

华润元大安鑫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：华润元大基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 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	14
6.3 净资产变动表	15
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	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 盈利投资者数量占比	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
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	67
10.8 其他重大事件	69
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	70
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	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	华润元大安鑫灵活配置混合	
基金主代码	000273	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 9 月 18 日	
基金管理人	华润元大基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,471,048.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华润元大安鑫灵活配置混合 A	华润元大安鑫灵活配置混合 C
下属分级基金的交易代码	000273	007632
报告期末下属分级基金的份额总额	3,475,014.22 份	996,034.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金根据对宏观经济形势的研究,判断经济所处的经济周期阶段、景气循环状况和未来运行趋势,积极把握股票、债券等市场发展趋势,注重大类资产配置轮换特征、重点挖掘价值低洼,在适度控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、投资标的的评估以及组合风险管理全过程中。本基金为灵活配置基金,股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。首先根据宏观经济和政策预判,定性大类资产的边际变动方向。其次,参考全部 A 股整体估值(参照万得全 A 指数(除金融,石油石化)市盈率 TTM),每日追踪过去 20 年的历史情况,将 A 股历史估值区间划分成若干分位。如果估值在由低到高排列的 90 分位下方,股票仓位变动是 50%—95%;如果估值在由低到高排列的 90—100 分位,股票仓位在 0—50%。最后,根据短期上涨速度和获利水平,决定短期仓位变化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×25%+恒生指数收益率×15%。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金,属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将通过港股通渠道投资于香港证券市场,除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外,本基金还将面临汇率风险、香港市场风险等特殊投资风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华润元大基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	严莉	任航
	联系电话	0755-88399008	010-66060069
	电子邮箱	kf@cryuantafund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4000-1000-89	95599
传真		0755-88399045	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3086 号大百汇广场 32 层 03-07 单元	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3086 号大百汇广场 32 层 03-07 单元	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518026	100031
法定代表人		胡昊	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.cryuantafund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华润元大基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路 3086 号大百汇广场 32 层 03-07 单元

§ 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-2026 年 6 月 30 日)	
	华润元大安鑫灵活配置 A	华润元大安鑫灵活配置 C
本期已实现收益	1,618,997.54	-229,574.01
本期利润	1,987,645.78	-100,863.17
加权平均基金份 额本期利润	0.5209	-0.0579
本期加权平均净	25.07%	-2.86%

值利润率		
本期基金份额净值增长率	30.97%	30.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	3,458,276.60	948,809.26
期末可供分配基金份额利润	0.9952	0.9526
期末基金资产净值	9,206,149.07	2,592,152.87
期末基金份额净值	2.6492	2.6025
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	294.26%	111.93%

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（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），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

华润元大安鑫灵活配置 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	55.73%	2.40%	5.99%	0.87%	49.74%	1.53%
过去六个月	30.97%	2.39%	3.14%	0.81%	27.83%	1.58%
过去一年	58.41%	2.02%	14.52%	0.73%	43.89%	1.29%
过去三年	56.16%	1.55%	23.46%	0.81%	32.70%	0.74%
过去五年	41.63%	1.29%	-1.83%	0.84%	43.46%	0.45%
过去七年	116.61%	1.20%	20.81%	0.86%	95.80%	0.34%
过去十年	127.32%	1.16%	30.65%	0.75%	96.67%	0.41%

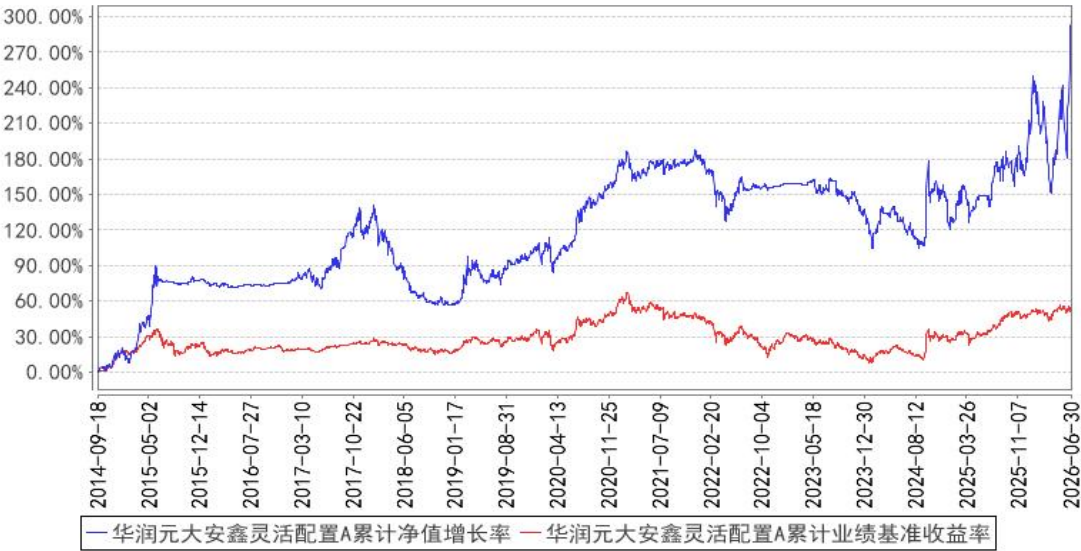
自基金合同生效起 至今	294.26%	1.15%	53.27%	0.75%	240.99 %	0.40%
----------------	---------	-------	--------	-------	-------------	-------

华润元大安鑫灵活配置 C

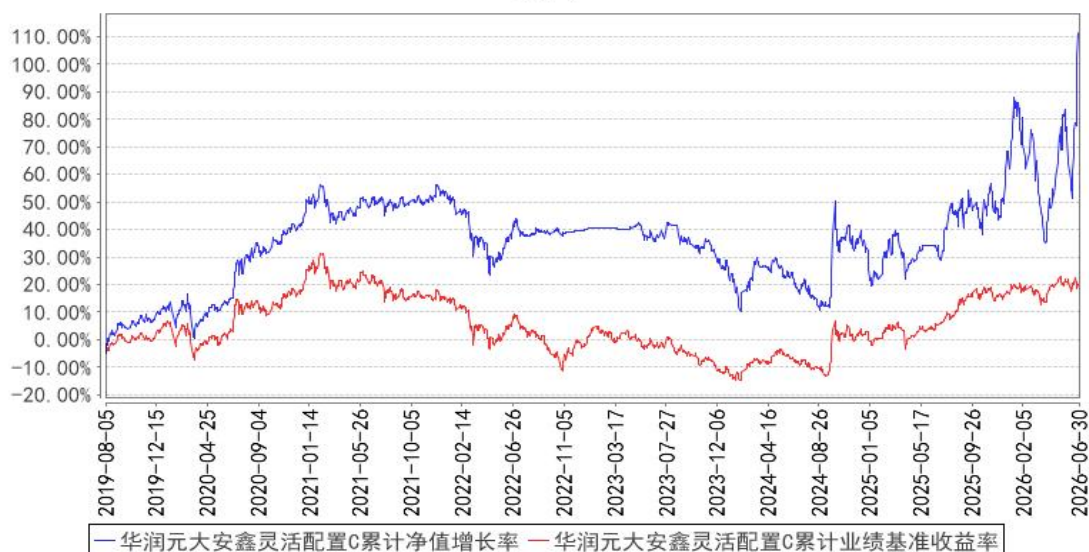
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	55.65%	2.40%	5.99%	0.87%	49.66%	1.53%
过去六个月	30.84%	2.39%	3.14%	0.81%	27.70%	1.58%
过去一年	58.09%	2.02%	14.52%	0.73%	43.57%	1.29%
过去三年	55.03%	1.55%	23.46%	0.81%	31.57%	0.74%
过去五年	39.90%	1.29%	-1.83%	0.84%	41.73%	0.45%
自基金合同生效起 至今	111.93%	1.21%	20.44%	0.86%	91.49%	0.35%

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

华润元大安鑫灵活配置A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



华润元大安鑫灵活配置C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华润元大基金管理有限公司经中国证监会证监许可【2012】1746号文批准，于2013年1月17日完成工商登记注册，总部位于深圳，注册资本6亿元人民币。公司由华润深国投信托有限公司、华润金控投资有限公司、台湾元大证券投资信托股份有限公司共同发起设立，占股比例分别为51%、24.5%、24.5%。

截至2026年6月30日，本基金管理人共管理十六只基金产品：华润元大富时中国A50指数型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金、华润元大现金收益货币市场基金、华润元大现金货币市场基金、华润元大稳健收益债券型证券投资基金、华润元大润鑫债券型证券投资基金、华润元大润泰双鑫债券型证券投资基金、华润元大润泽债券型证券投资基金、华润元大润禧39个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大润丰纯债债券型证券投资基金、华润元大润享三个月定期开放债券型证券投资基金、华润元大泓远利率债债券型证券投资基金、华润元大中债绿色普惠主题金融债券优选指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李武群	本基金基金经理	2020 年 10 月 23 日	-	17 年	曾任中信银行福州分行统计分析岗、华西证券股份有限公司研究所高级研究员和股票投资部投资经理助理；2015 年 8 月加入华润元大基金管理有限公司，现任公司权益量化部基金经理。目前担任华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、华润元大量化优选混合型证券投资基金、华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金、华润元大信息传媒科技混合型证券投资基金、华润元大核心动力混合型证券投资基金基金经理。
洪潇	本基金的基金经理	2025 年 6 月 20 日	-	1 年	曾任招商银行股份有限公司广州分行金融机构部客户经理，华润深国投信托有限公司财富管理总部资产管理部助理、经理，资产管理部权益投资经理、权益投资总监。2025 年 2 月加入华润元大基金管理有限公司，现任公司权益量化部部门负责人、基金经理。目前担任华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期内无上述兼任情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规及公司内部制度关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。基金管理人管理的所有投资组合未存在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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，我国经济呈现总量承压、结构向新的格局。上半年 GDP 同比增长 4.7%，经济运行保持在合理区间，新旧动能持续转换。内需修复节奏偏弱，服务消费表现相对亮眼，但地产投资仍处于底部区间；外需韧性较强，高端制造出口形成重要支撑。A 股在内外多重扰动下震荡加剧，行情结构性分化凸显。市场资金集中布局具备业绩兑现能力的科技成长标的，AI 算力、半导体设备成为贯穿市场的核心主线，赛道内部轮动加速，纯题材炒作持续退潮；红利类资产仅在避险窗口阶段性获得资金关注，整体表现相对平淡。

本基金根据市场环境精选优质价值公司组合，未来继续保持乐观，优选核心资产。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末华润元大安鑫灵活配置 A 基金份额净值为 2.6492 元，本报告期基金份额净值增长率为 30.97%，同期业绩基准收益率为 3.14%；华润元大安鑫灵活配置 C 基金份额净值为 2.6025 元，本报告期基金份额净值增长率为 30.84%，同期业绩基准收益率为 3.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，政策托底力度有望加大，扩内需相关举措陆续落地，新型政策性金融工具加快投放，新型基建、重大产业项目开工将逐步拉动有效投资。外部贸易保护、地缘局势持续存在不确定性，海外关税政策演变、全球流动性变化或将阶段性扰动市场风险偏好，需要持续跟踪贸易谈判进展与海外央行政策调整。关注具备订单落地验证的科技成长主线，重点布局 AI 软硬件、半导体自主可控、创新药；同时关注受益供给优化、“反内卷”产业政策的中游制造、资源板块，以及内需持续修复带来弹性的顺周期消费赛道。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立

了负责估值工作决策和执行的专门机构，组成人员包括总经理、督察长、投研分管领导、运营分管领导、合规与风险管理部负责人及基金会计负责人等。该机构成员均具备专业胜任能力和相关从业资格，精通各自领域的理论知识，熟悉相关法律法规，并具有丰富的实践经验。同时，根据基金管理公司制定的相关制度，估值工作决策机构的成员中不包括基金经理。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内，本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告本基金的解决方案。本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金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进行核查，以上内容真实、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：华润元大安鑫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	8,400,591.49	2,868,683.17
结算备付金		588,191.56	348,267.41
存出保证金		101,552.98	73,664.58
交易性金融资产	6.4.7.2	6,849,670.12	10,570,491.41
其中：股票投资		6,849,670.12	10,570,491.41
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	1,601,008.21
应收股利		-	-
应收申购款		296,658.82	487,099.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		16,236,664.97	15,949,213.81
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		3,878,716.41	2,192,718.97

应付赎回款		361,201.02	1,755,837.95
应付管理人报酬		9,886.84	8,208.38
应付托管费		1,647.78	1,368.05
应付销售服务费		420.30	219.60
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	186,490.68	132,588.33
负债合计		4,438,363.03	4,090,941.28
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	4,471,048.91	5,895,986.23
未分配利润	6.4.7.12	7,327,253.03	5,962,286.30
净资产合计		11,798,301.94	11,858,272.53
负债和净资产总计		16,236,664.97	15,949,213.81

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 4,471,048.91 份，其中华润元大安鑫灵活配置 A 基金份额净值 2.6492 元，份额总额 3,475,014.22 份；华润元大安鑫灵活配置 C 基金份额净值 2.6025 元，份额总额 996,034.69 份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大安鑫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		1,972,840.36	305,185.09
1. 利息收入		6,365.19	6,315.88
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,365.19	2,147.92
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		-	4,167.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,383,926.81	-270,307.18
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,376,127.81	-284,079.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	9,953.63
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	7,799.00	3,818.25
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	497,359.08	568,578.51
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	85,189.28	597.88
减：二、营业总支出		86,057.75	49,930.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	68,258.86	41,539.06
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,376.44	6,923.15
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,528.47	794.98
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	2,893.98	673.68
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,886,782.61	255,254.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,886,782.61	255,254.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,886,782.61	255,254.22

6.3 净资产变动表

会计主体：华润元大安鑫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	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	5,895,986.23	-	5,962,286.30	11,858,272.53
二、本期期初净资产	5,895,986.23	-	5,962,286.30	11,858,272.53
三、本期增减变	-1,424,937.32	-	1,364,966.73	-59,970.59

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	1,886,782.61	1,886,782.61
(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)	-1,424,937.32	-	-521,815.88	-1,946,753.20
其中: 1. 基金申购款	9,485,677.60	-	10,481,010.82	19,966,688.42
2. 基金赎回款	-10,910,614.92	-	-11,002,826.70	-21,913,441.62
(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	4,471,048.91	-	7,327,253.03	11,798,301.94
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	3,837,198.89	-	2,320,495.38	6,157,694.27
二、本期期初净资产	3,837,198.89	-	2,320,495.38	6,157,694.27
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	37,097.50	-	282,910.39	320,007.89
(一)、综合收益总额	-	-	255,254.22	255,254.22
(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)	37,097.50	-	27,656.17	64,753.67
其中: 1. 基金申购款	2,598,565.48	-	1,672,791.72	4,271,357.20
2. 基金赎回款	-2,561,467.98	-	-1,645,135.55	-4,206,603.53
(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	3,874,296.39	-	2,603,405.77	6,477,702.16

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：

黄震

张彦军

张彦军

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

华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系由华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后转型而来。华润元大保本混合型证券投资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[2013]872 号文予以募集注册，自 2013 年 8 月 19 日至 2013 年 9 月 6 日期间向全社会公开募集。募集有效认购总户数为 6,465 户，募集资金及其产生的利息共计 630,303,516.04 元，折合基金份额 630,303,516.04 份，于 2013 年 9 月 11 日基金合同正式生效。根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的约定，2014 年 9 月 11 日，华润元大保本混合型证券投资基金第一个保本周期到期后，未能符合保本基金存续条件，自 2014 年 9 月 18 日起变更为本基金。同时，基金的投资目标、投资范围、投资策略以及基金费率等相关内容根据《华润元大保本混合型证券投资基金基金合同》的相关约定作相应修改为《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。上述变更无须经基金份额持有人大会决议，在报中国证监会备案后，提前在临时公告或《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》中予以说明。

本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，注册登记机构为本基金管理人，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据法律法规的规定及《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的约定，经与基金托管人中国农业银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，华润元大基金管理有限公司决定自 2019 年 8 月 1 日起对华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金在现有份额的基础上增设 C 类基金份额，原基金份额

转为 A 类基金份额。A 类基金份额在投资者申购时收取申购费用，在投资者赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不计提销售服务费；C 类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用，而在赎回时根据持有期限收取赎回费，且从本类别基金资产中计提销售服务费。两类基金份额分别设置代码，并分别计算基金份额净值。在《华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效 3 个工作日以后，两类份额之间不得相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大安鑫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，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、衍生工具（权证、股指期货等）、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，其中港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者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、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×25%+恒生指数收益率×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财

务状况以及自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

本基金的主要税项列示如下：

(1) 增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、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》及财政部、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》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；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、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、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》的规定，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。对在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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计

税依据，分别按 7%、3%和 2%的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 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，暂减按 25%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。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3%调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（5）境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号《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《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》及其他境内外相

关税务法规的规定和实务操作执行。

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	8,400,591.49
等于：本金	8,400,512.34
加：应计利息	79.15
减：坏账准备	—
定期存款	—
等于：本金	—
加：应计利息	—
减：坏账准备	—
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	—
减：坏账准备	—
合计	8,400,591.49

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	6,627,984.79	—	6,849,670.12	221,685.33
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	6,627,984.79	—	6,849,670.12	221,685.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 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	233.63
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	186,257.05
其中：交易所市场	186,257.05
银行间市场	-
应付利息	-
合计	186,490.68

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大安鑫灵活配置 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,880,866.65	3,880,866.65
本期申购	2,129,479.07	2,129,479.07
本期赎回（以“-”号填列）	-2,535,331.50	-2,535,331.50
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	3,475,014.22	3,475,014.22

华润元大安鑫灵活配置 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,015,119.58	2,015,119.58
本期申购	7,356,198.53	7,356,198.53
本期赎回（以“-”号填列）	-8,375,283.42	-8,375,283.42
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	996,034.69	996,034.69

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

华润元大安鑫灵活配置 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,815,950.94	2,153,152.09	3,969,103.03
本期期初	1,815,950.94	2,153,152.09	3,969,103.03
本期利润	1,618,997.54	368,648.24	1,987,645.78
本期基金份额交易产生的变动数	23,328.12	-248,942.08	-225,613.96
其中：基金申购款	1,245,733.10	1,326,155.52	2,571,888.62
基金赎回款	-1,222,404.98	-1,575,097.60	-2,797,502.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,458,276.60	2,272,858.25	5,731,134.85

华润元大安鑫灵活配置 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	880,231.22	1,112,952.05	1,993,183.27
本期期初	880,231.22	1,112,952.05	1,993,183.27
本期利润	-229,574.01	128,710.84	-100,863.17
本期基金份额交易产生的变动数	298,152.05	-594,353.97	-296,201.92
其中：基金申购款	3,287,005.66	4,622,116.54	7,909,122.20
基金赎回款	-2,988,853.61	-5,216,470.51	-8,205,324.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	948,809.26	647,308.92	1,596,118.18

6.4.7.13 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	5,057.27
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	1,123.20
其他	184.72
合计	6,365.19

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,376,127.81
股票投资收益——赎回差价收入	—
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	1,376,127.81

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	510,003,267.92
减：卖出股票成本总额	507,864,569.74
减：交易费用	762,570.37
买卖股票差价收入	1,376,127.81

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 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	7,799.00
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	7,799.00

6.4.7.20 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	497,359.08
股票投资	497,359.08
债券投资	—
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	497,359.08

6.4.7.21 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	85,159.33
基金转换费收入	29.95
合计	85,189.28

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 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	—
信息披露费	—
证券出借违约金	—
汇款费	2,893.80
其他	0.18
合计	2,893.98

注：其他为证券组合费 0.18 元。

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报

告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华润元大基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金销售机构
华润深国投信托有限公司	基金管理人的股东
元大证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
华润金控投资有限公司	基金管理人的股东
深圳华润元大资产管理有限公司	基金管理人的子公司
广东华润银行股份有限公司（“广东华润银行”）	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售机构
国信证券股份有限公司（“国信证券”）	基金管理人控股股东的联营公司、基金销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
国信证券	113,098,500.60	11.16	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
国信证券	49,299.58	11.17	49,299.58	26.47
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
—	—	—	—	—

注：上述佣金费率由本基金的基金管理人在正常业务范围内按一般商业条款与对方签订的席位租用协议进行约定，并扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费及证券结算风险基金后的净额列示，其中债券及回购交易不计佣金。

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 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	68,258.86	41,539.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	26,197.05	11,705.31
应支付基金管理人的净管理费	42,061.81	29,833.75

注：(1) 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提，按月支付。日管理费=前一日基金资产净值×1.20%÷当年天数。

(2)根据《开放式证券投资基金销售费用管理规定》，基金管理人依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费

用，客户维护费从基金管理费中列支。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	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
当期发生的基金应支付的托管费	11,376.44	6,923.15

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，按月支付。日托管费=前一日基金资产净值×0.20%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026 年 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		
	华润元大安鑫灵活配置 A	华润元大安鑫灵活配置 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	1.65	1.65
合计	-	1.65	1.65
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华润元大安鑫灵活配置 A	华润元大安鑫灵活配置 C	合计
华润元大基金管理有限公司	-	701.37	701.37
合计	-	701.37	701.37

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日对应级别基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华润元大基金管理有限公司，再由华润元大基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.2%。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日该级别基金资产净值 × 对应销售服务费年费率 / 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

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期末及上年度末除管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	8,400,591.49	5,057.27	821,385.27	2,042.28

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行间同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

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 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事 项停牌	879.53	2026 年 7 月 13 日	890.99	758	502,509.66	666,683.74	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、监事会、董事会下设风险控制委员会，督察长、管理层下设风险管理委员会，合规与风险管理部和各业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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行中国农业银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进

行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（上年度末：未持有）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值、份额持有人集中度以及压力测试等方式防范流动性风险，并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变

现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。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资产的公允价值。除附注中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

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因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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。本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。下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	8,400,591.49	-	-	-	-	8,400,591.49
结算备付金	588,191.56	-	-	-	-	588,191.56
存出保证金	101,552.98	-	-	-	-	101,552.98
交易性金融资产	-	-	-	-	6,849,670.12	6,849,670.12
应收申购款	-	-	-	-	296,658.82	296,658.82

资产总计	9,090,336.03	—	—	—	7,146,328.94	16,236,664.97
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	361,201.02	361,201.02
应付管理人报酬	—	—	—	—	9,886.84	9,886.84
应付托管费	—	—	—	—	1,647.78	1,647.78
应付清算款	—	—	—	—	3,878,716.41	3,878,716.41
应付销售服务费	—	—	—	—	420.30	420.30
其他负债	—	—	—	—	186,490.68	186,490.68
负债总计	—	—	—	—	4,438,363.03	4,438,363.03
利率敏感度缺口	9,090,336.03	—	—	—	2,707,965.91	11,798,301.94
上年度末 2025 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	2,868,683.17	—	—	—	—	2,868,683.17
结算备付金	348,267.41	—	—	—	—	348,267.41
存出保证金	73,664.58	—	—	—	—	73,664.58
交易性金融资产	—	—	—	—	10,570,491.41	10,570,491.41
应收申购款	—	—	—	—	487,099.03	487,099.03
应收清算款	—	—	—	—	1,601,008.21	1,601,008.21
资产总计	3,290,615.16	—	—	—	12,658,598.65	15,949,213.81
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	1,755,837.95	1,755,837.95
应付管理人报酬	—	—	—	—	8,208.38	8,208.38
应付托管费	—	—	—	—	1,368.05	1,368.05
应付清算款	—	—	—	—	2,192,718.97	2,192,718.97
应付销售服务费	—	—	—	—	219.60	219.60
其他负债	—	—	—	—	132,588.33	132,588.33
负债总计	—	—	—	—	4,090,941.28	4,090,941.28

利率敏感度	3,290,615.1				8,567,657.3	11,858,272.
缺口	6	-	-	-	7	53

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响

6.4.13.4.2 外汇风险

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，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。本基金投资于基金合同和相关法律法规及监管机构允许范围内的投资品种，主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大其他价格风险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风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	6,849,670.12	58.06	10,570,491.41	89.14
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	6,849,670.12	58.06	10,570,491.41	89.14

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	513,207.23	801,500.64
	沪深 300 指数下降 5%	-513,207.23	-801,500.64

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	6,182,986.38	10,570,491.41
第二层次	666,683.74	-
第三层次	-	-
合计	6,849,670.12	10,570,491.41

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金的净资产为人民币 11,798,301.94 元，已连续超过六十个工作日净资产低于人民币五千万。本基金管理人已就上述情况按照中国证监会颁布的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，向中国证监会说明原因和报送解决方案。

§ 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	6,849,670.12	42.19
	其中：股票	6,849,670.12	42.19
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	8,988,783.05	55.36
8	其他各项资产	398,211.80	2.45
9	合计	16,236,664.97	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	4,439,432.12	37.63

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	543,030.00	4.60
J	金融业	1,406,521.00	11.92
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	460,687.00	3.90
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,849,670.12	58.06

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

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	688072	拓荆科技	758	666,683.74	5.65
2	688981	中芯国际	3,915	621,780.30	5.27
3	603650	彤程新材	5,700	558,486.00	4.73
4	301095	广立微	4,600	543,030.00	4.60
5	002290	禾盛新材	5,300	486,911.00	4.13
6	688041	海光信息	1,281	474,354.30	4.02
7	601066	中信建投	16,300	473,841.00	4.02
8	603019	中科曙光	4,400	471,812.00	4.00
9	600999	招商证券	22,300	470,530.00	3.99
10	000783	长江证券	47,400	462,150.00	3.92
11	603259	药明康德	3,700	460,687.00	3.90
12	002821	凯莱英	2,800	453,600.00	3.84
13	688047	龙芯中科	2,334	360,999.78	3.06
14	000066	中国长城	18,100	344,805.00	2.92

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	300316	晶盛机电	5,907,587.00	49.82
2	002222	福晶科技	5,456,211.50	46.01
3	603650	彤程新材	4,107,633.00	34.64
4	688256	寒武纪	4,074,086.85	34.36
5	300502	新易盛	3,797,870.00	32.03
6	688037	芯源微	3,689,162.00	31.11
7	688627	精智达	3,640,835.77	30.70
8	300395	菲利华	3,591,893.00	30.29
9	300751	迈为股份	3,502,363.00	29.54
10	688147	微导纳米	3,229,680.01	27.24
11	301380	挖金客	3,160,789.00	26.65
12	300236	上海新阳	3,149,417.00	26.56
13	688205	德科立	3,120,619.57	26.32
14	300223	北京君正	3,103,706.00	26.17
15	002156	通富微电	2,966,697.85	25.02
16	300308	中际旭创	2,897,236.00	24.43
17	300620	光库科技	2,809,204.00	23.69
18	300762	上海瀚讯	2,777,244.00	23.42
19	688652	京仪装备	2,739,992.57	23.11
20	002463	沪电股份	2,729,108.00	23.01
21	300394	天孚通信	2,698,027.40	22.75
22	300604	长川科技	2,685,627.00	22.65
23	688503	聚和材料	2,676,417.79	22.57
24	688516	奥特维	2,663,401.64	22.46
25	688361	中科飞测	2,660,321.63	22.43
26	601015	陕西黑猫	2,623,996.00	22.13
27	301183	东田微	2,610,086.00	22.01
28	002428	云南锗业	2,566,529.00	21.64
29	300058	蓝色光标	2,556,417.00	21.56
30	301529	福赛科技	2,454,395.00	20.70
31	601016	节能风电	2,448,460.00	20.65
32	688702	盛科通信	2,444,046.24	20.61
33	603533	掌阅科技	2,416,304.00	20.38
34	300548	长芯博创	2,358,054.00	19.89
35	300612	宣亚国际	2,347,795.00	19.80
36	300378	鼎捷数智	2,334,963.00	19.69
37	300065	海兰信	2,328,883.00	19.64
38	300170	汉得信息	2,320,491.00	19.57

39	688519	南亚新材	2, 285, 024. 69	19. 27
40	000792	盐湖股份	2, 279, 970. 00	19. 23
41	688343	云天励飞	2, 275, 810. 88	19. 19
42	688072	拓荆科技	2, 266, 724. 09	19. 12
43	688012	中微公司	2, 253, 554. 75	19. 00
44	300677	英科医疗	2, 248, 051. 00	18. 96
45	600176	中国巨石	2, 201, 376. 00	18. 56
46	002290	禾盛新材	2, 180, 356. 00	18. 39
47	301217	铜冠铜箔	2, 166, 334. 00	18. 27
48	603061	金海通	2, 163, 698. 00	18. 25
49	688047	龙芯中科	2, 100, 406. 07	17. 71
50	002409	雅克科技	2, 088, 676. 00	17. 61
51	300776	帝尔激光	2, 075, 976. 00	17. 51
52	002565	顺灏股份	2, 041, 337. 00	17. 21
53	688008	澜起科技	2, 010, 714. 95	16. 96
54	688313	仕佳光子	1, 980, 008. 39	16. 70
55	688630	芯碁微装	1, 974, 283. 56	16. 65
56	920368	连城数控	1, 949, 009. 49	16. 44
57	605589	圣泉集团	1, 935, 568. 00	16. 32
58	300408	三环集团	1, 914, 203. 00	16. 14
59	300540	蜀道装备	1, 913, 574. 00	16. 14
60	300442	润泽科技	1, 906, 493. 00	16. 08
61	688041	海光信息	1, 888, 992. 35	15. 93
62	601975	招商南油	1, 851, 690. 00	15. 62
63	001896	豫能控股	1, 822, 548. 00	15. 37
64	688818	C 电科	1, 822, 019. 64	15. 36
65	600259	广晟有色	1, 816, 312. 00	15. 32
66	688017	绿的谐波	1, 813, 470. 04	15. 29
67	600498	烽火通信	1, 800, 124. 00	15. 18
68	300757	罗博特科	1, 796, 793. 00	15. 15
69	688233	神工股份	1, 796, 158. 02	15. 15
70	688392	骄成超声	1, 791, 310. 69	15. 11
71	002400	省广集团	1, 767, 428. 00	14. 90
72	300953	震裕科技	1, 761, 506. 00	14. 85
73	002371	北方华创	1, 758, 520. 00	14. 83
74	002938	鹏鼎控股	1, 734, 724. 00	14. 63
75	301018	申菱环境	1, 715, 652. 00	14. 47
76	605117	德业股份	1, 707, 957. 00	14. 40
77	002916	深南电路	1, 704, 648. 00	14. 38
78	600989	宝丰能源	1, 702, 299. 00	14. 36
79	002153	石基信息	1, 699, 243. 00	14. 33
80	002436	兴森科技	1, 682, 882. 00	14. 19
81	601615	明阳智能	1, 679, 113. 00	14. 16

82	688535	华海诚科	1,678,064.81	14.15
83	688167	炬光科技	1,654,729.79	13.95
84	300342	天银机电	1,648,168.00	13.90
85	688521	芯原股份	1,612,225.86	13.60
86	600875	东方电气	1,602,756.00	13.52
87	601872	招商轮船	1,601,618.00	13.51
88	301550	斯菱智驱	1,598,696.20	13.48
89	301179	泽宇智能	1,576,592.00	13.30
90	002126	银轮股份	1,542,864.00	13.01
91	000681	视觉中国	1,513,688.00	12.76
92	300724	捷佳伟创	1,502,074.00	12.67
93	301205	联特科技	1,490,376.00	12.57
94	300811	铂科新材	1,465,791.00	12.36
95	000969	安泰科技	1,462,446.00	12.33
96	002281	光迅科技	1,455,943.00	12.28
97	000862	银星能源	1,455,635.00	12.28
98	603127	昭衍新药	1,453,748.00	12.26
99	603598	引力传媒	1,446,214.00	12.20
100	603806	福斯特	1,442,248.00	12.16
101	002080	中材科技	1,439,032.00	12.14
102	688200	华峰测控	1,438,090.48	12.13
103	688403	汇成股份	1,436,107.26	12.11
104	600452	涪陵电力	1,429,930.00	12.06
105	600522	中天科技	1,412,353.00	11.91
106	000035	中国天楹	1,396,653.00	11.78
107	688048	长光华芯	1,392,798.84	11.75
108	600552	凯盛科技	1,377,260.00	11.61
109	301526	国际复材	1,374,748.00	11.59
110	002182	宝武镁业	1,370,425.00	11.56
111	002484	江海股份	1,367,918.00	11.54
112	301141	中科磁业	1,366,517.00	11.52
113	603083	剑桥科技	1,361,015.00	11.48
114	300494	盛天网络	1,355,823.00	11.43
115	601360	三六零	1,345,914.00	11.35
116	002382	蓝帆医疗	1,342,256.00	11.32
117	603667	五洲新春	1,338,585.00	11.29
118	688362	甬矽电子	1,332,981.00	11.24
119	002050	三花智控	1,327,557.00	11.20
120	603019	中科曙光	1,324,243.00	11.17
121	300666	江丰电子	1,318,125.00	11.12
122	300136	信维通信	1,312,122.00	11.07
123	301171	易点天下	1,309,069.00	11.04
124	688717	艾罗能源	1,307,733.43	11.03

125	688063	派能科技	1,303,889.21	11.00
126	601857	中国石油	1,301,520.00	10.98
127	003031	中瓷电子	1,301,143.00	10.97
128	688143	长盈通	1,299,009.13	10.95
129	603881	数据港	1,294,483.00	10.92
130	688234	天岳先进	1,291,237.23	10.89
131	600105	永鼎股份	1,289,518.00	10.87
132	300161	华中数控	1,284,503.00	10.83
133	000917	电广传媒	1,276,198.00	10.76
134	300904	威力传动	1,272,681.00	10.73
135	301155	海力风电	1,270,898.00	10.72
136	600378	昊华科技	1,268,270.00	10.70
137	301291	明阳电气	1,267,253.00	10.69
138	688651	盛邦安全	1,263,863.35	10.66
139	002131	利欧股份	1,263,374.00	10.65
140	300737	科顺股份	1,262,672.00	10.65
141	688726	拉普拉斯	1,249,437.05	10.54
142	000066	中国长城	1,247,139.00	10.52
143	002648	卫星化学	1,236,725.00	10.43
144	000636	风华高科	1,236,419.00	10.43
145	300690	双一科技	1,224,412.00	10.33
146	601179	中国西电	1,210,374.00	10.21
147	603619	中曼石油	1,208,365.00	10.19
148	601100	恒立液压	1,205,274.00	10.16
149	002384	东山精密	1,184,852.00	9.99
150	603538	美诺华	1,184,459.57	9.99
151	002025	航天电器	1,177,453.00	9.93
152	301517	陕西华达	1,174,369.00	9.90
153	688339	亿华通	1,173,284.36	9.89
154	688676	金盘科技	1,164,509.51	9.82
155	002285	世联行	1,154,512.00	9.74
156	000560	我爱我家	1,152,880.00	9.72
157	688347	华虹公司	1,151,323.16	9.71
158	601155	新城控股	1,149,471.00	9.69
159	600649	城投控股	1,149,300.00	9.69
160	688981	中芯国际	1,149,285.47	9.69
161	600406	国电南瑞	1,144,218.00	9.65
162	002531	天顺风能	1,143,108.00	9.64
163	688349	三一重能	1,142,614.52	9.64
164	603218	日月股份	1,141,135.00	9.62
165	000090	天健集团	1,131,557.00	9.54
166	002244	滨江集团	1,130,310.00	9.53
167	688190	云路股份	1,129,655.51	9.53

168	603606	东方电缆	1, 119, 822. 00	9. 44
169	603078	江化微	1, 114, 600. 00	9. 40
170	002008	大族激光	1, 109, 004. 00	9. 35
171	600487	亨通光电	1, 108, 018. 00	9. 34
172	688556	高测股份	1, 099, 601. 05	9. 27
173	688120	华海清科	1, 098, 794. 19	9. 27
174	002837	英维克	1, 098, 760. 00	9. 27
175	605168	三人行	1, 096, 554. 00	9. 25
176	000990	诚志股份	1, 074, 016. 00	9. 06
177	603601	再升科技	1, 066, 975. 00	9. 00
178	301191	菲菱科思	1, 059, 924. 00	8. 94
179	300567	精测电子	1, 051, 266. 00	8. 87
180	601330	绿色动力	1, 043, 774. 00	8. 80
181	002279	久其软件	1, 039, 664. 00	8. 77
182	600188	兖矿能源	1, 030, 716. 00	8. 69
183	600256	广汇能源	1, 030, 427. 00	8. 69
184	603690	至纯科技	1, 027, 602. 00	8. 67
185	600703	三安光电	1, 023, 348. 00	8. 63
186	300827	上能电气	1, 022, 907. 00	8. 63
187	920808	曙光数创	1, 022, 669. 28	8. 62
188	300792	壹网壹创	1, 021, 338. 00	8. 61
189	688766	普冉股份	1, 020, 543. 10	8. 61
190	300438	鹏辉能源	1, 016, 071. 00	8. 57
191	300569	天能重工	1, 013, 453. 00	8. 55
192	688223	晶科能源	1, 008, 402. 44	8. 50
193	688599	天合光能	1, 005, 709. 19	8. 48
194	600131	国网信通	1, 005, 600. 00	8. 48
195	600183	生益科技	1, 003, 251. 00	8. 46
196	300443	金雷股份	1, 002, 706. 00	8. 46
197	002487	大金重工	992, 026. 00	8. 37
198	688248	南网科技	986, 447. 56	8. 32
199	603228	景旺电子	975, 558. 00	8. 23
200	301389	隆扬电子	975, 491. 00	8. 23
201	300179	四方达	967, 484. 00	8. 16
202	300785	值得买	967, 004. 00	8. 15
203	603396	金辰股份	964, 047. 00	8. 13
204	688028	沃尔德	960, 647. 04	8. 10
205	688691	灿芯股份	951, 730. 98	8. 03
206	688220	翱捷科技	932, 345. 43	7. 86
207	688502	茂莱光学	931, 843. 53	7. 86
208	600563	法拉电子	931, 567. 00	7. 86
209	688621	阳光诺和	918, 575. 35	7. 75
210	300679	电连技术	900, 749. 00	7. 60

211	688268	华特气体	893,842.50	7.54
212	600683	京投发展	891,810.00	7.52
213	301278	快可电子	875,300.00	7.38
214	300129	泰胜风能	855,829.00	7.22
215	603005	晶方科技	854,877.00	7.21
216	002202	金风科技	854,717.00	7.21
217	688409	富创精密	852,509.77	7.19
218	300373	扬杰科技	851,886.00	7.18
219	300253	卫宁健康	845,903.00	7.13
220	300010	ST 豆神	845,428.00	7.13
221	600956	新天绿能	845,030.00	7.13
222	601900	南方传媒	844,436.00	7.12
223	688020	方邦股份	843,640.98	7.11
224	600633	浙数文化	842,480.00	7.10
225	300285	国瓷材料	840,897.00	7.09
226	300634	彩讯股份	837,092.00	7.06
227	300846	首都在线	833,824.00	7.03
228	600986	浙文互联	832,772.00	7.02
229	300499	高澜股份	831,349.00	7.01
230	002446	盛路通信	829,504.00	7.00
231	300315	掌趣科技	818,205.00	6.90
232	300782	卓胜微	807,467.00	6.81
233	600160	巨化股份	802,831.00	6.77
234	002138	顺络电子	800,890.00	6.75
235	301200	大族数控	795,219.00	6.71
236	300835	龙磁科技	788,929.00	6.65
237	301511	德福科技	784,347.00	6.61
238	605006	山东玻纤	769,501.00	6.49
239	603179	新泉股份	761,931.00	6.43
240	300346	南大光电	759,920.00	6.41
241	688668	鼎通科技	759,473.69	6.40
242	603256	宏和科技	751,000.00	6.33
243	603119	浙江荣泰	742,844.00	6.26
244	601869	长飞光纤	734,902.00	6.20
245	601088	中国神华	728,414.00	6.14
246	688376	美埃科技	726,683.12	6.13
247	688222	成都先导	726,142.88	6.12
248	301175	中科环保	715,457.00	6.03
249	002597	金禾实业	715,288.00	6.03
250	300138	晨光生物	714,292.00	6.02
251	603286	日盈电子	703,897.00	5.94
252	601398	工商银行	702,880.00	5.93
253	002821	凯莱英	702,783.00	5.93

254	002142	宁波银行	701,636.00	5.92
255	603626	科森科技	698,338.00	5.89
256	601628	中国人寿	698,214.00	5.89
257	603693	江苏新能	692,040.00	5.84
258	605358	立昂微	682,240.00	5.75
259	001400	江顺科技	680,940.00	5.74
260	301327	华宝新能	676,400.00	5.70
261	600028	中国石化	675,383.00	5.70
262	000933	神火股份	671,966.00	5.67
263	688400	凌云光	668,936.59	5.64
264	000988	华工科技	661,500.00	5.58
265	300661	圣邦股份	659,424.00	5.56
266	605123	派克新材	654,721.00	5.52
267	688551	科威尔	653,569.11	5.51
268	300450	先导智能	650,651.00	5.49
269	600328	中盐化工	650,496.00	5.49
270	300255	常山药业	648,574.00	5.47
271	000420	吉林化纤	648,417.00	5.47
272	002534	西子洁能	644,433.00	5.43
273	601727	上海电气	643,925.01	5.43
274	601868	中国能建	641,028.00	5.41
275	601898	中煤能源	637,319.00	5.37
276	002733	雄韬股份	636,968.00	5.37
277	601126	四方股份	631,884.00	5.33
278	601858	中国科传	629,607.00	5.31
279	300337	银邦股份	625,026.00	5.27
280	600905	三峡能源	618,183.00	5.21
281	600618	氯碱化工	605,568.00	5.11
282	600821	金开新能	604,548.00	5.10
283	600392	盛和资源	601,879.00	5.08
284	600688	上海石化	600,096.00	5.06
285	300726	宏达电子	598,345.00	5.05
286	600266	城建发展	597,557.00	5.04
287	300731	科创新源	596,792.00	5.03
288	600118	中国卫星	592,737.00	5.00
289	002389	航天彩虹	592,488.00	5.00
290	300850	新强联	591,840.00	4.99
291	300781	因赛集团	590,805.00	4.98
292	000893	亚钾国际	589,500.00	4.97
293	300763	锦浪科技	586,399.00	4.95
294	300607	拓斯达	585,711.00	4.94
295	300014	亿纬锂能	585,700.00	4.94
296	002865	钧达股份	584,419.00	4.93

297	002459	晶澳科技	584,054.00	4.93
298	300118	东方日升	583,265.00	4.92
299	600367	红星发展	581,404.00	4.90
300	002655	共达电声	579,595.00	4.89
301	603169	兰石重装	579,040.00	4.88
302	002074	国轩高科	578,565.00	4.88
303	300750	宁德时代	575,680.00	4.85
304	601579	会稽山	574,137.00	4.84
305	002271	东方雨虹	574,121.00	4.84
306	002112	三变科技	574,112.00	4.84
307	600585	海螺水泥	573,575.00	4.84
308	300755	华致酒行	573,243.20	4.83
309	000799	酒鬼酒	573,166.00	4.83
310	603191	望变电气	572,924.00	4.83
311	603688	石英股份	572,483.00	4.83
312	300684	中石科技	572,468.00	4.83
313	601226	华电重工	571,848.00	4.82
314	300570	太辰光	571,830.00	4.82
315	601567	三星医疗	571,424.00	4.82
316	601939	建设银行	570,816.00	4.81
317	300528	幸福蓝海	570,434.00	4.81
318	300490	华自科技	570,347.00	4.81
319	603113	金能科技	566,894.00	4.78
320	002497	雅化集团	565,390.00	4.77
321	603816	顾家家居	561,394.00	4.73
322	600383	金地集团	559,967.00	4.72
323	603105	芯能科技	558,674.00	4.71
324	601963	重庆银行	558,514.00	4.71
325	300619	金银河	557,590.00	4.70
326	001979	招商蛇口	557,386.00	4.70
327	688382	益方生物	553,272.53	4.67
328	688266	泽璟制药	552,897.58	4.66
329	300772	运达股份	551,833.00	4.65
330	002572	索菲亚	544,937.00	4.60
331	600586	金晶科技	543,724.00	4.59
332	300699	光威复材	542,566.00	4.58
333	002943	宇晶股份	541,474.00	4.57
334	300456	赛微电子	539,842.00	4.55
335	000537	绿发电力	539,010.00	4.55
336	601689	拓普集团	538,356.00	4.54
337	300748	金力永磁	534,269.00	4.51
338	000831	中国稀土	531,651.00	4.48
339	002230	科大讯飞	529,308.00	4.46

340	301095	广立微	526,235.00	4.44
341	002048	宁波华翔	525,804.00	4.43
342	603051	鹿山新材	523,943.00	4.42
343	600879	航天电子	518,384.00	4.37
344	688385	复旦微电	511,793.80	4.32
345	688146	中船特气	511,740.84	4.32
346	600877	电科芯片	504,464.00	4.25
347	688418	震有科技	486,087.15	4.10
348	601908	京运通	486,038.00	4.10
349	600866	星湖科技	485,112.00	4.09
350	600330	天通股份	483,795.00	4.08
351	300383	光环新网	483,622.00	4.08
352	600999	招商证券	475,604.00	4.01
353	000783	长江证券	475,250.00	4.01
354	601066	中信建投	474,437.00	4.00
355	600482	中国动力	473,110.00	3.99
356	603171	税友股份	472,588.00	3.99
357	002015	协鑫能科	470,450.28	3.97
358	603009	北特科技	467,532.00	3.94
359	688027	国盾量子	466,864.00	3.94
360	603259	药明康德	465,822.00	3.93
361	688192	迪哲医药	465,656.88	3.93
362	603920	世运电路	465,500.00	3.93
363	002896	中大力德	465,068.00	3.92
364	001287	中电港	464,134.00	3.91
365	688180	君实生物	461,016.74	3.89
366	603067	振华股份	456,196.00	3.85
367	688258	卓易信息	453,838.00	3.83
368	600588	用友网络	453,750.00	3.83
369	002238	天威视讯	453,324.00	3.82
370	002777	久远银海	452,352.00	3.81
371	301110	青木科技	451,996.00	3.81
372	002674	兴业科技	449,817.00	3.79
373	688196	卓越新能	446,752.00	3.77
374	600426	华鲁恒升	442,385.00	3.73
375	300433	蓝思科技	442,050.00	3.73
376	688249	晶合集成	440,787.00	3.72
377	300821	东岳硅材	440,592.00	3.72
378	300592	华凯易佰	440,488.00	3.71
379	300867	圣元环保	440,298.00	3.71
380	603186	华正新材	438,902.00	3.70
381	002897	意华股份	438,544.00	3.70
382	001309	德明利	438,200.00	3.70

383	301123	奕东电子	435,964.00	3.68
384	000657	中钨高新	435,537.00	3.67
385	600089	特变电工	430,761.00	3.63
386	300144	宋城演艺	429,135.00	3.62
387	600054	黄山旅游	429,093.44	3.62
388	603317	天味食品	428,657.00	3.61
389	300251	光线传媒	428,040.00	3.61
390	002791	坚朗五金	427,596.00	3.61
391	301358	湖南裕能	426,795.00	3.60
392	688195	腾景科技	424,976.26	3.58
393	300274	阳光电源	424,633.62	3.58
394	300054	鼎龙股份	424,290.00	3.58
395	000552	甘肃能化	422,406.00	3.56
396	688498	源杰科技	420,794.99	3.55
397	301308	江波龙	416,065.00	3.51
398	600325	华发股份	414,951.00	3.50
399	603737	三棵树	409,723.00	3.46
400	603002	宏昌电子	406,748.50	3.43
401	603296	华勤技术	406,026.00	3.42
402	000983	山西焦煤	403,756.00	3.40
403	601101	昊华能源	403,301.00	3.40
404	001914	招商积余	403,290.00	3.40
405	601699	潞安环能	403,010.00	3.40
406	00189	东岳集团	402,407.46	3.39
407	000786	北新建材	402,238.00	3.39
408	601666	平煤股份	400,977.00	3.38
409	688523	航天环宇	400,921.68	3.38
410	603131	上海沪工	399,117.08	3.37
411	000733	振华科技	397,995.00	3.36
412	600111	北方稀土	395,652.00	3.34
413	601001	晋控煤业	389,620.00	3.29
414	601918	新集能源	388,776.00	3.28
415	688322	奥比中光	388,756.17	3.28
416	603662	柯力传感	386,045.00	3.26
417	300454	深信服	382,813.00	3.23
418	920139	华岭股份	380,902.00	3.21
419	688303	大全能源	378,946.70	3.20
420	688002	睿创微纳	378,510.00	3.19
421	603185	弘元绿能	377,967.00	3.19
422	300814	中富电路	377,764.00	3.19
423	688300	联瑞新材	377,529.43	3.18
424	600438	通威股份	377,360.00	3.18
425	601012	隆基绿能	376,521.00	3.18

426	002129	TCL 中环	376,194.00	3.17
427	301488	豪恩汽电	375,900.00	3.17
428	605598	上海港湾	375,506.00	3.17
429	300398	飞凯材料	374,556.00	3.16
430	600667	太极实业	371,199.00	3.13
431	300182	捷成股份	365,989.00	3.09
432	300805	电声股份	365,957.00	3.09
433	301025	读客文化	365,722.00	3.08
434	002373	千方科技	365,371.00	3.08
435	688123	聚辰股份	365,251.68	3.08
436	002649	博彦科技	364,744.00	3.08
437	603888	新华网	364,397.00	3.07
438	300738	奥飞数据	362,492.00	3.06
439	301270	汉仪股份	360,939.00	3.04
440	301153	中科江南	359,775.00	3.03
441	301102	兆讯传媒	359,543.00	3.03
442	300418	昆仑万维	356,346.00	3.01
443	300031	宝通科技	353,933.00	2.98
444	688698	伟创电气	353,444.48	2.98
445	300258	精锻科技	352,944.00	2.98
446	300115	长盈精密	351,468.37	2.96
447	688469	芯联集成	350,944.00	2.96
448	605488	福莱新材	349,948.00	2.95
449	002261	拓维信息	349,636.00	2.95
450	002472	双环传动	349,240.00	2.95
451	603283	赛腾股份	348,759.70	2.94
452	301413	安培龙	344,186.00	2.90
453	603308	应流股份	343,640.00	2.90
454	002850	科达利	342,260.00	2.89
455	002995	天地在线	340,008.00	2.87
456	600549	厦门钨业	338,525.00	2.85
457	000001	平安银行	333,906.00	2.82
458	002241	歌尔股份	332,387.00	2.80
459	605020	永和股份	328,104.00	2.77
460	001339	智微智能	323,186.00	2.73
461	603757	大元泵业	317,845.00	2.68
462	688126	沪硅产业	308,385.60	2.60
463	002600	领益智造	304,837.00	2.57
464	688375	国博电子	301,819.16	2.55
465	300969	恒帅股份	299,473.00	2.53
466	603730	岱美股份	292,530.00	2.47
467	002294	信立泰	288,704.00	2.43
468	300842	帝科股份	287,400.00	2.42

469	000725	京东方 A	286,858.00	2.42
470	601636	旗滨集团	282,280.00	2.38
471	600979	广安爱众	280,712.00	2.37
472	002422	科伦药业	276,211.00	2.33
473	002327	富安娜	276,046.00	2.33
474	600163	中闽能源	275,257.00	2.32
475	000539	粤电力 A	274,320.00	2.31
476	603986	兆易创新	272,150.00	2.30
477	300947	德必集团	270,969.00	2.29
478	301629	矽电股份	270,384.00	2.28
479	601778	晶科科技	268,400.00	2.26
480	688202	美迪西	262,731.32	2.22
481	002589	瑞康医药	260,726.00	2.20
482	002437	誉衡药业	260,107.00	2.19
483	920735	德源药业	259,995.75	2.19
484	002550	千红制药	259,599.00	2.19
485	002317	众生药业	259,496.00	2.19
486	002603	以岭药业	258,755.00	2.18
487	688102	斯瑞新材	256,759.46	2.17
488	300680	隆盛科技	256,149.00	2.16
489	002544	普天科技	254,681.00	2.15
490	002407	多氟多	247,978.00	2.09
491	301005	超捷股份	246,023.00	2.07
492	301392	汇成真空	245,902.00	2.07

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300316	晶盛机电	6,585,810.00	55.54
2	002222	福晶科技	5,480,856.00	46.22
3	300395	菲利华	4,251,105.00	35.85
4	300502	新易盛	4,186,709.00	35.31
5	688627	精智达	4,102,691.95	34.60
6	688256	寒武纪	4,096,894.75	34.55
7	688037	芯源微	3,974,819.52	33.52
8	300236	上海新阳	3,815,727.00	32.18
9	603650	彤程新材	3,671,303.00	30.96
10	688652	京仪装备	3,440,992.67	29.02
11	688147	微导纳米	3,387,621.72	28.57
12	002463	沪电股份	3,283,446.00	27.69
13	300308	中际旭创	3,264,672.00	27.53
14	300751	迈为股份	3,243,202.00	27.35
15	002156	通富微电	3,118,807.00	26.30

16	301380	挖金客	3,106,239.50	26.19
17	300223	北京君正	3,063,154.00	25.83
18	688205	德科立	3,035,395.93	25.60
19	300604	长川科技	2,926,412.00	24.68
20	688361	中科飞测	2,864,718.15	24.16
21	300620	光库科技	2,759,429.00	23.27
22	688503	聚和材料	2,732,140.35	23.04
23	300762	上海瀚讯	2,729,129.00	23.01
24	301217	铜冠铜箔	2,685,981.00	22.65
25	688516	奥特维	2,682,092.09	22.62
26	300058	蓝色光标	2,672,375.00	22.54
27	301183	东田微	2,668,263.00	22.50
28	601015	陕西黑猫	2,607,036.00	21.98
29	601016	节能风电	2,590,584.00	21.85
30	300394	天孚通信	2,577,229.00	21.73
31	002428	云南锗业	2,561,742.00	21.60
32	688702	盛科通信	2,558,508.58	21.58
33	301529	福赛科技	2,534,982.60	21.38
34	688012	中微公司	2,481,701.54	20.93
35	688072	拓荆科技	2,463,208.82	20.77
36	300378	鼎捷数智	2,370,649.00	19.99
37	603533	掌阅科技	2,370,457.00	19.99
38	603061	金海通	2,336,457.00	19.70
39	002409	雅克科技	2,325,272.00	19.61
40	300548	长芯博创	2,311,318.00	19.49
41	688008	澜起科技	2,309,691.61	19.48
42	300170	汉得信息	2,304,327.00	19.43
43	300065	海兰信	2,302,809.00	19.42
44	600176	中国巨石	2,286,230.00	19.28
45	688519	南亚新材	2,260,789.21	19.07
46	688343	云天励飞	2,252,161.82	18.99
47	000792	盐湖股份	2,238,340.00	18.88
48	300612	宣亚国际	2,235,128.00	18.85
49	002938	鹏鼎控股	2,223,865.00	18.75
50	300677	英科医疗	2,211,442.00	18.65
51	688630	芯碁微装	2,076,539.45	17.51
52	300776	帝尔激光	2,046,829.00	17.26
53	300408	三环集团	2,005,332.00	16.91
54	002565	顺灏股份	2,001,307.00	16.88
55	002080	中材科技	1,975,324.00	16.66
56	688233	神工股份	1,964,826.76	16.57
57	688313	仕佳光子	1,958,755.55	16.52
58	688818	C 电科	1,941,350.99	16.37

59	300442	润泽科技	1,924,327.00	16.23
60	605589	圣泉集团	1,907,694.00	16.09
61	600259	广晟有色	1,898,827.90	16.01
62	688392	骄成超声	1,870,763.90	15.78
63	300540	蜀道装备	1,866,344.00	15.74
64	920368	连城数控	1,856,824.12	15.66
65	002371	北方华创	1,851,290.00	15.61
66	301018	申菱环境	1,814,853.00	15.30
67	300953	震裕科技	1,808,607.00	15.25
68	002400	省广集团	1,807,340.00	15.24
69	601975	招商南油	1,801,720.00	15.19
70	688120	华海清科	1,799,049.58	15.17
71	001896	豫能控股	1,781,601.00	15.02
72	605117	德业股份	1,771,871.00	14.94
73	600498	烽火通信	1,769,030.00	14.92
74	688017	绿的谐波	1,761,241.64	14.85
75	688047	龙芯中科	1,759,094.00	14.83
76	300757	罗博特科	1,747,656.00	14.74
77	688535	华海诚科	1,735,093.72	14.63
78	002436	兴森科技	1,705,373.00	14.38
79	002916	深南电路	1,699,547.00	14.33
80	600989	宝丰能源	1,686,792.00	14.22
81	002153	石基信息	1,673,612.00	14.11
82	603598	引力传媒	1,671,885.00	14.10
83	688167	炬光科技	1,655,791.32	13.96
84	002290	禾盛新材	1,649,070.00	13.91
85	688676	金盘科技	1,642,400.91	13.85
86	688521	芯原股份	1,640,673.92	13.84
87	300342	天银机电	1,636,284.00	13.80
88	301179	泽宇智能	1,626,028.80	13.71
89	600875	东方电气	1,625,535.00	13.71
90	601615	明阳智能	1,623,357.00	13.69
91	688200	华峰测控	1,620,236.51	13.66
92	301205	联特科技	1,597,115.00	13.47
93	600183	生益科技	1,571,045.00	13.25
94	688502	茂莱光学	1,544,354.34	13.02
95	301550	斯菱智驱	1,537,040.00	12.96
96	688048	长光华芯	1,531,390.43	12.91
97	688403	汇成股份	1,527,267.28	12.88
98	688041	海光信息	1,515,545.64	12.78
99	002281	光迅科技	1,515,434.00	12.78
100	601872	招商轮船	1,511,753.00	12.75
101	000681	视觉中国	1,508,244.00	12.72

102	002126	银轮股份	1,498,848.00	12.64
103	300811	铂科新材	1,469,038.60	12.39
104	300724	捷佳伟创	1,456,532.00	12.28
105	002131	利欧股份	1,448,473.00	12.21
106	301526	国际复材	1,445,582.00	12.19
107	688143	长盈通	1,443,005.25	12.17
108	301171	易点天下	1,442,641.00	12.17
109	300666	江丰电子	1,431,266.00	12.07
110	603806	福斯特	1,420,739.00	11.98
111	000862	银星能源	1,418,288.00	11.96
112	600522	中天科技	1,413,352.00	11.92
113	603127	昭衍新药	1,404,349.00	11.84
114	002484	江海股份	1,398,647.00	11.79
115	600452	涪陵电力	1,397,685.00	11.79
116	002382	蓝帆医疗	1,394,439.00	11.76
117	600105	永鼎股份	1,378,218.00	11.62
118	603881	数据港	1,377,785.00	11.62
119	000969	安泰科技	1,372,583.00	11.57
120	301141	中科磁业	1,362,192.00	11.49
121	600552	凯盛科技	1,356,557.00	11.44
122	000035	中国天楹	1,352,730.00	11.41
123	688063	派能科技	1,350,596.32	11.39
124	603667	五洲新春	1,344,723.00	11.34
125	002182	宝武镁业	1,344,696.00	11.34
126	601360	三六零	1,332,452.00	11.24
127	000636	风华高科	1,331,974.00	11.23
128	300494	盛天网络	1,328,508.00	11.20
129	301511	德福科技	1,328,173.00	11.20
130	688717	艾罗能源	1,326,399.85	11.19
131	688234	天岳先进	1,308,006.68	11.03
132	002050	三花智控	1,307,988.00	11.03
133	000917	电广传媒	1,303,834.00	11.00
134	603083	剑桥科技	1,299,324.00	10.96
135	688362	甬矽电子	1,298,181.76	10.95
136	601179	中国西电	1,287,435.00	10.86
137	003031	中瓷电子	1,274,064.00	10.74
138	301291	明阳电气	1,264,627.00	10.66
139	300136	信维通信	1,258,701.00	10.61
140	600378	昊华科技	1,255,608.00	10.59
141	603538	美诺华	1,245,531.00	10.50
142	300904	威力传动	1,242,524.00	10.48
143	300690	双一科技	1,234,432.00	10.41
144	301155	海力风电	1,234,256.00	10.41

145	601857	中国石油	1,232,550.00	10.39
146	688651	盛邦安全	1,232,099.16	10.39
147	300161	华中数控	1,209,679.00	10.20
148	300737	科顺股份	1,191,088.00	10.04
149	301517	陕西华达	1,187,675.00	10.02
150	601869	长飞光纤	1,184,022.00	9.98
151	601100	恒立液压	1,179,361.00	9.95
152	300438	鹏辉能源	1,171,977.00	9.88
153	002025	航天电器	1,163,789.00	9.81
154	002648	卫星化学	1,163,634.00	9.81
155	688726	拉普拉斯	1,157,402.14	9.76
156	600487	亨通光电	1,152,972.00	9.72
157	002285	世联行	1,146,276.00	9.67
158	300567	精测电子	1,145,460.00	9.66
159	002384	东山精密	1,144,740.00	9.65
160	603606	东方电缆	1,143,049.00	9.64
161	600406	国电南瑞	1,140,155.00	9.61
162	688339	亿华通	1,128,692.02	9.52
163	688347	华虹公司	1,124,335.62	9.48
164	603078	江化微	1,121,781.00	9.46
165	603619	中曼石油	1,121,658.00	9.46
166	000560	我爱我家	1,119,740.00	9.44
167	600649	城投控股	1,119,492.00	9.44
168	601155	新城控股	1,117,112.00	9.42
169	000090	天健集团	1,113,630.00	9.39
170	002837	英维克	1,104,860.00	9.32
171	688190	云路股份	1,101,654.13	9.29
172	002008	大族激光	1,094,076.00	9.23
173	605168	三人行	1,090,251.50	9.19
174	002244	滨江集团	1,088,633.00	9.18
175	603218	日月股份	1,088,384.00	9.18
176	688556	高测股份	1,088,108.52	9.18
177	600188	兖矿能源	1,075,830.20	9.07
178	688349	三一重能	1,075,277.92	9.07
179	002531	天顺风能	1,073,453.00	9.05
180	603601	再升科技	1,051,613.00	8.87
181	002279	久其软件	1,045,364.00	8.82
182	300827	上能电气	1,045,342.00	8.82
183	688248	南网科技	1,042,640.97	8.79
184	600703	三安光电	1,030,364.00	8.69
185	301389	隆扬电子	1,030,162.00	8.69
186	300785	值得买	1,028,943.00	8.68
187	300569	天能重工	1,025,983.00	8.65

188	301191	菲菱科思	1,022,373.00	8.62
189	603690	至纯科技	1,021,858.00	8.62
190	603396	金辰股份	1,014,228.00	8.55
191	601330	绿色动力	1,011,852.00	8.53
192	600256	广汇能源	1,003,689.00	8.46
193	920808	曙光数创	1,001,904.77	8.45
194	300792	壹网壹创	1,001,548.00	8.45
195	300679	电连技术	994,558.00	8.39
196	000990	诚志股份	981,040.00	8.27
197	603228	景旺电子	975,827.00	8.23
198	688691	灿芯股份	973,269.32	8.21
199	000066	中国长城	963,018.00	8.12
200	002487	大金重工	956,821.00	8.07
201	688223	晶科能源	955,222.88	8.06
202	688766	普冉股份	950,989.42	8.02
203	300443	金雷股份	949,449.00	8.01
204	600131	国网信通	948,110.00	8.00
205	600563	法拉电子	945,605.00	7.97
206	688599	天合光能	933,853.51	7.88
207	688220	翱捷科技	927,077.71	7.82
208	688621	阳光诺和	926,407.37	7.81
209	688409	富创精密	924,862.59	7.80
210	300782	卓胜微	913,942.00	7.71
211	603256	宏和科技	906,994.00	7.65
212	688028	沃尔德	893,501.68	7.53
213	300179	四方达	886,218.00	7.47
214	300253	卫宁健康	882,952.00	7.45
215	688020	方邦股份	877,424.11	7.40
216	603005	晶方科技	876,138.00	7.39
217	300373	扬杰科技	869,169.00	7.33
218	300010	ST 豆神	868,997.00	7.33
219	688268	华特气体	863,524.10	7.28
220	300499	高澜股份	862,676.00	7.27
221	600633	浙数文化	854,307.00	7.20
222	605006	山东玻纤	852,394.00	7.19
223	601900	南方传媒	840,025.00	7.08
224	603019	中科曙光	837,274.00	7.06
225	301278	快可电子	833,590.00	7.03
226	600986	浙文互联	828,094.00	6.98
227	300285	国瓷材料	822,325.00	6.93
228	300634	彩讯股份	816,869.00	6.89
229	002446	盛路通信	815,573.00	6.88
230	600683	京投发展	810,447.00	6.83

231	600956	新天绿能	810,203.00	6.83
232	600160	巨化股份	809,769.00	6.83
233	300315	掌趣科技	806,146.00	6.80
234	002202	金风科技	805,713.00	6.79
235	002138	顺络电子	805,019.00	6.79
236	300129	泰胜风能	790,725.00	6.67
237	300846	首都在线	789,862.00	6.66
238	300835	龙磁科技	784,345.00	6.61
239	301200	大族数控	779,932.00	6.58
240	601868	中国能建	747,990.00	6.31
241	603179	新泉股份	741,157.00	6.25
242	688668	鼎通科技	739,410.03	6.24
243	300346	南大光电	722,554.00	6.09
244	605358	立昂微	714,089.00	6.02
245	301327	华宝新能	713,357.00	6.02
246	688376	美埃科技	705,632.45	5.95
247	000988	华工科技	705,600.00	5.95
248	002142	宁波银行	698,933.00	5.89
249	603119	浙江荣泰	697,473.50	5.88
250	601398	工商银行	693,330.00	5.85
251	601088	中国神华	691,840.00	5.83
252	601628	中国人寿	691,372.00	5.83
253	300138	晨光生物	690,864.00	5.83
254	688222	成都先导	689,909.20	5.82
255	603693	江苏新能	679,364.00	5.73
256	603286	日盈电子	677,602.00	5.71
257	300763	锦浪科技	676,224.00	5.70
258	001400	江顺科技	674,357.00	5.69
259	301175	中科环保	670,437.00	5.65
260	002733	雄韬股份	670,347.00	5.65
261	300661	圣邦股份	660,678.00	5.57
262	603626	科森科技	659,763.00	5.56
263	688400	凌云光	656,380.77	5.54
264	601898	中煤能源	648,314.00	5.47
265	002597	金禾实业	647,148.00	5.46
266	605123	派克新材	645,076.00	5.44
267	300255	常山药业	639,917.00	5.40
268	600328	中盐化工	636,944.00	5.37
269	601727	上海电气	632,625.00	5.33
270	300726	宏达电子	624,629.00	5.27
271	000933	神火股份	619,615.00	5.23
272	300450	先导智能	618,309.00	5.21
273	601126	四方股份	617,668.00	5.21

274	002534	西子洁能	616,509.00	5.20
275	600392	盛和资源	615,810.00	5.19
276	688551	科威尔	615,733.65	5.19
277	600905	三峡能源	611,010.00	5.15
278	300118	东方日升	604,920.00	5.10
279	600028	中国石化	603,850.00	5.09
280	601858	中国科传	603,613.00	5.09
281	603191	望变电气	596,783.00	5.03
282	300337	银邦股份	596,540.00	5.03
283	002112	三变科技	589,989.00	4.98
284	600266	城建发展	587,466.00	4.95
285	000420	吉林化纤	587,064.00	4.95
286	600618	氯碱化工	586,747.00	4.95
287	600821	金开新能	585,858.00	4.94
288	601939	建设银行	585,216.00	4.94
289	603816	顾家家居	583,535.00	4.92
290	300731	科创新源	582,936.00	4.92
291	000831	中国稀土	578,487.00	4.88
292	300570	太辰光	578,443.00	4.88
293	600585	海螺水泥	574,764.00	4.85
294	300750	宁德时代	569,791.00	4.81
295	603688	石英股份	568,500.00	4.79
296	000893	亚钾国际	568,440.00	4.79
297	600118	中国卫星	566,934.00	4.78
298	300607	拓斯达	566,228.00	4.77
299	300684	中石科技	565,874.00	4.77
300	002074	国轩高科	564,710.00	4.76
301	300748	金力永磁	564,239.00	4.76
302	002943	宇晶股份	563,761.00	4.75
303	300014	亿纬锂能	563,012.00	4.75
304	601579	会稽山	562,440.00	4.74
305	601963	重庆银行	560,119.00	4.72
306	300781	因赛集团	556,036.00	4.69
307	002459	晶澳科技	555,710.00	4.69
308	002865	钧达股份	555,498.00	4.68
309	688146	中船特气	555,408.00	4.68
310	601567	三星医疗	555,249.00	4.68
311	300850	新强联	552,173.25	4.66
312	002389	航天彩虹	551,132.00	4.65
313	603105	芯能科技	549,692.00	4.64
314	002271	东方雨虹	549,093.00	4.63
315	600383	金地集团	548,841.00	4.63
316	603113	金能科技	547,998.00	4.62

317	688981	中芯国际	547,970.22	4.62
318	002572	索菲亚	546,343.00	4.61
319	603169	兰石重装	546,140.00	4.61
320	002048	宁波华翔	545,038.00	4.60
321	300528	幸福蓝海	544,504.00	4.59
322	002230	科大讯飞	544,491.00	4.59
323	000799	酒鬼酒	542,508.00	4.57
324	688266	泽璟制药	542,211.50	4.57
325	300456	赛微电子	540,486.00	4.56
326	600688	上海石化	540,338.00	4.56
327	001979	招商蛇口	540,274.00	4.56
328	300755	华致酒行	535,651.42	4.52
329	688382	益方生物	535,198.60	4.51
330	300490	华自科技	532,504.00	4.49
331	600586	金晶科技	531,416.00	4.48
332	002497	雅化集团	530,521.00	4.47
333	300398	飞凯材料	521,430.00	4.40
334	600367	红星发展	516,717.00	4.36
335	300619	金银河	516,450.00	4.36
336	000537	绿发电力	512,562.00	4.32
337	601689	拓普集团	510,533.00	4.31
338	300772	运达股份	508,843.00	4.29
339	300699	光威复材	508,750.00	4.29
340	002655	共达电声	506,389.00	4.27
341	603171	税友股份	506,022.00	4.27
342	688385	复旦微电	500,692.50	4.22
343	601226	华电重工	500,504.00	4.22
344	002163	海南发展	494,394.00	4.17
345	688195	腾景科技	493,150.44	4.16
346	600879	航天电子	493,115.00	4.16
347	601208	东材科技	489,600.00	4.13
348	603051	鹿山新材	489,452.00	4.13
349	002015	协鑫能科	489,008.00	4.12
350	600866	星湖科技	485,809.00	4.10
351	600877	电科芯片	483,570.00	4.08
352	688418	震有科技	482,904.00	4.07
353	600330	天通股份	481,329.00	4.06
354	002897	意华股份	476,280.00	4.02
355	688027	国盾量子	475,612.18	4.01
356	300383	光环新网	471,822.00	3.98
357	002896	中大力德	467,348.00	3.94
358	688192	迪哲医药	461,704.64	3.89
359	001287	中电港	460,375.00	3.88

360	301358	湖南裕能	456,368.00	3.85
361	603186	华正新材	455,473.00	3.84
362	600089	特变电工	453,557.00	3.82
363	603920	世运电路	447,300.00	3.77
364	300476	胜宏科技	441,260.00	3.72
365	002674	兴业科技	440,744.00	3.72
366	002238	天威视讯	440,342.00	3.71
367	600482	中国动力	438,290.00	3.70
368	603009	北特科技	437,753.00	3.69
369	000657	中钨高新	437,472.00	3.69
370	688196	卓越新能	435,081.84	3.67
371	688180	君实生物	434,242.70	3.66
372	300592	华凯易佰	432,724.00	3.65
373	603002	宏昌电子	431,890.00	3.64
374	603283	赛腾股份	431,609.00	3.64
375	300433	蓝思科技	428,461.00	3.61
376	300867	圣元环保	428,064.00	3.61
377	688249	晶合集成	426,262.50	3.59
378	300054	鼎龙股份	426,024.00	3.59
379	002777	久远银海	424,793.00	3.58
380	300251	光线传媒	424,765.00	3.58
381	600588	用友网络	422,750.00	3.57
382	301123	奕东电子	420,992.00	3.55
383	603317	天味食品	420,204.00	3.54
384	000552	甘肃能化	417,350.00	3.52
385	001309	德明利	416,782.00	3.51
386	688498	源杰科技	416,292.03	3.51
387	603067	振华股份	413,946.00	3.49
388	600667	太极实业	412,222.00	3.48
389	600111	北方稀土	411,450.00	3.47
390	300821	东岳硅材	411,048.00	3.47
391	300144	宋城演艺	410,301.00	3.46
392	688258	卓易信息	409,662.47	3.45
393	600054	黄山旅游	406,242.00	3.43
394	603737	三棵树	406,173.00	3.43
395	002791	坚朗五金	405,196.00	3.42
396	601908	京运通	404,715.00	3.41
397	603131	上海沪工	403,710.00	3.40
398	688002	睿创微纳	401,202.00	3.38
399	603296	华勤技术	400,350.00	3.38
400	300274	阳光电源	399,392.00	3.37
401	000786	北新建材	399,162.00	3.37
402	688303	大全能源	398,851.07	3.36

403	001914	招商积余	396,619.00	3.34
404	601101	昊华能源	396,324.00	3.34
405	000733	振华科技	394,420.00	3.33
406	688123	聚辰股份	394,350.00	3.33
407	301110	青木科技	394,127.00	3.32
408	688322	奥比中光	394,114.72	3.32
409	601888	中国中免	390,096.00	3.29
410	000983	山西焦煤	390,038.00	3.29
411	601699	潞安环能	389,912.00	3.29
412	603662	柯力传感	387,750.00	3.27
413	600426	华鲁恒升	387,526.00	3.27
414	601666	平煤股份	387,040.00	3.26
415	300814	中富电路	386,100.00	3.26
416	603185	弘元绿能	385,818.00	3.25
417	600325	华发股份	384,997.00	3.25
418	601918	新集能源	383,344.00	3.23
419	301308	江波龙	382,421.00	3.22
420	002373	千方科技	379,787.00	3.20
421	600438	通威股份	379,077.00	3.20
422	601001	晋控煤业	375,883.00	3.17
423	920139	华岭股份	372,911.50	3.14
424	002129	TCL 中环	372,113.00	3.14
425	605598	上海港湾	372,060.00	3.14
426	301025	读客文化	371,127.00	3.13
427	301153	中科江南	371,071.00	3.13
428	600549	厦门钨业	370,858.00	3.13
429	300182	捷成股份	368,984.00	3.11
430	00189	东岳集团	368,697.79	3.11
431	688523	航天环宇	368,669.68	3.11
432	300805	电声股份	368,594.00	3.11
433	002649	博彦科技	366,430.00	3.09
434	601012	隆基绿能	365,743.89	3.08
435	688300	联瑞新材	364,708.06	3.08
436	002851	麦格米特	362,081.00	3.05
437	688469	芯联集成	361,226.20	3.05
438	300454	深信服	359,856.00	3.03
439	301488	豪恩汽电	357,147.00	3.01
440	603888	新华网	354,697.00	2.99
441	300418	昆仑万维	351,540.00	2.96
442	603308	应流股份	349,580.00	2.95
443	605488	福莱新材	349,503.00	2.95
444	002995	天地在线	349,308.00	2.95
445	300738	奥飞数据	343,731.00	2.90

446	300031	宝通科技	343,620.00	2.90
447	002261	拓维信息	343,138.00	2.89
448	688698	伟创电气	340,749.39	2.87
449	300115	长盈精密	336,743.00	2.84
450	002850	科达利	333,503.00	2.81
451	000001	平安银行	333,300.00	2.81
452	002472	双环传动	332,092.00	2.80
453	300258	精锻科技	331,604.00	2.80
454	605020	永和股份	331,211.00	2.79
455	301102	兆讯传媒	329,939.00	2.78
456	301270	汉仪股份	329,005.00	2.77
457	301413	安培龙	316,579.00	2.67
458	002241	歌尔股份	315,447.00	2.66
459	603757	大元泵业	312,200.00	2.63
460	688126	沪硅产业	305,502.32	2.58
461	000725	京东方 A	302,358.00	2.55
462	688375	国博电子	299,799.85	2.53
463	603986	兆易创新	299,348.00	2.52
464	002600	领益智造	295,733.00	2.49
465	001339	智微智能	294,350.00	2.48
466	603730	岱美股份	293,710.00	2.48
467	601636	旗滨集团	290,658.00	2.45
468	002294	信立泰	284,535.00	2.40
469	300969	恒帅股份	277,911.00	2.34
470	000539	粤电力 A	276,048.00	2.33
471	600979	广安爱众	275,892.00	2.33
472	600163	中闽能源	274,093.00	2.31
473	002327	富安娜	273,309.00	2.30
474	002422	科伦药业	270,348.00	2.28
475	601778	晶科科技	269,864.00	2.28
476	300842	帝科股份	268,368.00	2.26
477	301629	矽电股份	267,195.00	2.25
478	300947	德必集团	265,640.00	2.24
479	002317	众生药业	263,865.00	2.23
480	002437	誉衡药业	261,261.00	2.20
481	301392	汇成真空	260,582.00	2.20
482	002603	以岭药业	258,818.00	2.18
483	002550	千红制药	258,060.00	2.18
484	688202	美迪西	258,025.20	2.18
485	002821	凯莱英	257,227.00	2.17
486	002589	瑞康医药	254,323.00	2.14
487	002407	多氟多	253,697.00	2.14
488	300680	隆盛科技	253,030.00	2.13

489	920735	德源药业	251,182.50	2.12
490	002544	普天科技	247,890.00	2.09
491	688102	斯瑞新材	238,082.61	2.01

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	503,646,389.37
卖出股票收入（成交）总额	510,003,267.92

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

禾盛新材因董事涉嫌违法发放贷款，广东省湛江市公安局对其做出采取强制措施的处罚决定。

中信建投因在证券发行保荐个别项目中，对发行人的主要产品价格变动情况、部分主要客户和供应商、个别重要子公司等事项的尽职调查不充分，未审慎核查发行人申请文件和证券发行募集文

件中有证券服务机构及其签字人员出具专业意见的内容，中国证监会北京监管局对其做出出具警示函、采取监管谈话、采取认定为不适当人选的处罚决定。

长江证券因长信基金一是内控执行不到位：定价决策人员未依规履行签字职责，监察稽核部门开展合规审查工作存在缺失；二是内部研究不充分：部分研究报告关于建议价格区间的逻辑推导过程缺失，部分研究报告关于建议价格区间的逻辑推导过程不合理；三是定价决策不审慎：最终报价确定的依据不充分、估值模型设置不合理，部分项目最终报价的估值逻辑与内部研究报告前后不一致且缺少推导过程，留存的定价依据无法支持最终报价结果，上海证券交易所对其做出监管警示的处罚决定。

报告期内，本基金管理人严格遵循基金投资管理相关制度要求，上述证券发行主体的违法违规行为暂不会造成重大负面影响，投资决策程序符合法律法规和公司制度的规定。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	101,552.98
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	296,658.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	398,211.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	666,683.74	5.65	重大事项停牌

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
华润元大 安鑫灵活 配置 A	630	5,515.90	664,877.01	19.13	2,810,137.21	80.87
华润元大 安鑫灵活 配置 C	772	1,290.20	-	-	996,034.69	100.00
合计	1,402	3,189.05	664,877.01	14.87	3,806,171.90	85.13

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例大计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别大份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额大合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	67.43

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	华润元大安鑫灵活配置 A	6,115.39	0.1760
	华润元大安鑫灵活配置 C	-	-
	合计	6,115.39	0.1368

注：截至本报告期末，本基金管理人从业人员投资、持有本基金符合相关法律法规、中国证监会

规定及相关管理制度的规定。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	华润元大安鑫灵活配置 A	0
	华润元大安鑫灵活配置 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华润元大安鑫灵活配置 A	0
	华润元大安鑫灵活配置 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大安鑫灵活配置 A	华润元大安鑫灵活配置 C
基金合同生效日 （2014 年 9 月 18 日） 基金份额总额	65,878,168.77	—
本报告期期初基金 份额总额	3,880,866.65	2,015,119.58
本报告期基金总申 购份额	2,129,479.07	7,356,198.53
减：本报告期基金总 赎回份额	2,535,331.50	8,375,283.42
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	3,475,014.22	996,034.69

注：本基金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

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金不存在基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计的会计师事务所。本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，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

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	515,782,599.54	50.88	224,781.41	50.92	—
申万宏源	2	232,217,531.57	22.91	101,222.80	22.93	—
西部证券	1	145,455,626.17	14.35	63,403.26	14.36	—

国信证券	2	113,098,500.60	11.16	49,299.58	11.17	-
中信证券	2	7,095,399.41	0.70	2,731.65	0.62	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：基金专用交易单元的选择标准和程序如下：

1、选择标准

（1）证券公司经营管理、信誉与财务状况良好，内部管理规范，具备健全的内部控制，遵守国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；

（2）维护资产委托人利益，不利用委托资产进行利益输送，不承诺交易量；

（3）有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并有能力根据基金投资的特殊要求，提供专门的定制服务；

（4）建立广泛的信息网络，能及时提供准确的信息咨询和路演调研等服务；

（5）证券公司具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，能满足基金产品运作有关敏感信息的安全和保密的要求；

（6）证券公司交易设施应符合代理基金产品进行证券交易的需要，及时完成交易指令，能按时发送对账单等。

2、选择程序

（1）本基金管理人组织相关人员依据上述标准对候选证券公司进行评估，确定选用的证券公司；

（2）选用证券公司确定后，公司与被选择的证券公司签订交易单元租用协议，交易单元租用手续办理；

（3）交易单元租用完成后，科技与运营部进行相关系统配置，并将交易单元变动情况通知托管人。

3、本基金本报告期内的基金专用交易单元未发生变化。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

注：无。

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	华润元大基金管理有限公司关于办公地变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 7 日
2	华润元大基金管理有限公司关于终止天津市润泽基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监	2026 年 1 月 13 日

		会基金电子披露网站	
3	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 1 月 22 日
4	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 22 日
5	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 3 月 31 日
6	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 3 月 31 日
7	华润元大基金管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	基金管理人网站	2026 年 3 月 31 日
8	华润元大基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 4 月 22 日
9	华润元大安鑫灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 4 月 22 日
10	2025 年度华润元大基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026 年 4 月 30 日
11	华润元大基金管理有限公司关于旗下基金参加中国人寿保险股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 16 日
12	华润元大基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 18 日
13	华润元大基金管理有限公司关于调整旗下基金所持停牌股票估值方法的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 22 日
14	华润元大基金管理有限公司环境信息披露报告（2025 年度）	基金管理人网站、证监会基金电子披露网站	2026 年 6 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
个人	1	2026 年 3 月 5	0.00	1,818,12	1,818,125	0.00	0.000

		日至 2026 年 3 月 25 日		5.47	.47		0
产品特有风险							
本基金于本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20% 的情形，本基金管理人已经采取措施，审慎确认大额申购与大额赎回，防控产品流动性风险并公平对待投资者。本基金管理人提请投资者注意因单一投资者持有基金份额集中导致的产品流动性风险、大额赎回风险以及净值波动风险等特有风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于核准本基金募集的批复；
- 2、本基金基金合同；
- 3、本基金托管协议；
- 4、本报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

12.2 存放地点

以上备查文件存放于基金管理人和基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

基金持有人可在办公时间到基金管理人和基金托管人的办公场所或网站免费查阅。

华润元大基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日