

华润元大量化优选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	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
3.3 其他指标	8
§ 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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
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	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
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	45
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	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 盈利投资者数量占比	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
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	49
10.8 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	53
§ 12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华润元大量化优选混合型证券投资基金	
基金简称	华润元大量化优选混合	
基金主代码	000646	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 9 月 4 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	6,868,348.84 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华润元大量化优选混合 A	华润元大量化优选混合 C
下属分级基金的交易代码	000646	007827
报告期末下属分级基金的份额总额	6,504,991.52 份	363,357.32 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下，充分运用量化投资策略，力求基金资产长期增值。
投资策略	本基金在投资中将以基金的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，采用量化选股模型，并将对基金整体的波动和风险进行控制，力求基金资产长期、稳定的增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%+中证国债指数收益率*30%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。 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	北京市东城区建国门内大街 69

	金田路 3086 号大百汇广场 32 层 03-07 单元	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	《证券日报》
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)	
	华润元大量化优选混合 A	华润元大量化优选混合 C
本期已实现收益	6,195,144.18	292,048.46
本期利润	7,342,195.32	280,747.36
加权平均基金份 额本期利润	0.9831	0.8762
本期加权平均净 值利润率	43.69%	38.49%
本期基金份额净 值增长率	52.12%	52.05%
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	7,984,654.81	428,533.03

期末可供分配基金份额利润	1. 2275	1. 1794
期末基金资产净值	18, 437, 792. 90	1, 010, 751. 43
期末基金份额净值	2. 8344	2. 7817
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	183. 44%	134. 74%

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

华润元大量化优选混合 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	39. 15%	2. 15%	4. 62%	0. 79%	34. 53%	1. 36%
过去六个月	52. 12%	1. 86%	2. 19%	0. 75%	49. 93%	1. 11%
过去一年	85. 10%	2. 04%	12. 01%	0. 68%	73. 09%	1. 36%
过去三年	106. 56%	1. 59%	25. 06%	0. 76%	81. 50%	0. 83%
过去五年	74. 02%	1. 38%	2. 77%	0. 79%	71. 25%	0. 59%
自基金合同生效起至今	183. 44%	1. 38%	77. 37%	1. 09%	106. 07 %	0. 29%

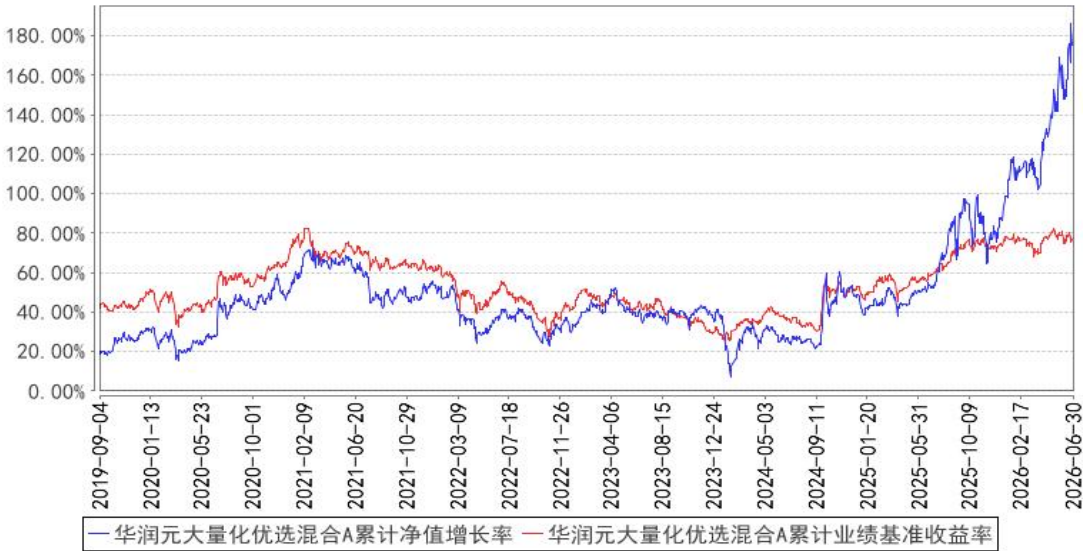
华润元大量化优选混合 C

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	39. 13%	2. 15%	4. 62%	0. 79%	34. 51%	1. 36%
过去六个月	52. 05%	1. 86%	2. 19%	0. 75%	49. 86%	1. 11%
过去一年	84. 93%	2. 04%	12. 01%	0. 68%	72. 92%	1. 36%

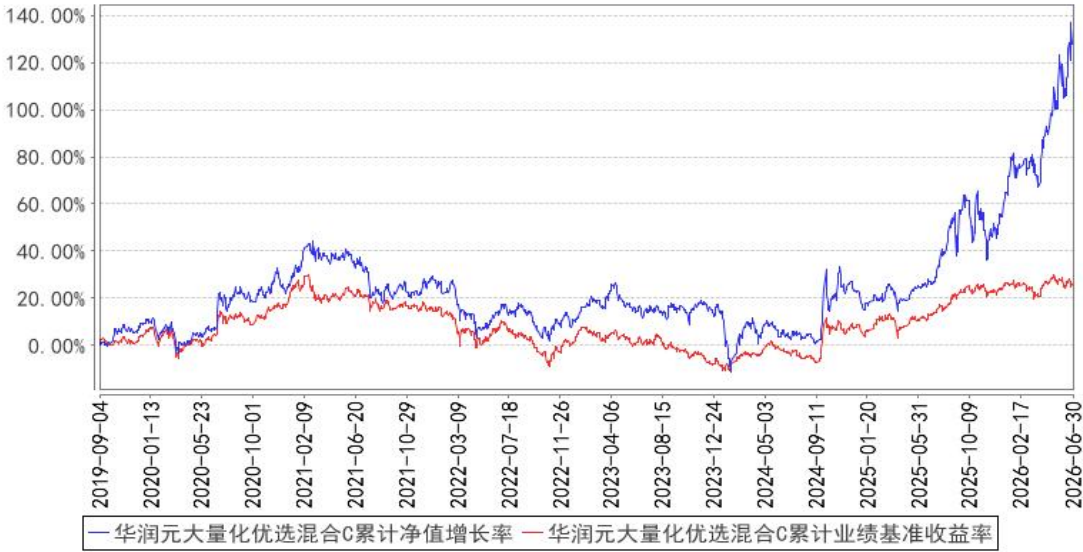
过去三年	105.99%	1.59%	25.06%	0.76%	80.93%	0.83%
过去五年	73.17%	1.38%	2.77%	0.79%	70.40%	0.59%
自基金合同生效起 至今	134.74%	1.31%	26.25%	0.81%	108.49 %	0.50%

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

华润元大量化优选混合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



华润元大量化优选混合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	2019 年 10 月 18 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。

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 股在内外部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。

本基金作为主动量化型基金，报告期内，本基金主要运用量化选股模型，选择业绩较好且估值较低的低估价值股与绩优成长股。

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量化优选混合 A 基金份额净值为 2.8344 元，本报告期基金份额净值增长率为 52.12%，同期业绩基准收益率为 2.19%；华润元大量化优选混合 C 基金份额净值为 2.7817 元，本报告期基金份额净值增长率为 52.05%，同期业绩基准收益率为 2.19%。

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，熟悉相关政策法规，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合规守信、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：华润元大量化优选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	1,045,789.37	1,490,751.89
结算备付金		133,615.61	4,614.92
存出保证金		22,314.97	39,055.52
交易性金融资产	6.4.7.2	16,948,890.71	16,528,503.46
其中：股票投资		16,041,686.52	15,417,397.38
基金投资		-	-
债券投资		907,204.19	1,111,106.08
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		1,248,157.50	1,521,393.71
应收股利		14,546.24	-
应收申购款		198,377.81	6,150.93
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		19,611,692.21	19,590,470.43
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		0.48	57.40
应付赎回款		95,003.29	6,232.21
应付管理人报酬		18,167.76	19,439.86
应付托管费		3,027.96	3,239.98
应付销售服务费		94.67	36.08
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	46,853.72	19,265.05
负债合计		163,147.88	48,270.58
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	6,868,348.84	10,491,975.77
未分配利润	6.4.7.12	12,580,195.49	9,050,224.08
净资产合计		19,448,544.33	19,542,199.85
负债和净资产总计		19,611,692.21	19,590,470.43

注： 报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 6,868,348.84 份，其中华润元大量化优选混合 A 类基金份额净值人民币 2.8344 元，份额总额 6,504,991.52 份；华润元大量化优选混合 C 类基金份额净值人民币 2.7817 元，份额总额 363,357.32 份。

6.2 利润表

会计主体：华润元大量化优选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		7,746,394.43	919,146.23

1. 利息收入		3,581.26	6,048.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,581.26	6,048.79
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		6,593,237.74	308,102.05
其中：股票投资收益	6.4.7.14	6,531,997.61	44,247.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	6,856.53	2,969.48
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	54,383.60	260,885.43
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	1,135,750.04	602,915.96
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	13,825.39	2,079.43
减：二、营业总支出		123,451.75	121,989.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	104,161.18	103,582.74
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,360.21	17,263.83
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	355.31	274.72
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	1,575.05	868.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,622,942.68	797,156.83
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,622,942.68	797,156.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		7,622,942.68	797,156.83
----------	--	--------------	------------

6.3 净资产变动表

会计主体：华润元大量化优选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	10,491,975.77	-	9,050,224.08	19,542,199.85
二、本期期初净资产	10,491,975.77	-	9,050,224.08	19,542,199.85
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,623,626.93	-	3,529,971.41	-93,655.52
（一）、综合收益总额	-	-	7,622,942.68	7,622,942.68
（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）	-3,623,626.93	-	-4,092,971.27	-7,716,598.20
其中：1. 基金申购款	1,910,898.96	-	2,465,791.02	4,376,689.98
2. 基金赎回款	-5,534,525.89	-	-6,558,762.29	-12,093,288.18
（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	6,868,348.84	-	12,580,195.49	19,448,544.33
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	12,095,386.56	-	5,590,950.40	17,686,336.96
二、本期期初净资产	12,095,386.56	-	5,590,950.40	17,686,336.96
三、本期增减变动额（减少以“-”	-520,774.99	-	548,666.41	27,891.42

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	797,156.83	797,156.83
(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)	-520,774.99	-	-248,490.42	-769,265.41
其中：1. 基金申购款	316,595.94	-	147,074.68	463,670.62
2. 基金赎回款	-837,370.93	-	-395,565.10	-1,232,936.03
(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	11,574,611.57	-	6,139,616.81	17,714,228.38

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

华润元大量化优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),原名华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金,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[2014]472号《关于核准华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华润元大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《华润元大医疗保健量化股票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,首次募集期间为2014年7月9日至2014年8月12日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集406,738,268.41元,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证并出具安永华明(2014)验字第61032987_H03号验资报告。经向中国证监会备案,《华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金基金合同》于2014年8月18日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为406,876,288.32份基金份额,其中认

购资金利息折合 138,019.91 份基金份额。本基金的基金管理人为华润元大基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金份额持有人大会于 2019 年 9 月 3 日表决通过的《关于修改华润元大医疗保健量化混合型证券投资基金基金合同等有关事项的议案》，自 2019 年 9 月 4 日起变更为本基金，转型后基金的投资范围、投资策略、业绩比较基准、增设 C 类份额等相关内容按照《华润元大量化优选混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华润元大量化优选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（含中小板，创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（国债、央行票据、金融债、公司债、企业债、短期融资券、超短期融资券、次级债券、中期票据、地方政府债券、政府支持机构债、政府支持债券、可转换公司债券、可分离交易可转债等）货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券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：本基金股票投资比例范围为基金资产的 60%-95%，投资港股通标的股票的投资比例不得超过股票资产的 50%。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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率*20%+中证国债指数收益率*30%。

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相一致。

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

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需要说明的重大会计差错更正。

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	1,045,789.37
等于：本金	1,045,694.46
加：应计利息	94.91
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	1,045,789.37

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		14,375,072.34	-	16,041,686.52	1,666,614.18
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	904,020.00	4,234.19	907,204.19	-1,050.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	904,020.00	4,234.19	907,204.19	-1,050.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		15,279,092.34	4,234.19	16,948,890.71	1,665,564.18

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	14.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	46,839.70
其中：交易所市场	46,839.70
银行间市场	-
应付利息	-
合计	46,853.72

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

华润元大量化优选混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,269,174.93	10,269,174.93
本期申购	1,091,878.19	1,091,878.19
本期赎回（以“-”号填列）	-4,856,061.60	-4,856,061.60
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	6,504,991.52	6,504,991.52

华润元大量化优选混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	222,800.84	222,800.84
本期申购	819,020.77	819,020.77
本期赎回（以“-”号填列）	-678,464.29	-678,464.29
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	363,357.32	363,357.32

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

华润元大量化优选混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,721,764.93	5,143,655.43	8,865,420.36
本期期初	3,721,764.93	5,143,655.43	8,865,420.36
本期利润	6,195,144.18	1,147,051.14	7,342,195.32
本期基金份额交易产生的变动数	-1,932,254.30	-2,342,560.00	-4,274,814.30
其中：基金申购款	812,385.72	612,333.10	1,424,718.82
基金赎回款	-2,744,640.02	-2,954,893.10	-5,699,533.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,984,654.81	3,948,146.57	11,932,801.38

华润元大量化优选混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	73,801.36	111,002.36	184,803.72
本期期初	73,801.36	111,002.36	184,803.72
本期利润	292,048.46	-11,301.10	280,747.36
本期基金份额交易产生的变动数	62,683.21	119,159.82	181,843.03
其中：基金申购款	585,338.49	455,733.71	1,041,072.20
基金赎回款	-522,655.28	-336,573.89	-859,229.17
本期已分配利润	-	-	-
本期末	428,533.03	218,861.08	647,394.11

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	3,147.51
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	383.43
其他	50.32
合计	3,581.26

注：其他为结算保证金利息收入 50.32 元。

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	6,531,997.61
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	6,531,997.61

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	87,240,354.40
减：卖出股票成本总额	80,566,170.58
减：交易费用	142,186.21
买卖股票差价收入	6,531,997.61

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

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	6,961.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-105.00
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	6,856.53

6.4.7.15.2 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	1,114,796.49

额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,100,113.00
减：应计利息总额	14,788.49
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-105.00

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	54,383.60
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	54,383.60

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	1,135,750.04
股票投资	1,137,017.04
债券投资	-1,267.00
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	1,135,750.04

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	13,805.49
基金转换费收入	19.90
合计	13,825.39

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	1,507.27
其他	67.78
合计	1,575.05

注：其他为证券组合费 67.78 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

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

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

本基金本报告期内，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”）	与基金管理人受同一实际控制的公司、基金销售

银行”)	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

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	44,183,688.92	26.41	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

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	占当期债券 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例 (%)
国信证券	803,600.00	80.04	-	-

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	19,259.87	26.85	15,571.34	33.24
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（%）
-	-	-	-	-

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	104,161.18	103,582.74
其中：应支付销售机构的客户维护 费	46,385.95	44,003.71
应支付基金管理人的净管理费	57,775.23	59,579.03

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 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	17,360.21	17,263.83

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

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 0.8%。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

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金。

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	1,045,789.37	3,147.51	118,882.30	6,305.40

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

无。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	1,111,106.08
合计	-	1,111,106.08

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限在一年及一年以内的国债、政策性金融债、央行票据等。

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	907,204.19	-
合计	907,204.19	-

注：（1）债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

（2）未评级债券包括债券期限在及一年以上的国债、政策性金融债、央行票据等。

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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	--------	----------	-------	-------	-----	----

2026 年 6 月 30 日						
资产						
货币资金	1,045,789.37	—	—	—	—	1,045,789.37
结算备付金	133,615.61	—	—	—	—	133,615.61
存出保证金	22,314.97	—	—	—	—	22,314.97
交易性金融资产	—	907,204.19	—	—	16,041,686.52	16,948,890.71
应收股利	—	—	—	—	14,546.24	14,546.24
应收申购款	—	—	—	—	198,377.81	198,377.81
应收清算款	—	—	—	—	1,248,157.50	1,248,157.50
资产总计	1,201,719.95	907,204.19	—	—	17,502,768.07	19,611,692.21
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	95,003.29	95,003.29
应付管理人报酬	—	—	—	—	18,167.76	18,167.76
应付托管费	—	—	—	—	3,027.96	3,027.96
应付清算款	—	—	—	—	0.48	0.48
应付销售服务费	—	—	—	—	94.67	94.67
其他负债	—	—	—	—	46,853.72	46,853.72
负债总计	—	—	—	—	163,147.88	163,147.88
利率敏感度缺口	1,201,719.95	907,204.19	—	—	17,339,620.19	19,448,544.33
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	1,490,751.89	—	—	—	—	1,490,751.89
结算备付金	4,614.92	—	—	—	—	4,614.92
存出保证金	39,055.52	—	—	—	—	39,055.52
交易性金融资产	1,111,106.08	—	—	—	15,417,397.38	16,528,503.46
应收申购款	—	—	—	—	6,150.93	6,150.93
应收清算款	—	—	—	—	1,521,393.71	1,521,393.71
资产总计	2,645,528.41	—	—	—	16,944,942.02	19,590,470.43
负债						
应付赎回款	—	—	—	—	6,232.21	6,232.21

应付管理人报酬	-	-	-	-	19,439.86	19,439.86
应付托管费	-	-	-	-	3,239.98	3,239.98
应付清算款	-	-	-	-	57.40	57.40
应付销售服务费	-	-	-	-	36.08	36.08
其他负债	-	-	-	-	19,265.05	19,265.05
负债总计	-	-	-	-	48,270.58	48,270.58
利率敏感度缺口	2,645,528.41	-	-	-	16,896,671.44	19,542,199.85

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	市场利率减少25个基点	1,596.13	796.96
	市场利率增加25个基点	-1,584.98	-795.81

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。

本基金持有以非记账本位币人民币计价，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026年6月30日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,257,022.72	-	2,257,022.72
资产合计	-	2,257,022.72	-	2,257,022.72

以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	2, 257, 022. 72	-	2, 257, 022. 72
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民 币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的 资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的 负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净 额	-	-	-	-

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变 动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	所有外币相对人民 币升值 5%	112, 851. 14	-
	所有外币相对人民 币贬值 5%	-112, 851. 14	-

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，所面临的最大的

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	16,041,686.52	82.48	15,417,397.38	78.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	907,204.19	4.66	1,111,106.08	5.69
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	16,948,890.71	87.15	16,528,503.46	84.58

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	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	2,048,253.23	1,152,012.68
	沪深 300 指数下降 5%	-2,048,253.23	-1,152,012.68

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	16,041,686.52	15,417,397.38
第二层次	907,204.19	1,111,106.08
第三层次	—	—
合计	16,948,890.71	16,528,503.46

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金的净资产为人民币 19,448,544.33 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	16,041,686.52	81.80
	其中：股票	16,041,686.52	81.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	907,204.19	4.63
	其中：债券	907,204.19	4.63
	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	1,179,404.98	6.01
8	其他各项资产	1,483,396.52	7.56
9	合计	19,611,692.21	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	13,082,410.80	67.27
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	-	-
J	金融业	702,253.00	3.61
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	-	-
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	13,784,663.80	70.88

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非周期性消费品	-	-
周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	-	-
工业	-	-
信息科技	1,913,771.76	9.84
电信服务	343,250.96	1.76
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	2,257,022.72	11.61

注：以上分类采用全球行业分类标准。

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	688525	佰维存储	2,640	1,306,087.20	6.72
2	603228	景旺电子	18,000	1,303,380.00	6.70
3	002384	东山精密	4,400	1,154,340.00	5.94
4	688008	澜起科技	3,578	1,108,822.20	5.70
5	002008	大族激光	7,100	1,065,781.00	5.48
6	00981	中芯国际	13,000	1,009,428.81	5.19
7	300476	胜宏科技	2,700	935,361.00	4.81
8	002080	中材科技	10,300	927,000.00	4.77
9	06166	剑桥科技	6,900	904,342.95	4.65
10	300604	长川科技	2,600	887,692.00	4.56
11	600105	永鼎股份	12,900	870,492.00	4.48
12	603269	海鸥股份	51,620	850,181.40	4.37
13	300308	中际旭创	600	762,000.00	3.92
14	600926	杭州银行	48,400	699,380.00	3.60
15	600522	中天科技	9,200	558,256.00	2.87
16	603061	金海通	1,100	552,442.00	2.84
17	600487	亨通光电	4,000	437,360.00	2.25
18	300394	天孚通信	1,200	363,216.00	1.87

19	01024	快手-W	9,500	343,250.96	1.76
20	600030	中信证券	100	2,873.00	0.01

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	00981	中芯国际	2,821,258.39	14.44
2	01171	兖矿能源	2,633,982.46	13.48
3	00883	中国海洋石油	2,213,807.45	11.33
4	300502	新易盛	2,160,834.60	11.06
5	002938	鹏鼎控股	1,874,057.00	9.59
6	603228	景旺电子	1,856,195.00	9.50
7	603269	海鸥股份	1,770,979.40	9.06
8	002080	中材科技	1,621,241.00	8.30
9	688008	澜起科技	1,586,852.88	8.12
10	600392	盛和资源	1,371,668.00	7.02
11	688041	海光信息	1,339,929.09	6.86
12	600030	中信证券	1,318,558.00	6.75
13	600176	中国巨石	1,303,305.00	6.67
14	601088	中国神华	1,296,847.00	6.64
15	688072	拓荆科技	1,208,312.90	6.18
16	002008	大族激光	1,124,426.00	5.75
17	688012	中微公司	1,116,838.18	5.72
18	603444	吉比特	1,103,377.00	5.65
19	603259	药明康德	1,093,972.00	5.60
20	300476	胜宏科技	1,034,412.00	5.29
21	002463	沪电股份	1,031,774.00	5.28
22	002384	东山精密	1,030,361.00	5.27
23	002156	通富微电	992,956.00	5.08
24	03668	兖煤澳大利亚	979,251.78	5.01
25	600989	宝丰能源	909,804.00	4.66
26	603186	华正新材	909,199.00	4.65
27	06166	剑桥科技	905,150.66	4.63
28	300308	中际旭创	904,796.00	4.63
29	002709	天赐材料	901,605.00	4.61
30	601101	昊华能源	899,277.00	4.60
31	002475	立讯精密	858,075.00	4.39
32	000792	盐湖股份	857,403.00	4.39
33	600256	广汇能源	836,268.00	4.28
34	603993	洛阳钼业	766,300.00	3.92
35	603083	剑桥科技	762,608.00	3.90

36	603606	东方电缆	760,384.00	3.89
37	002382	蓝帆医疗	746,281.00	3.82
38	300677	英科医疗	742,815.60	3.80
39	00916	龙源电力	738,082.79	3.78
40	300604	长川科技	721,020.00	3.69
41	600926	杭州银行	720,846.00	3.69
42	300750	宁德时代	715,872.00	3.66
43	300236	上海新阳	712,891.00	3.65
44	300442	润泽科技	703,832.00	3.60
45	002653	海思科	689,968.00	3.53
46	600105	永鼎股份	674,526.00	3.45
47	688123	聚辰股份	650,412.27	3.33
48	002558	巨人网络	643,110.00	3.29
49	600160	巨化股份	585,668.00	3.00
50	600522	中天科技	568,806.00	2.91
51	300666	江丰电子	554,377.00	2.84
52	603296	华勤技术	553,866.00	2.83
53	600582	天地科技	553,656.00	2.83
54	601717	中创智领	552,790.00	2.83
55	600869	远东股份	552,750.00	2.83
56	601898	中煤能源	534,038.40	2.73
57	603019	中科曙光	518,128.00	2.65
58	000672	上峰材料	506,255.00	2.59
59	601138	工业富联	498,789.00	2.55
60	01024	快手-W	492,300.55	2.52
61	688525	佰维存储	484,444.17	2.48
62	600487	亨通光电	475,320.00	2.43
63	688018	乐鑫科技	462,264.25	2.37
64	300773	拉卡拉	456,520.00	2.34
65	300505	川金诺	450,255.00	2.30
66	603590	康辰药业	446,424.00	2.28
67	300620	光库科技	443,392.00	2.27
68	301345	涛涛车业	432,939.00	2.22
69	002925	盈趣科技	426,972.00	2.18
70	600183	生益科技	425,719.00	2.18
71	300695	兆丰股份	425,662.00	2.18
72	688332	中科蓝讯	419,234.67	2.15
73	600549	厦门钨业	415,624.00	2.13
74	603379	三美股份	412,368.00	2.11
75	300389	艾比森	405,218.00	2.07

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(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	002463	沪电股份	3,370,550.68	17.25
2	002938	鹏鼎控股	3,255,971.00	16.66
3	300502	新易盛	2,778,530.00	14.22
4	01171	兖矿能源	2,432,287.31	12.45
5	00883	中国海洋石油	2,154,870.60	11.03
6	600183	生益科技	2,145,017.00	10.98
7	688008	澜起科技	2,108,439.74	10.79
8	00981	中芯国际	2,000,006.84	10.23
9	688766	普冉股份	1,887,685.15	9.66
10	600176	中国巨石	1,620,651.00	8.29
11	688072	拓荆科技	1,460,893.00	7.48
12	688012	中微公司	1,436,851.35	7.35
13	600392	盛和资源	1,400,903.00	7.17
14	688041	海光信息	1,356,734.19	6.94
15	600030	中信证券	1,326,180.00	6.79
16	601088	中国神华	1,324,884.00	6.78
17	002156	通富微电	1,266,270.00	6.48
18	002080	中材科技	1,047,454.00	5.36
19	002409	雅克科技	1,031,605.00	5.28
20	603259	药明康德	1,012,703.00	5.18
21	603444	吉比特	996,038.00	5.10
22	603186	华正新材	955,517.00	4.89
23	688691	灿芯股份	937,400.68	4.80
24	603269	海鸥股份	913,602.00	4.68
25	603083	剑桥科技	897,820.00	4.59
26	600989	宝丰能源	875,740.00	4.48
27	002709	天赐材料	865,793.00	4.43
28	002475	立讯精密	851,496.00	4.36
29	601101	昊华能源	831,052.00	4.25
30	000792	盐湖股份	815,719.00	4.17
31	300442	润泽科技	814,733.00	4.17
32	600256	广汇能源	809,890.00	4.14
33	03668	兖煤澳大利亚	798,189.39	4.08
34	688123	聚辰股份	769,617.45	3.94
35	00916	龙源电力	733,686.81	3.75
36	300750	宁德时代	727,096.00	3.72
37	688525	佰维存储	718,808.60	3.68
38	603606	东方电缆	715,877.00	3.66
39	002382	蓝帆医疗	699,536.00	3.58
40	301308	江波龙	692,004.00	3.54
41	002653	海思科	691,332.00	3.54
42	000960	锡业股份	677,091.00	3.46

43	300236	上海新阳	658,685.00	3.37
44	300666	江丰电子	645,084.00	3.30
45	300677	英科医疗	644,228.00	3.30
46	603993	洛阳钼业	626,007.00	3.20
47	603296	华勤技术	606,903.00	3.11
48	002558	巨人网络	603,333.00	3.09
49	300308	中际旭创	589,310.00	3.02
50	600160	巨化股份	583,932.00	2.99
51	688065	凯赛生物	573,497.82	2.93
52	601216	君正集团	562,892.00	2.88
53	600869	远东股份	554,476.00	2.84
54	600582	天地科技	551,650.00	2.82
55	601717	中创智领	545,945.00	2.79
56	601138	工业富联	541,504.00	2.77
57	300003	乐普医疗	539,350.00	2.76
58	601898	中煤能源	539,291.42	2.76
59	601233	桐昆股份	517,610.00	2.65
60	300505	川金诺	510,647.00	2.61
61	601921	浙版传媒	508,033.89	2.60
62	600126	杭钢股份	501,562.00	2.57
63	300140	节能环保	492,788.00	2.52
64	600578	京能电力	483,652.00	2.47
65	300146	汤臣倍健	483,138.00	2.47
66	603019	中科曙光	481,132.00	2.46
67	000951	中国重汽	480,151.00	2.46
68	600884	杉杉股份	476,442.00	2.44
69	600801	华新建材	473,280.00	2.42
70	000672	上峰材料	472,310.00	2.42
71	002925	盈趣科技	469,659.00	2.40
72	002056	横店东磁	467,323.00	2.39
73	603228	景旺电子	462,751.00	2.37
74	600332	白云山	462,258.00	2.37
75	300773	拉卡拉	454,176.00	2.32
76	300888	稳健医疗	447,990.00	2.29
77	688018	乐鑫科技	446,900.94	2.29
78	300620	光库科技	443,477.00	2.27
79	688332	中科蓝讯	434,785.05	2.22
80	603590	康辰药业	429,947.00	2.20
81	300017	网宿科技	429,548.00	2.20
82	301018	申菱环境	413,166.00	2.11
83	300389	艾比森	408,700.00	2.09
84	600549	厦门钨业	407,540.00	2.09
85	603379	三美股份	397,122.00	2.03

86	300724	捷佳伟创	396,404.00	2.03
----	--------	------	------------	------

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	80,053,442.68
卖出股票收入（成交）总额	87,240,354.40

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	907,204.19	4.66
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）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	907,204.19	4.66

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	019771	25 国债 06	9,000	907,204.19	4.66

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

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

本基金本报告期末持仓股指期货。

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

本基金本报告期末持仓国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末持仓国债期货。

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

剑桥科技因进口集成电路、硅光芯片原产地申报不实，龙吴海关对其做出罚款的处罚措施。

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未超出基金合同规定的备选股票库。

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	22,314.97
2	应收清算款	1,248,157.50
3	应收股利	14,546.24
4	应收利息	-
5	应收申购款	198,377.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,483,396.52

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

无。

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 量化优选 混合 A	916	7,101.52	1,307,610.42	20.10	5,197,381.10	79.90
华润元大 量化优选 混合 C	362	1,003.75	-	-	363,357.32	100.00
合计	1,278	5,374.29	1,307,610.42	19.04	5,560,738.42	80.96

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（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（%）	92.55

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	华润元大量化优选混合 A	37,310.72	0.5736
	华润元大量化优选混合 C	-	-
	合计	37,310.72	0.5432

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	华润元大量化优选混合 A	0
	华润元大量化优选混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	华润元大量化优选混合 A	0~10
	华润元大量化优选混合 C	0
	合计	0~10

注：1、本期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人未持有本基金的数量。

2、本期末本基金的基金经理持有本基金的数量区间为 0 至 10 万份（含）。

3、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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	华润元大量化优选混合 A	华润元大量化优选混合 C
基金合同生效日 (2019 年 9 月 4 日) 基金份额总额	105,560,779.53	—
本报告期期初基金份额总额	10,269,174.93	222,800.84
本报告期基金总申购份额	1,091,878.19	819,020.77
减：本报告期基金总赎回份额	4,856,061.60	678,464.29
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	6,504,991.52	363,357.32

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

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 (%)	
申万宏源	2	52,230,043.91	31.22	22,772.76	31.74	—
国信证券	2	44,183,688.92	26.41	19,259.87	26.85	—
长江证券	2	35,467,402.03	21.20	14,271.26	19.89	—
西部证券	1	35,412,662.22	21.17	15,436.82	21.52	—

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	-	-	-	-	-
中信证券	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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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 (%)
申万宏源	100,008.00	9.96	-	-	-	-
国信证券	803,600.00	80.04	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	100,420.00	10.00	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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、证监会基金电子披露网站	2026 年 1 月 13 日
3	华润元大基金管理有限公司旗下基金	中国证券报、证券时报、	2026 年 1 月 22 日

	2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报、证券日报	
4	华润元大量化优选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	华润元大量化优选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	华润元大量化优选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（%）
机构	1	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 1 月 18 日	3,269,619.48	0.00	2,000,000.00	1,269,619.48	18.4851

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