208	002195	岩山科技	32,400	211,896.00	0.11
209	300316	晶盛机电	3,500	211,400.00	0.11
210	000625	长安汽车	29,300	210,081.00	0.11
211	600011	华能国际	27,600	209,484.00	0.11
212	600066	宇通客车	7,800	209,118.00	0.11
213	300015	爱尔眼科	25,300	208,978.00	0.11
214	601233	桐昆股份	9,600	207,840.00	0.11
215	600760	中航沈飞	5,000	205,500.00	0.11
216	300339	润和软件	5,300	204,103.00	0.11
217	000066	中国长城	10,700	203,835.00	0.11
218	600048	保利发展	43,900	203,257.00	0.11
219	601360	三六零	23,200	201,608.00	0.11
220	600352	浙江龙盛	16,600	201,026.00	0.11
221	688765	禾元生物	4,090	199,305.80	0.11
222	600143	金发科技	12,900	199,305.00	0.11
223	002340	格林美	30,100	198,961.00	0.11

224	601868	中国能建	74,300	198,381.00	0.11
225	600392	盛和资源	6,600	196,482.00	0.11
226	002236	大华股份	11,700	192,933.00	0.10
227	002074	国轩高科	7,000	192,570.00	0.10
228	600563	法拉电子	1,000	190,800.00	0.10
229	601872	招商轮船	10,800	189,756.00	0.10
230	300418	昆仑万维	4,700	189,692.00	0.10
231	600233	圆通速递	12,000	189,000.00	0.10
232	000157	中联重科	27,100	188,887.00	0.10
233	600115	中国东航	49,100	187,071.00	0.10
234	600497	驰宏锌锗	15,400	186,494.00	0.10
235	600570	恒生电子	8,800	186,472.00	0.10
236	300782	卓胜微	1,700	186,286.00	0.10
237	603650	彤程新材	1,900	186,162.00	0.10
238	600436	片仔癀	1,700	185,776.00	0.10
239	300001	特锐德	4,900	185,367.00	0.10
240	002128	电投能源	8,000	184,960.00	0.10
241	300017	网宿科技	14,200	184,742.00	0.10
242	601179	中国西电	12,300	183,516.00	0.10
243	300803	指南针	2,000	183,340.00	0.10
244	002245	蔚蓝锂芯	9,720	181,861.20	0.10
245	300496	中科创达	2,900	179,191.00	0.10
246	300088	长信科技	15,400	178,640.00	0.10
247	300759	康龙化成	6,100	176,473.00	0.10
248	002558	巨人网络	6,400	176,384.00	0.09
249	002493	荣盛石化	16,400	176,300.00	0.09
250	600009	上海机场	7,600	175,560.00	0.09
251	300207	欣旺达	9,200	174,708.00	0.09
252	301358	湖南裕能	2,300	174,501.00	0.09
253	600674	川投能源	12,300	174,291.00	0.09
254	002131	利欧股份	36,500	173,375.00	0.09
255	600886	国投电力	13,000	173,030.00	0.09
256	688099	晶晨股份	1,671	171,945.90	0.09
257	603979	金诚信	2,900	171,187.00	0.09
258	002472	双环传动	4,100	170,191.00	0.09
259	000768	中航西飞	8,300	169,984.00	0.09
260	601058	赛轮轮胎	14,700	169,491.00	0.09
261	601117	中国化学	23,000	169,050.00	0.09
262	688578	艾力斯	1,537	167,840.40	0.09
263	603659	璞泰来	5,800	167,794.00	0.09
264	002025	航天电器	2,200	167,684.00	0.09
265	000301	东方盛虹	14,600	167,170.00	0.09
266	600415	小商品城	16,400	166,624.00	0.09
267	002601	龙佰集团	10,100	166,448.00	0.09

268	601877	正泰电器	6,600	165,462.00	0.09
269	603087	甘李药业	2,900	164,604.00	0.09
270	000733	振华科技	2,900	164,256.00	0.09
271	002517	恺英网络	10,100	164,125.00	0.09
272	601186	中国铁建	27,300	162,435.00	0.09
273	600029	南方航空	31,100	161,098.00	0.09
274	002456	欧菲光	17,000	160,820.00	0.09
275	003816	中国广核	40,600	158,746.00	0.09
276	002155	湖南黄金	6,600	157,542.00	0.08
277	600196	复星医药	7,000	157,290.00	0.08
278	002465	海格通信	12,300	157,071.00	0.08
279	600219	南山铝业	39,100	156,009.00	0.08
280	002432	九安医疗	2,200	155,496.00	0.08
281	688065	凯赛生物	3,247	155,368.95	0.08
282	601021	春秋航空	3,400	154,972.00	0.08
283	000423	东阿阿胶	3,400	154,224.00	0.08
284	600372	中航机载	14,200	154,070.00	0.08
285	601799	星宇股份	1,700	154,054.00	0.08
286	600839	四川长虹	22,000	153,560.00	0.08
287	603129	春风动力	600	153,480.00	0.08
288	000661	长春高新	2,300	153,180.00	0.08
289	301236	软通动力	3,600	152,820.00	0.08
290	002130	沃尔核材	8,000	151,680.00	0.08
291	002555	三七互娱	8,000	150,960.00	0.08
292	688047	龙芯中科	965	149,256.55	0.08
293	000963	华东医药	5,300	149,036.00	0.08
294	600741	华域汽车	9,500	147,440.00	0.08
295	300568	星源材质	7,800	146,016.00	0.08
296	000547	航天发展	7,500	143,625.00	0.08
297	300558	贝达药业	2,200	143,154.00	0.08
298	002444	巨星科技	4,600	143,060.00	0.08
299	002497	雅化集团	7,000	142,590.00	0.08
300	002595	豪迈科技	3,050	142,130.00	0.08
301	002532	天山铝业	13,200	141,636.00	0.08
302	300024	机器人	7,300	141,109.00	0.08
303	603260	合盛硅业	2,900	139,954.00	0.08
304	300073	当升科技	2,900	139,316.00	0.08
305	002920	德赛西威	1,700	138,550.00	0.07
306	600699	均胜电子	6,400	138,304.00	0.07
307	300012	华测检测	9,900	137,214.00	0.07
308	600256	广汇能源	27,700	136,838.00	0.07
309	001979	招商蛇口	21,200	136,316.00	0.07
310	000975	山金国际	8,000	136,000.00	0.07
311	300142	沃森生物	10,400	135,096.00	0.07

312	300083	创世纪	9,900	134,838.00	0.07
313	002414	高德红外	10,100	133,926.00	0.07
314	000878	云南铜业	8,400	133,392.00	0.07
315	300474	景嘉微	2,200	133,056.00	0.07
316	601615	明阳智能	11,300	130,741.00	0.07
317	601111	中国国航	21,500	130,075.00	0.07
318	601677	明泰铝业	7,800	129,480.00	0.07
319	002271	东方雨虹	10,900	129,383.00	0.07
320	688017	绿的谐波	309	129,118.74	0.07
321	002252	上海莱士	29,300	127,162.00	0.07
322	300919	中伟新材	2,900	126,875.00	0.07
323	600895	张江高科	3,400	126,650.00	0.07
324	300748	金力永磁	4,100	126,485.00	0.07
325	002078	太阳纸业	10,100	126,149.00	0.07
326	300866	安克创新	1,200	125,400.00	0.07
327	601633	长城汽车	8,300	125,247.00	0.07
328	600039	四川路桥	16,000	125,120.00	0.07
329	300454	深信服	1,300	125,060.00	0.07
330	688036	传音控股	2,109	124,325.55	0.07
331	600588	用友网络	13,500	123,930.00	0.07
332	688180	君实生物	3,662	123,848.84	0.07
333	601319	中国人保	18,200	123,032.00	0.07
334	600499	科达制造	8,800	121,440.00	0.07
335	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.07
336	300724	捷佳伟创	1,700	120,020.00	0.06
337	688235	百济神州	470	119,666.70	0.06
338	300628	亿联网络	3,500	118,370.00	0.06
339	688223	晶科能源	24,731	117,472.25	0.06
340	603806	福斯特	6,972	117,059.88	0.06
341	002294	信立泰	3,600	114,804.00	0.06
342	603605	珀莱雅	1,900	113,848.00	0.06
343	000623	吉林敖东	6,400	113,472.00	0.06
344	002756	永兴材料	2,000	113,280.00	0.06
345	601800	中国交建	19,800	113,058.00	0.06
346	002459	晶澳科技	13,900	112,590.00	0.06
347	600637	东方明珠	13,500	112,185.00	0.06
348	603596	伯特利	4,516	112,177.44	0.06
349	600486	扬农化工	2,200	111,540.00	0.06
350	000617	中油资本	16,900	111,371.00	0.06
351	000519	中兵红箭	5,200	109,564.00	0.06
352	600085	同仁堂	4,700	108,617.00	0.06
353	300763	锦浪科技	1,200	108,420.00	0.06
354	300383	光环新网	8,700	108,228.00	0.06
355	001965	招商公路	11,700	107,172.00	0.06

356	002064	华峰化学	11,200	106,288.00	0.06
357	002223	鱼跃医疗	4,100	105,206.00	0.06
358	688166	博瑞医药	2,959	103,594.59	0.06
359	300573	兴齐眼药	2,501	101,940.76	0.05
360	000830	鲁西化工	8,400	100,800.00	0.05
361	002841	视源股份	2,900	100,137.00	0.05
362	000400	许继电气	4,600	99,820.00	0.05
363	002180	奔图科技	6,100	99,796.00	0.05
364	300627	华测导航	3,500	99,400.00	0.05
365	603568	伟明环保	6,440	99,047.20	0.05
366	002318	久立特材	4,100	97,990.00	0.05
367	601216	君正集团	21,800	97,228.00	0.05
368	600177	雅戈尔	12,900	97,137.00	0.05
369	000738	航发控制	5,300	96,937.00	0.05
370	600026	中远海能	5,400	96,876.00	0.05
371	002085	万丰奥威	8,700	96,483.00	0.05
372	603606	东方电缆	2,320	96,303.20	0.05
373	600323	瀚蓝环境	3,500	96,110.00	0.05
374	300002	神州泰岳	12,300	96,063.00	0.05
375	600316	洪都航空	3,400	94,996.00	0.05
376	300003	乐普医疗	8,000	94,800.00	0.05
377	600862	中航高科	5,200	93,756.00	0.05
378	302132	中航成飞	1,600	93,312.00	0.05
379	002065	东华软件	13,000	92,820.00	0.05
380	600515	海南机场	33,800	92,612.00	0.05
381	601618	中国中冶	37,900	92,476.00	0.05
382	300832	新产业	2,200	92,400.00	0.05
383	688599	天合光能	6,528	92,175.36	0.05
384	000932	华菱钢铁	26,000	90,220.00	0.05
385	002176	江特电机	9,000	90,090.00	0.05
386	688472	阿特斯	8,322	90,044.04	0.05
387	002405	四维图新	13,900	89,933.00	0.05
388	601607	上海医药	5,800	89,320.00	0.05
389	300251	光线传媒	8,000	88,720.00	0.05
390	600845	宝信软件	5,300	88,139.00	0.05
391	002603	以岭药业	5,800	87,000.00	0.05
392	002624	完美世界	7,000	86,940.00	0.05
393	000629	钒钛股份	25,900	86,506.00	0.05
394	001248	华润新能源	8,522	86,157.42	0.05
395	300699	光威复材	3,000	85,950.00	0.05
396	600704	物产中大	18,200	85,904.00	0.05
397	000708	中信特钢	6,800	85,816.00	0.05
398	002007	华兰生物	7,000	85,330.00	0.05
399	000887	中鼎股份	4,700	84,083.00	0.05

400	600521	华海药业	5,800	83,520.00	0.04
401	000786	北新建材	4,600	83,214.00	0.04
402	600765	中航重机	6,400	82,688.00	0.04
403	600332	白云山	4,100	82,164.00	0.04
404	300122	智飞生物	7,000	81,830.00	0.04
405	002389	航天彩虹	4,600	81,742.00	0.04
406	600018	上港集团	17,200	81,184.00	0.04
407	600161	天坛生物	7,000	81,060.00	0.04
408	600335	国机汽车	17,300	80,964.00	0.04
409	300253	卫宁健康	11,800	79,414.00	0.04
410	601000	唐山港	19,100	79,265.00	0.04
411	000967	盈峰环境	7,500	78,975.00	0.04
412	603077	和邦生物	34,000	78,880.00	0.04
413	002410	广联达	9,600	78,336.00	0.04
414	603392	万泰生物	2,900	78,213.00	0.04
415	002266	浙富控股	15,400	77,924.00	0.04
416	688009	中国通号	16,269	77,440.44	0.04
417	600398	海澜之家	14,700	76,881.00	0.04
418	600529	山东药玻	4,100	75,645.00	0.04
419	600511	国药股份	2,900	75,516.00	0.04
420	600763	通策医疗	2,200	74,536.00	0.04
421	000039	中集集团	9,100	73,801.00	0.04
422	603939	益丰药房	4,100	73,718.00	0.04
423	600208	衢州发展	26,000	73,580.00	0.04
424	600153	建发股份	9,200	72,956.00	0.04
425	600998	九州通	15,400	72,226.00	0.04
426	300118	东方日升	5,800	72,210.00	0.04
427	600166	福田汽车	24,700	71,877.00	0.04
428	002152	广电运通	7,500	70,350.00	0.04
429	600535	天士力	5,300	70,119.00	0.04
430	002739	儒意电影	7,300	70,080.00	0.04
431	300896	爱美客	800	69,760.00	0.04
432	688617	惠泰医疗	383	69,537.48	0.04
433	002312	川发龙蟒	7,500	68,775.00	0.04
434	688303	大全能源	3,938	68,639.34	0.04
435	601238	广汽集团	13,500	68,580.00	0.04
436	000683	博源化工	11,900	68,544.00	0.04
437	600820	隧道股份	13,000	67,730.00	0.04
438	688169	石头科技	707	67,143.79	0.04
439	600516	方大炭素	10,800	66,636.00	0.04
440	300676	华大基因	1,900	66,614.00	0.04
441	002145	钛能化学	14,100	66,411.00	0.04
442	000999	华润三九	2,950	66,345.50	0.04
443	600803	新奥股份	4,100	64,780.00	0.03

444	601018	宁波港	20,200	63,630.00	0.03
445	002044	美年健康	12,600	63,378.00	0.03
446	600008	首创环保	23,200	63,104.00	0.03
447	002120	韵达股份	9,900	62,964.00	0.03
448	000032	深桑达 A	2,500	62,375.00	0.03
449	600816	建元信托	25,400	61,976.00	0.03
450	601880	辽港股份	44,500	61,410.00	0.03
451	601567	三星电气	4,100	61,254.00	0.03
452	600754	锦江酒店	3,400	61,166.00	0.03
453	300457	赢合科技	2,900	61,132.00	0.03
454	603816	顾家家居	2,700	60,372.00	0.03
455	300413	芒果超媒	4,100	59,983.00	0.03
456	600867	通化东宝	7,300	58,692.00	0.03
457	300459	汤姆猫	17,000	57,630.00	0.03
458	600004	白云机场	7,800	56,628.00	0.03
459	688506	百利天恒	191	56,159.73	0.03
460	600038	中直股份	2,200	55,638.00	0.03
461	601966	玲珑轮胎	5,300	54,007.00	0.03
462	300529	健帆生物	3,500	53,900.00	0.03
463	600655	豫园股份	13,000	53,430.00	0.03
464	300601	康泰生物	4,700	53,298.00	0.03
465	002544	普天科技	2,900	52,838.00	0.03
466	300144	宋城演艺	9,000	52,290.00	0.03
467	600258	首旅酒店	4,700	51,324.00	0.03
468	603833	欧派家居	1,700	51,187.00	0.03
469	603486	科沃斯	1,000	50,750.00	0.03
470	002244	滨江集团	6,400	48,640.00	0.03
471	000009	中国宝安	7,800	48,594.00	0.03
472	000998	隆平高科	6,400	48,256.00	0.03
473	601866	中远海发	21,800	48,178.00	0.03
474	688608	恒玄科技	285	47,649.15	0.03
475	603899	晨光股份	2,300	47,449.00	0.03
476	002091	江苏国泰	6,400	46,272.00	0.02
477	300070	碧水源	14,100	44,979.00	0.02
478	688390	固德威	400	43,404.00	0.02
479	600864	哈投股份	8,300	43,077.00	0.02
480	688781	视涯科技	996	41,991.36	0.02
481	002292	奥飞娱乐	6,400	41,984.00	0.02
482	000069	华侨城 A	25,200	41,328.00	0.02
483	688063	派能科技	768	40,911.36	0.02
484	002701	奥瑞金	9,400	40,044.00	0.02
485	000035	中国天楹	7,700	37,191.00	0.02
486	688188	柏楚电子	344	36,704.80	0.02
487	600007	中国国贸	1,900	36,062.00	0.02

488	603885	吉祥航空	3,500	36,015.00	0.02
489	600859	王府井	3,900	35,802.00	0.02
490	002891	中宠股份	1,300	34,736.00	0.02
491	688809	强一股份	55	34,265.00	0.02
492	600170	上海建工	14,800	32,856.00	0.02
493	688797	臻宝科技	69	32,338.23	0.02
494	688712	北芯生命	742	26,652.64	0.01
495	688796	百奥赛图	178	19,473.20	0.01
496	688813	泰金新能	79	13,595.11	0.01
497	301687	新广益	144	11,200.32	0.01
498	001233	海安集团	132	5,900.40	0.00
499	301680	固德电材	48	5,383.68	0.00
500	300315	掌趣科技	1,300	5,070.00	0.00
501	688816	易思维	71	4,054.10	0.00
502	001369	双欣材料	298	4,028.96	0.00
503	601112	振石股份	187	3,289.33	0.00
504	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
505	001220	世盟股份	52	1,444.56	0.00
506	603284	林平发展	34	1,185.58	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	300308	中际旭创	4,351,420.00	2.43
2	300750	宁德时代	3,534,505.00	1.97
3	300502	新易盛	2,577,966.00	1.44
4	600519	贵州茅台	2,474,977.00	1.38
5	601318	中国平安	2,236,245.00	1.25
6	601899	紫金矿业	2,037,296.00	1.14
7	601211	国泰海通	1,961,170.00	1.09
8	600036	招商银行	1,635,672.00	0.91
9	000333	美的集团	1,348,028.00	0.75
10	600030	中信证券	1,257,305.00	0.70
11	688256	寒武纪	1,198,103.20	0.67
12	002475	立讯精密	1,111,641.00	0.62
13	688041	海光信息	1,033,885.91	0.58
14	002594	比亚迪	1,029,050.00	0.57
15	600276	恒瑞医药	1,000,752.00	0.56
16	601838	成都银行	996,637.00	0.56

17	002384	东山精密	984,731.00	0.55
18	600900	长江电力	909,146.00	0.51
19	603986	兆易创新	905,211.00	0.51
20	601398	工商银行	855,988.00	0.48

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	3,599,558.15	2.01
2	600519	贵州茅台	3,371,230.00	1.88
3	300308	中际旭创	2,773,737.00	1.55
4	601318	中国平安	2,460,743.52	1.37
5	601899	紫金矿业	2,392,423.00	1.33
6	601838	成都银行	1,684,056.00	0.94
7	600036	招商银行	1,589,825.00	0.89
8	600900	长江电力	1,537,055.00	0.86
9	300502	新易盛	1,434,055.00	0.80
10	000333	美的集团	1,297,196.00	0.72
11	603986	兆易创新	1,237,368.00	0.69
12	002594	比亚迪	1,175,612.00	0.66
13	688041	海光信息	1,146,484.99	0.64
14	002475	立讯精密	1,131,611.00	0.63
15	688008	澜起科技	1,055,345.94	0.59
16	300059	东方财富	1,018,686.00	0.57
17	600030	中信证券	973,314.00	0.54
18	600276	恒瑞医药	955,161.00	0.53
19	600919	江苏银行	937,175.00	0.52
20	688012	中微公司	891,733.24	0.50

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	110,553,311.26
卖出股票的收入（成交）总额	110,681,667.75

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	9,863,899.89	5.31
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	23,400.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	9,887,299.89	5.32

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	019792	25 国债 19	54,000	5,456,658.58	2.94
2	019835	26 国债 09	44,000	4,407,241.31	2.37
3	113696	伯 25 转债	180	23,400.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的情况。

7.11.3 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	89,154.15
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	597.45
6	其他应收款	225.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,976.60

7.11.4 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	113696	伯 25 转债	23,400.00	0.01

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
国泰兴益灵活配置混合 A	537	85,040.39	28,267,844.52	61.90%	17,398,845.54	38.10%
国泰兴益灵活配置混合 C	5,044	13,907.24	68,399,449.12	97.51%	1,748,669.79	2.49%
合计	5,581	20,751.62	96,667,293.64	83.47%	19,147,515.33	16.53%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	98.89%

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	国泰兴益灵活配置混合 A	0.00	0.00%
	国泰兴益灵活配置混合 C	8.38	0.00%
	合计	8.38	0.00%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	国泰兴益灵活配置混合 A	0
	国泰兴益灵活配置混合	0

本基金基金经理持有本开放式基金	C	
	合计	0
	国泰兴益灵活配置混合 A	0
	国泰兴益灵活配置混合 C	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国泰兴益灵活配置混合 A	国泰兴益灵活配置混合 C
基金合同生效日（2015 年 5 月 14 日）基金份额总额	6,867,318,490.81	-
本报告期期初基金份额总额	47,199,659.97	76,850,470.51
本报告期基金总申购份额	328,342.82	69,080,837.76
减：本报告期基金总赎回份额	1,861,312.73	75,783,189.36
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,666,690.06	70,148,118.91

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 5 月 9 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产相关的诉讼事项。

报告期内无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为立信会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

报告期内，基金管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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	
招商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	98,931,936.34	44.78%	45,103.79	44.79%	-
国泰海通	1	61,640,934.80	27.90%	28,102.71	27.90%	-
东北证券	1	60,331,648.37	27.31%	27,505.22	27.31%	-

注：1、交易单元的选择标准：

- （1）实力雄厚、信誉良好；
- （2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；
- （3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；
- （4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席

位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

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		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	9,852,236.47	58.18%	5,723,000.00	100.00%	-	-
东北证券	7,081,681.51	41.82%	-	-	-	-

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	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》	2026-03-24
2	国泰基金管理有限公司关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02
3	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2026-05-09
4	国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告	《中国证券报》	2026-06-30

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	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月	28,267,844.5	-	-	28,267,844.52	24.41%

		30 日	2				
	2	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 01 月 22 日, 2026 年 02 月 25 日至 2026 年 03 月 01 日	33,114,809.84	-	33,114,809.84	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金基金合同
- 2、国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金托管协议
- 3、关于准予国泰兴益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

二〇二六年八月三十一日