

中欧瑾通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：中欧基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
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	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	61
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	61
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	61

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	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62
§ 8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 盈利投资者数量占比	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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	64
§ 9 开放式基金份额变动	64
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
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	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	65
10.4 基金投资策略的改变	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
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	65
10.8 其他重大事件	67
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录	68
12.2 存放地点	68
12.3 查阅方式	68

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金		
基金简称	中欧瑾通灵活配置混合		
基金主代码	002009		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015 年 11 月 17 日		
基金管理人	中欧基金管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	8,889,177,022.51 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	中欧瑾通灵活配置混合 A	中欧瑾通灵活配置混合 C	中欧瑾通灵活配置混合 E
下属分级基金的交易代码	002009	002010	018449
报告期末下属分级基金的份额总额	1,648,488,781.69 份	6,711,101,418.70 份	529,586,822.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*10%+中债综合指数收益率*85%+银行活期存款利率（税后）*5%
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和货币市场基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	方圆
	联系电话	021-68609600	95559
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95559
传真		021-50190017	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 8 层	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号

	10、16 层	
邮政编码	200120	200336
法定代表人	窦玉明	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路 479 号上海中心大厦 8、10、16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)		
	中欧瑾通灵活配置混合 A	中欧瑾通灵活配置混合 C	中欧瑾通灵活配置混合 E
本期已实现收益	28,487,150.62	91,639,693.38	5,772,995.39
本期利润	37,467,261.02	117,451,154.95	7,444,869.81
加权平均基金份额本期利润	0.0273	0.0197	0.0232
本期加权平均净值利润率	1.76%	1.33%	1.50%
本期基金份额净值增长率	2.30%	2.15%	2.31%
3.1.2 期末数据和	报告期末(2026 年 6 月 30 日)		

指标			
期末可供分配利润	764, 114, 742. 06	2, 725, 011, 822. 12	245, 043, 238. 62
期末可供分配基金份额利润	0. 4635	0. 4060	0. 4627
期末基金资产净值	2, 554, 573, 001. 88	9, 997, 184, 641. 46	820, 470, 380. 68
期末基金份额净值	1. 5496	1. 4896	1. 5493
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	77. 93%	71. 18%	16. 90%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、上述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧瑾通灵活配置混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0. 88%	0. 19%	1. 71%	0. 13%	-0. 83%	0. 06%
过去六个月	2. 30%	0. 20%	1. 59%	0. 12%	0. 71%	0. 08%
过去一年	6. 72%	0. 19%	2. 03%	0. 11%	4. 69%	0. 08%
过去三年	16. 52%	0. 21%	9. 12%	0. 14%	7. 40%	0. 07%
过去五年	21. 83%	0. 19%	-4. 18%	0. 37%	26. 01%	-0. 18%
过去七年	49. 30%	0. 18%	14. 07%	0. 46%	35. 23%	-0. 28%
过去十年	74. 10%	0. 17%	24. 05%	0. 49%	50. 05%	-0. 32%

自基金合同生效起 至今	77.93%	0.16%	26.16%	0.47%	51.77%	-0.31%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*5%，比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧瑾通灵活配置混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.80%	0.19%	1.71%	0.13%	-0.91%	0.06%
过去六个月	2.15%	0.20%	1.59%	0.12%	0.56%	0.08%
过去一年	6.40%	0.19%	2.03%	0.11%	4.37%	0.08%
过去三年	15.47%	0.21%	9.12%	0.14%	6.35%	0.07%
过去五年	20.02%	0.19%	-4.18%	0.37%	24.20%	-0.18%
过去七年	46.18%	0.18%	14.07%	0.46%	32.11%	-0.28%
过去十年	68.49%	0.17%	24.05%	0.49%	44.44%	-0.32%
自基金合同生效起 至今	71.18%	0.16%	26.16%	0.47%	45.02%	-0.31%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*5%，比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧瑾通灵活配置混合 E

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	0.88%	0.19%	1.71%	0.13%	-0.83%	0.06%
过去六个月	2.31%	0.20%	1.59%	0.12%	0.72%	0.08%
过去一年	6.72%	0.19%	2.03%	0.11%	4.69%	0.08%
过去三年	16.51%	0.21%	9.12%	0.14%	7.39%	0.07%
自基金份额起始运 作日至今	16.90%	0.20%	6.97%	0.17%	9.93%	0.03%

注：本基金业绩比较基准为：中债综合指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+银行活期存款

利率(税后)*5%，比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧瑾通灵活配置混合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



注：“自 2016 年 9 月 5 日起，业绩比较基准由金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）变更至沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。2023 年 8 月 8 日起组合业绩比较基准变更为中债综合指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+银行活期存款利率（税后）*5%。

”

中欧瑾通灵活配置混合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



注：“自 2016 年 9 月 5 日起，业绩比较基准由金融机构人民币三年期定期存款基准利率（税后）

变更至沪深 300 指数收益率*50%+中债综合指数收益率*50%。2023 年 8 月 8 日起组合业绩比较基准变更为中债综合指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*5%。

”

中欧瑾通灵活配置混合E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



注：2023 年 8 月 8 日起组合业绩比较基准变更为中债综合指数收益率*85%+沪深 300 指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*5%。本基金于 2023 年 5 月 5 日新增 E 类份额，图示日期为 2023 年 5 月 8 日至 2026 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）及自然人股东，注册资本为 2.20 亿元人民币，旗下设有北京分公司、深圳分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 243 只开放式基金。

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		
胡 闾 洋	基金经 理 / 基 金经 理助 理	2021-07- 30	-	10 年	历任中诚宝捷思货币经纪有限公司经纪人，上海光大证券资产管理有限公司交易员。2020-11-13 加入中欧基金管理有限公司。
华 李 成	多资产 投决会 委员 / 多资产 多元配 置组组 长 / 基 金经 理	2018-03- 29	-	11 年	历任浦银安盛基金管理有限公司固定收益研究员、专户产品投资经理。2016-05-09 加入中欧基金管理有限公司，历任投资经理助理、投资经理、多资产公募组组长。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中胡闾洋担任本基金的基金经理助理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《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，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，为基金份额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，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，不同投资组合之间不存在非公平交易或利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 9 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年股票指数一波三折、震荡上行，在相对平淡的指数背后，市场上演了极致的结构分化，债券则在震荡中打开局面，取得了明显好于年初预期的市场表现。上半年中证 800 指数上涨 11.12%，中债-1-5 年债券综合财富（总值）指数上涨 1.59%。

上半年宏观环境的重要变化是 AI 从产业主题上升为宏观层面的关键矛盾。AI 相关的资本开支与出口高速扩张，成为拉动全球制造业景气与我国外需的重要力量，但这种带动作用高度集中于少数环节；与此同时，实体部门信贷需求依然疲弱，传统内需的修复动能偏缓。经济因此呈现出明显的“K 型分化”：与 AI 产业链相关的领域景气度持续上行，而与之关联度较低的传统行业则持续承压，在总量数据相对平稳的表象之下，结构性分化不断加大。二季度美伊冲突的升级与反复，进一步强化了这一分化——地缘风险主要通过价格冲击和供应链扰动压制了传统部门补库的能力和意愿，而 AI 驱动下强劲的外需又降低了对内需进行政策刺激的迫切性。因此，冲突并未改变分化的方向，只是让“强者更强、弱者更弱”的特征更为鲜明。

股票市场一、二季度表现迥异，美伊冲突成为关键分水岭。一季度市场延续去年末走势，指数先扬后抑：1 月板块轮动加快，AI 应用、商业航天、有色金属轮番走强；2 月“涨价”主线向资源与中游制造扩散；3 月美伊冲突升级压制风险偏好，资金阶段性转向资源与红利等防御方向。进入二季度，伴随市场对 AI 产业趋势逐步形成共识，风格与行业分化自 4 月起明显加剧。与过往相比，本轮行情的信息传播与资金流动的速度显著加快，共识一旦形成，资金便迅速向少数方向集中，趋势由此被大幅强化，形成典型的正反馈。这一过程在 6 月演绎到极致状态：市场被割裂为 AI 与非 AI 两个世界，AI 相关方向持续领涨并创出新高，而周期、消费、红利乃至微盘方向则普遍失血。成长与价值风格的分化度达到历史高位，指数层面的表现掩盖了个股层面的弱势，投资者实际体感与指数走势明显背离。资金虹吸效应之下，市场广度下降明显且筹码结构高度集中，显著增加了投资的难度。

债券市场则给出了与年初预期截然不同的答案。年初市场对债市普遍预期不高：一方面收益率已处历史低位，另一方面通胀预期和风险偏好也对走势有所压制。但回顾上半年，资金利率的低位平稳运行以及信贷需求偏弱的格局，构成了债市坚实的支撑。4 月以来增长动能的边际回落则提供了来自基本面的向下牵引。二者共同作用之下，债券的风险收益比显著回归，赚钱效应良好，与年初的偏弱预期形成鲜明反差。

上半年组合坚持资产配置理念，适时调整组合股债配置。股票方面，组合采用多策略管理框架，充分发挥不同策略间的分散化效果来平滑组合波动，并通过策略配置权重调整来更好地契合

市场节奏，也积极通过主动选股力求获得超额收益；债券方面，组合在坚持高等级信用债配置策略的基础上，也积极根据市场情况调节债券久期；转债方面，组合根据市场走势和投资判断，通过转债策略参与转债投资，努力把握市场机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 2.30%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%；基金 C 类份额净值增长率为 2.15%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%；基金 E 类份额净值增长率为 2.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.59%。

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，AI 仍是宏观层面最关键的矛盾，但其演进路径的不确定性并不低。当前市场对 AI 的乐观定价，本质上建立在两个尚待验证的前提之上：一是模型能力能否延续此前的提升斜率，二是这种能力提升能否真实转化为对劳动生产率的拉动。前者决定产业投入的持续性，后者决定这一轮资本开支最终能否形成有效回报、并扩散为全社会的效率改善。就目前的证据看，两个问题都还没有明确结论——模型迭代的边际效果、商业化落地的深度与广度，以及监管态度的变化，都可能在未来数个季度出现反复。因此我们对 AI 的中长期意义保持开放与敬畏，但不对其节奏做过度线性的推演，更倾向于边走边看，跟随产业与业绩的实际兑现来修正判断。

这一不确定性正在向政策层面传导。中美两国的财政与货币政策取向都在不同程度上受到 AI 的影响：AI 相关投资与出口的强劲，客观上缓解了总需求的压力，也降低了政策进一步宽松的紧迫性；而 AI 对通胀、就业乃至资产价格的影响方向并不一致，使得政策当局的反应函数变得更为复杂。短期看，在 AI 景气延续、传统内需仍待修复的组合之下，K 型分化的格局大概率仍将保持；但中期看，无论是财政发力的力度与方向，还是货币政策的节奏，能见度都比过去明显下降。

落实到投资上，我们的应对思路是明确的：当宏观的可预期性下降时，工作重心应当从“预测”转向“应对”，并为潜在的高波动环境提前准备预案，而非把组合押注于单一情景。股票方面，我们倾向于让风格回归均衡，避免在极致分化的位置继续加大单一方向的暴露。AI 方向上，考虑到上游算力环节的预期与估值已较为充分，我们更多在大模型、云以及应用等下游领域寻找机会，这些环节的价值兑现虽然更晚，但空间与赔率可能相对更好；非 AI 方向上则不做整体性的风格押注，而是回到公司层面，自下而上挖掘经营改善、竞争格局优化或估值显著低估的点状投资机会。债券方面，在实体信贷需求出现新的增长点之前，目前的格局难以逆转，我们预计债市或将保持震荡偏强的走势，票息与久期的配置价值可能依然存在。

复盘近期的市场走势，也让我们对自身的能力边界有了更清晰的认识：在一个信息传播极快、趋势自我强化的市场中，试图什么都参与，往往意味着什么都做不好。因此我们更愿意专注于自

已最认可、也最有可能做好的事，并通过持续的重复把它变成肌肉记忆。下阶段，我们的工作重点将放在分域择时上，具体分为三个步骤：一是市场状态识别，判断当前所处的波动与相关性环境；二是因子暴露调整，据此动态管理组合在各类风格与风险因子上的敞口；三是观点的有效表达，确保每一个判断都以合适的仓位与工具落到组合之中。我们希望通过这三步的持续打磨，提高组合在不同市场环境下的适应能力。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、战略规划及业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内进行了利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。详见下述报告中“利润分配情况”。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

§ 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，基金托管人在中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守

了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，中欧基金管理有限公司在中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，由中欧基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧瑾通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	26,988,064.50	203,521,060.30
结算备付金		18,877,977.15	23,112,206.13
存出保证金		22,057,964.32	368,624.58
交易性金融资产	6.4.7.2	13,040,001,202.75	6,847,672,745.83
其中：股票投资		1,975,035,191.38	1,053,273,676.28
基金投资		—	—
债券投资		11,064,966,011.37	5,794,399,069.55
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	200,010,410.96	—
债权投资		—	—
其中：债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
其他投资		—	—
其他债权投资		—	—
其他权益工具投资		—	—

应收清算款		140,406,837.71	51,920,520.27
应收股利		—	—
应收申购款		28,130,514.95	38,225,035.17
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.5	—	—
资产总计		13,476,472,972.34	7,164,820,192.28
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		—	240,030,370.64
应付清算款		16,632,965.85	2,356,572.09
应付赎回款		71,952,633.35	284,119,349.72
应付管理人报酬		6,613,255.45	3,569,403.26
应付托管费		1,653,313.87	892,350.85
应付销售服务费		2,532,644.36	1,324,392.31
应付投资顾问费		—	—
应交税费		360,520.50	145,874.92
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.6	4,499,614.94	1,390,308.44
负债合计		104,244,948.32	533,828,622.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	8,889,177,022.51	4,441,366,002.28
未分配利润	6.4.7.8	4,483,051,001.51	2,189,625,567.77
净资产合计		13,372,228,024.02	6,630,991,570.05
负债和净资产总计		13,476,472,972.34	7,164,820,192.28

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 8,889,177,022.51 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.5496 元，基金份额总额 1,648,488,781.69 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.4896 元，基金份额总额 6,711,101,418.70 份；下属 E 类基金份额净值为人民币 1.5493 元，基金份额总额 529,586,822.12 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧瑾通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		218,292,113.18	60,062,755.92
1. 利息收入		1,017,491.27	178,732.52
其中：存款利息收入	6.4.7.9	309,347.99	38,800.86
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		708,143.28	139,931.66
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		175,199,510.96	66,527,390.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	53,532,388.87	265,799.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	110,298,639.04	59,699,411.88
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-5,069,326.49	-
股利收益	6.4.7.14	16,437,809.54	6,562,178.86
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	36,463,446.39	-6,948,580.19
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,611,664.56	305,212.96
减：二、营业总支出		55,928,827.40	13,534,021.87
1. 管理人报酬		33,920,901.17	6,855,139.40
2. 托管费		8,480,225.31	1,713,784.88
3. 销售服务费		13,080,575.11	2,140,811.56
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		107,088.75	2,661,316.51
其中：卖出回购金融资产支出		107,088.75	2,661,316.51
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		205,096.91	43,252.91
8. 其他费用	6.4.7.18	134,940.15	119,716.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		162,363,285.78	46,528,734.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		162,363,285.78	46,528,734.05

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		162,363,285.78	46,528,734.05

6.3 净资产变动表

会计主体：中欧瑾通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	4,441,366,002.28	-	2,189,625,567.77	6,630,991,570.05
二、本期期初净资产	4,441,366,002.28	-	2,189,625,567.77	6,630,991,570.05
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	4,447,811,020.23	-	2,293,425,433.74	6,741,236,453.97
(一)、综合收益总额	-	-	162,363,285.78	162,363,285.78
(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)	4,447,811,020.23	-	2,255,567,901.06	6,703,378,921.29
其中：1. 基金申购款	9,516,184,635.97	-	4,767,555,538.19	14,283,740,174.16
2. 基金赎回款	-5,068,373,615.74	-	-2,511,987,637.13	-7,580,361,252.87
(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)	-	-	-124,505,753.10	-124,505,753.10
四、本期期末净资产	8,889,177,022.51	-	4,483,051,001.51	13,372,228,024.02
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	1,384,254,177.32	-	648,610,303.88	2,032,864,481.20
二、本期期初净资产	1,384,254,177.32	-	648,610,303.88	2,032,864,481.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	268,625,623.73	-	129,331,526.71	397,957,150.44
(一)、综合收益总额	-	-	46,528,734.05	46,528,734.05
(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)	268,625,623.73	-	128,223,981.11	396,849,604.84
其中：1. 基金申购款	765,465,428.18	-	350,131,353.95	1,115,596,782.13
2. 基金赎回款	-496,839,804.45	-	-221,907,372.84	-718,747,177.29
(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)	-	-	-45,421,188.45	-45,421,188.45
四、本期期末净资产	1,652,879,801.05	-	777,941,830.59	2,430,821,631.64

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：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]第 1241 号《关于准予中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧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《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,500,194,086.79 元，经向中国证监会备案，《中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 11 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,500,194,086.79 份基金份额，本基金募集期间未产生利息折份额，其中瑾通 A 的基金份额总额为 290.68 份，瑾通 C 的基金份额总额为 2,500,193,796.11 份。本基金最新情况见 2. 基金简介。

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〉》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号〈货币市场基金信息披露特别规定〉》，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 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1. 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。

2. 增值税

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、债券取得的收入及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。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地

方教育附加。

4. 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。

5. 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。

6. 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	26,988,064.50

等于：本金	26,978,544.56
加：应计利息	9,519.94
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	26,988,064.50

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		1,908,053,945.08	-	1,975,035,191.38	66,981,246.30
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	609,682,343.74	5,768,921.64	616,856,721.64	1,405,456.26
	银行间市场	10,314,896,099.13	84,509,389.73	10,448,109,289.73	48,703,800.87
	合计	10,924,578,442.87	90,278,311.37	11,064,966,011.37	50,109,257.13
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		12,832,632,387.95	90,278,311.37	13,040,001,202.75	117,090,503.43

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍	-	-	-	-

生工具				
权益衍生工具	-160,662,880.00	-	-	-
其中：股指期货投资	-160,662,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-160,662,880.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2607	IM2607	-100.00	-173,792,000.00	-13,129,120.00
合计				-13,129,120.00
减：可抵销期货暂收款				-13,129,120.00
净额				0.00

注：1. 衍生金融资产项下的衍生工具为期货投资，净额为人民币 0 元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币 0 元。

2. 买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	200,010,410.96	-
合计	200,010,410.96	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	20,181.40
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,379,474.46
其中：交易所市场	4,313,291.23
银行间市场	66,183.23
应付利息	-
预提费用-信息披露费	59,507.37
预提费用-审计费	39,671.58
应付转出费	528.18
应付补差费	251.95
合计	4,499,614.94

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

中欧瑾通灵活配置混合 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	940,562,168.69	940,562,168.69
本期申购	1,176,318,248.31	1,176,318,248.31
本期赎回（以“-”号填列）	-468,391,635.31	-468,391,635.31
本期末	1,648,488,781.69	1,648,488,781.69

中欧瑾通灵活配置混合 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	3,348,026,609.80	3,348,026,609.80
本期申购	7,871,971,332.04	7,871,971,332.04
本期赎回（以“-”号填列）	-4,508,896,523.14	-4,508,896,523.14
本期末	6,711,101,418.70	6,711,101,418.70

中欧瑾通灵活配置混合 E

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	152,777,223.79	152,777,223.79
本期申购	467,895,055.62	467,895,055.62
本期赎回（以“-”号填列）	-91,085,457.29	-91,085,457.29
本期末	529,586,822.12	529,586,822.12

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。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

中欧瑾通灵活配置混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	432,904,503.00	71,420,850.17	504,325,353.17
本期期初	432,904,503.00	71,420,850.17	504,325,353.17
本期利润	28,487,150.62	8,980,110.40	37,467,261.02
本期基金份额交易产生的变动数	327,602,993.68	61,568,517.56	389,171,511.24
其中：基金申购款	545,465,293.00	100,999,107.49	646,464,400.49
基金赎回款	-217,862,299.32	-39,430,589.93	-257,292,889.25
本期已分配利润	-24,879,905.24	-	-24,879,905.24
本期末	764,114,742.06	141,969,478.13	906,084,220.19

中欧瑾通灵活配置混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,356,343,539.27	247,093,456.92	1,603,436,996.19
本期期初	1,356,343,539.27	247,093,456.92	1,603,436,996.19
本期利润	91,639,693.38	25,811,461.57	117,451,154.95
本期基金份额交易产生的变动数	1,371,560,894.12	288,166,482.15	1,659,727,376.27
其中：基金申购款	3,208,759,148.28	655,783,715.37	3,864,542,863.65
基金赎回款	-1,837,198,254.16	-367,617,233.22	-2,204,815,487.38
本期已分配利润	-94,532,304.65	-	-94,532,304.65
本期末	2,725,011,822.12	561,071,400.64	3,286,083,222.76

中欧瑾通灵活配置混合 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	70,193,503.08	11,669,715.33	81,863,218.41
本期期初	70,193,503.08	11,669,715.33	81,863,218.41
本期利润	5,772,995.39	1,671,874.42	7,444,869.81
本期基金份额交易产生的变动数	174,170,283.36	32,498,730.19	206,669,013.55
其中：基金申购款	216,459,327.49	40,088,946.56	256,548,274.05
基金赎回款	-42,289,044.13	-7,590,216.37	-49,879,260.50
本期已分配利润	-5,093,543.21	-	-5,093,543.21
本期末	245,043,238.62	45,840,319.94	290,883,558.56

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	174,267.12
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	119,895.09
其他	15,185.78
合计	309,347.99

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	7,140,555,022.94
减：卖出股票成本总额	7,075,888,067.86
减：交易费用	11,134,566.21
买卖股票差价收入	53,532,388.87

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	101,843,633.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,455,005.74
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	110,298,639.04

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,241,459,935.51
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,187,211,437.33
减：应计利息总额	45,697,657.44
减：交易费用	95,835.00
买卖债券差价收入	8,455,005.74

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
国债期货投资收益	-1,876,999.97
股指期货投资收益	-3,192,326.52

6.4.7.14 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	16,437,809.54
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	16,437,809.54

6.4.7.15 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	49,592,566.39
股票投资	4,915,466.31
债券投资	44,677,100.08
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-13,129,120.00
权证投资	-
期货投资	-13,129,120.00
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	36,463,446.39

6.4.7.16 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	5,294,659.73
基金转换费收入	317,004.83
合计	5,611,664.56

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	17,161.20
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	134,940.15

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司（“国都证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东
上海中欧财富基金销售有限公司（“中欧财富”）	基金管理人的控股子公司、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（%）

国都证券	1,243,007,364.23	8.22	156,974,949.33	6.71
------	------------------	------	----------------	------

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（%）
国都证券	367,864,413.47	100.00	249,278,738.40	20.91

6.4.10.1.3 债券回购交易

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	占当期债券回 购 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（%）
国都证券	50,000,000.00	7.44	154,500,000.00	3.83

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（%）
国都证券	541,824.23	8.22	403,971.30	9.37
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（%）
国都证券	68,425.36	6.71	30,835.40	4.93

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

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	33,920,901.17	6,855,139.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,110,516.77	2,545,702.17
应支付基金管理人的净管理费	19,810,384.40	4,309,437.23

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.60% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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	8,480,225.31	1,713,784.88

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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			
	中欧瑾通灵活配置混合 A	中欧瑾通灵活配置混合 C	中欧瑾通灵活配置混合 E	合计

国都证券	0.00	1,787.14	0.00	1,787.14
交通银行股份有限公司	0.00	149,704.37	0.00	149,704.37
中欧财富	0.00	15,858.32	0.00	15,858.32
中欧基金	0.00	434,445.83	0.00	434,445.83
合计	0.00	601,795.66	0.00	601,795.66
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			
	中欧瑾通灵活配置混合 A	中欧瑾通灵活配置混合 C	中欧瑾通灵活配置混合 E	合计
国都证券	0.00	134.90	0.00	134.90
交通银行股份有限公司	0.00	140,014.99	0.00	140,014.99
中欧财富	0.00	7,964.25	0.00	7,964.25
中欧基金	0.00	210,818.27	0.00	210,818.27
合计	0.00	358,932.41	0.00	358,932.41

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的年销售服务费费率为 0.30%，本基金 E 类基金份额不收取销售服务费。计算方法如下：

$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧瑾通灵活配置混合 E

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
报告期初持有的基金份额	0.00	69,354.09
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	69,354.09
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00	0.17%

注：1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金各类基金份额，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

3、本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金 A 类基金份额、C 类基金份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

中欧瑾通灵活配置混合 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	131,779.80	0.01%	131,760.74	0.01%

份额单位：份

中欧瑾通灵活配置混合 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	17,528.05	0.00%	17,640.93	0.00%

份额单位：份

中欧瑾通灵活配置混合 E

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
自然人股东	4,000,000.00	0.76%	4,929,626.03	3.23%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

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
交通银行股份有限公司	26,988,064.50	174,267.12	8,327,565.23	11,261.10

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

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

单位：人民币元

中欧瑾通灵活配置混合 A								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 20 日	-	2026 年 1 月 20 日	0.1550	8,090,950.90	7,910,910.33	16,001,861.23	-
2	2026 年 4 月 15 日	-	2026 年 4 月 15 日	0.0620	5,574,074.84	3,303,969.17	8,878,044.01	-
合	-	-	-	0.2170	13,665,02	11,214,879	24,879,90	-

计					5.74	.50	5.24	
中欧瑾通灵活配置混合 C								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 20 日	-	2026 年 1 月 20 日	0.1490	38,534,54 0.19	15,525,611 .81	54,060,15 2.00	-
2	2026 年 4 月 15 日	-	2026 年 4 月 15 日	0.0600	29,574,39 0.33	10,897,762 .32	40,472,15 2.65	-
合计	-	-	-	0.2090	68,108,93 0.52	26,423,374 .13	94,532,30 4.65	-
中欧瑾通灵活配置混合 E								
序号	权益 登记日	除息日		每 10 份基 金份额分 红数	现金形 式 发放总 额	再投资形 式 发放总额	本期利 润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2026 年 1 月 20 日	-	2026 年 1 月 20 日	0.1550	1,837,012 .02	1,162,786. 74	2,999,798 .76	-
2	2026 年 4 月 15 日	-	2026 年 4 月 15 日	0.0620	1,516,760 .81	576,983.64	2,093,744 .45	-
合计	-	-	-	0.2170	3,353,772 .83	1,739,770. 38	5,093,543 .21	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券 代码	证 券 名 称	成功 认购 日	受限 期	流通 受限 类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 （单 位： 股）	期末 成本总额	期末估值总 额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股 流通 受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股 流通 受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-

	源									
001248	华 润 新 能 源	2026 年 6 月 24 日	1 个月 内 (含)	新股 未上 市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001257	盛 龙 股 份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福 恩 股 份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股 流通 受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天 海 电 子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股 流通 受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维 通 利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠 科 股 份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301513	尚 水 智 能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股 流通 受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春 光 集 团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理 奇 智 能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股 流通 受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大 普 微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高 特	2026 年 6	6 个月	新股 流通	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-

	电子	月 2 日		受限						
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
603435	嘉德	2026 年 5	6 个月	新股流通	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-

	利	月 15 日		受限						
603459	红 板 科 技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股 流通 受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长 进 光 子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北 芯 生 命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股 流通 受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视 涯 科 技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股 流通 受限	22.68	47.61	1,300	29,484.00	61,893.00	-
688785	恒 运 昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股 流通 受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688797	臻 宝 科 技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联 讯 仪 器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有 研 复 材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股 流通 受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰 金 新 能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股 流通 受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易 思 维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股 流通 受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电 科	2026 年 2	6 个月	新股 流通	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

	蓝天	月 3 日		受限						
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

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
688121	*ST卓然	2026 年 5 月 6 日	重大事项停牌	6.48	2026 年 7 月 7 日	5.18	792,571	6,396,407.86	5,135,860.08	-
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	4,573	3,207,753.90	4,022,090.69	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金在严格控制投资

组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。 本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心，督察长、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行审议和决策。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金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。

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	151,410,734.25	131,992,146.85
合计	151,410,734.25	131,992,146.85

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以下未有三方评级的一般短期融资券、政策银行债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有短期信用评级的同业存单。

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	4,522,325,624.59	2,889,402,094.35
AAA 以下	175,918,475.95	203,235,646.03
未评级	6,215,311,176.58	2,569,769,182.32
合计	10,913,555,277.12	5,662,406,922.70

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。2. 未评级债券为期限在一年以上未有三方评级的地方政府债、国债、一般公司债、一般企业债、一般中期票据、政策银行债。3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期与上期末基金均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人

管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

于 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注 6.4.12 披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	26,988,064.50	-	-	-	26,988,064.50
结算备付金	18,877,977.15	-	-	-	18,877,977.15

存出保证金	1,202,924.32	-	-	20,855,040.00	22,057,964.32
交易性金融资产	1,247,294,454.73	7,263,608,842.51	2,554,062,714.13	1,975,035,191.38	13,040,001,202.75
买入返售金融资产	200,010,410.96	-	-	-	200,010,410.96
应收申购款	-	-	-	28,130,514.95	28,130,514.95
应收清算款	-	-	-	140,406,837.71	140,406,837.71
资产总计	1,494,373,831.66	7,263,608,842.51	2,554,062,714.13	2,164,427,584.04	13,476,472,972.34
负债					
应付赎回款	-	-	-	71,952,633.35	71,952,633.35
应付管理人报酬	-	-	-	6,613,255.45	6,613,255.45
应付托管费	-	-	-	1,653,313.87	1,653,313.87
应付清算款	-	-	-	16,632,965.85	16,632,965.85
应付销售服务费	-	-	-	2,532,644.36	2,532,644.36
应交税费	-	-	-	360,520.50	360,520.50
其他负债	-	-	-	4,499,614.94	4,499,614.94
负债总计	-	-	-	104,244,948.32	104,244,948.32
利率敏感度缺口	1,494,373,831.66	7,263,608,842.51	2,554,062,714.13	2,060,182,635.72	13,372,228,024.02
上年度末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	203,521,060.30	-	-	-	203,521,060.30
结算备付金	23,112,206.13	-	-	-	23,112,206.13
存出保证金	368,624.58	-	-	-	368,624.58
交易性金融资产	608,565,194.53	4,952,658,140.18	233,175,734.84	1,053,273,676.28	6,847,672,745.83
应收申购款	-	-	-	38,225,035.17	38,225,035.17
应收清算款	-	-	-	51,920,520.27	51,920,520.27
资产总计	835,567,085.54	4,952,658,140.18	233,175,734.84	1,143,419,231.72	7,164,820,192.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	284,119,349.72	284,119,349.72
应付管理人报酬	-	-	-	3,569,403.26	3,569,403.26
应付托管费	-	-	-	892,350.85	892,350.85
应付清算款	-	-	-	2,356,572.09	2,356,572.09
卖出回购金融资产款	240,030,370.64	-	-	-	240,030,370.64
应付销售服务费	-	-	-	1,324,392.31	1,324,392.31
应交税费	-	-	-	145,874.92	145,874.92

其他负债	-	-	-	1,390,308.44	1,390,308.44
负债总计	240,030,370.64	-	-	293,798,251.59	533,828,622.23
利率敏感度缺口	595,536,714.90	4,952,658,140.18	233,175,734.84	849,620,980.13	6,630,991,570.05

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026年6月30日）	上年度末（2025年12月31日）
	利率上升 25BP	-98,898,025.16	-36,844,995.58
	利率下降 25BP	100,740,550.43	37,316,598.63

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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	1,975,035,191.38	14.77	1,053,273,676.28	15.88
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	1,975,035,191.38	14.77	1,053,273,676.28	15.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 14.77%（2025 年 12 月 31 日：15.88%），因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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	1,962,806,163.16	1,050,622,058.76
第二层次	11,074,974,253.58	5,794,399,069.55
第三层次	2,220,786.01	2,651,617.52
合计	13,040,001,202.75	6,847,672,745.83

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关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

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	1,975,035,191.38	14.66
	其中：股票	1,975,035,191.38	14.66
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	11,064,966,011.37	82.11
	其中：债券	11,064,966,011.37	82.11
	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	200,010,410.96	1.48
	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	45,866,041.65	0.34
8	其他各项资产	190,595,316.98	1.41
9	合计	13,476,472,972.34	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	34,394,834.00	0.26
B	采矿业	44,504,060.12	0.33
C	制造业	1,362,326,863.61	10.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,486,607.44	0.14
E	建筑业	4,866,902.00	0.04
F	批发和零售业	6,541,116.00	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	73,943,878.46	0.55
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	252,813,753.83	1.89
J	金融业	96,528,549.00	0.72
K	房地产业	39,975,479.61	0.30
L	租赁和商务服务业	3,662,840.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	31,355,531.31	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	4,454,094.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	114,192.00	0.00
Q	卫生和社会工作	704,802.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	361,688.00	0.00
S	综合	—	—
	合计	1,975,035,191.38	14.77

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688777	中控技术	1,400,000	164,500,000.00	1.23
2	002371	北方华创	81,339	71,949,225.84	0.54
3	300308	中际旭创	53,900	68,453,000.00	0.51
4	601872	招商轮船	3,546,700	62,315,519.00	0.47
5	688041	海光信息	163,770	60,644,031.00	0.45
6	600519	贵州茅台	44,200	52,398,658.00	0.39
7	300750	宁德时代	129,100	50,737,591.00	0.38
8	688256	寒武纪	29,384	46,883,641.20	0.35
9	688630	芯碁微装	80,000	43,951,200.00	0.33
10	601138	工业富联	559,298	40,353,350.70	0.30
11	001979	招商蛇口	6,054,327	38,929,322.61	0.29
12	002008	大族激光	256,500	38,503,215.00	0.29
13	601318	中国平安	718,100	34,282,094.00	0.26

14	002493	荣盛石化	3,182,400	34,210,800.00	0.26
15	002156	通富微电	400,000	30,348,000.00	0.23
16	603259	药明康德	236,400	29,434,164.00	0.22
17	002714	牧原股份	840,500	29,409,095.00	0.22
18	000977	浪潮信息	415,100	29,057,000.00	0.22
19	300737	科顺股份	4,288,600	28,176,102.00	0.21
20	300274	阳光电源	171,800	27,319,636.00	0.20
21	688180	君实生物	750,000	25,365,000.00	0.19
22	300394	天孚通信	79,900	24,184,132.00	0.18
23	600549	厦门钨业	266,800	22,731,360.00	0.17
24	601038	一拖股份	2,000,000	21,180,000.00	0.16
25	002475	立讯精密	273,000	19,219,200.00	0.14
26	603345	安井食品	220,400	17,673,876.00	0.13
27	603986	兆易创新	21,400	17,441,000.00	0.13
28	300502	新易盛	25,440	15,442,080.00	0.12
29	002648	卫星化学	517,000	12,144,330.00	0.09
30	600276	恒瑞医药	215,100	11,193,804.00	0.08
31	688578	艾力斯	100,077	10,928,408.40	0.08
32	002270	华明装备	499,993	9,424,868.05	0.07
33	688012	中微公司	19,673	9,216,800.50	0.07
34	000703	恒逸石化	637,100	8,645,447.00	0.06
35	600150	中国船舶	254,700	8,606,313.00	0.06
36	601899	紫金矿业	337,500	8,484,750.00	0.06
37	301358	湖南裕能	103,200	7,829,784.00	0.06
38	600320	振华重工	1,866,100	7,706,993.00	0.06
39	688981	中芯国际	47,571	7,555,226.22	0.06
40	600623	华谊集团	898,800	7,253,316.00	0.05
41	000810	创维数字	544,900	7,219,925.00	0.05
42	603288	海天味业	212,000	7,029,920.00	0.05
43	600887	伊利股份	292,900	7,017,884.00	0.05
44	600037	歌华有线	1,111,200	6,967,224.00	0.05
45	688498	源杰科技	3,632	6,849,952.00	0.05
46	002466	天齐锂业	110,300	6,763,596.00	0.05
47	300769	德方纳米	101,300	6,736,450.00	0.05
48	688059	华锐精密	33,414	6,673,109.94	0.05
49	300054	鼎龙股份	61,700	6,538,349.00	0.05
50	688700	东威科技	72,916	6,518,690.40	0.05
51	301031	中熔电气	54,000	6,450,300.00	0.05
52	600036	招商银行	181,200	6,432,600.00	0.05
53	300681	英搏尔	222,900	6,379,398.00	0.05
54	688503	聚和材料	48,063	6,377,960.10	0.05
55	301377	鼎泰高科	11,200	6,170,080.00	0.05
56	688308	欧科亿	31,911	5,801,738.91	0.04

57	000049	德赛电池	245,100	5,727,987.00	0.04
58	001339	智微智能	55,300	5,656,084.00	0.04
59	300438	鹏辉能源	68,200	5,650,370.00	0.04
60	002079	苏州固锟	366,800	5,513,004.00	0.04
61	000333	美的集团	71,100	5,370,183.00	0.04
62	002838	道恩股份	174,900	5,355,438.00	0.04
63	688008	XD 澜起科	17,277	5,354,142.30	0.04
64	601069	西部黄金	236,700	5,207,400.00	0.04
65	002384	东山精密	19,600	5,142,060.00	0.04
66	688121	*ST 卓然	792,571	5,135,860.08	0.04
67	601500	通用股份	1,388,400	5,067,660.00	0.04
68	600971	恒源煤电	730,500	5,040,450.00	0.04
69	000949	新乡化纤	780,600	4,949,004.00	0.04
70	000709	河钢股份	2,541,400	4,930,316.00	0.04
71	600900	长江电力	180,400	4,775,188.00	0.04
72	600522	中天科技	77,800	4,720,904.00	0.04
73	000725	京东方 A	537,900	4,668,972.00	0.03
74	000589	贵州轮胎	1,147,800	4,660,068.00	0.03
75	002439	启明星辰	362,200	4,581,830.00	0.03
76	601208	东材科技	64,500	4,565,955.00	0.03
77	000933	神火股份	215,300	4,564,360.00	0.03
78	300073	当升科技	94,600	4,544,584.00	0.03
79	000519	中兵红箭	207,500	4,372,025.00	0.03
80	002281	光迅科技	17,000	4,367,980.00	0.03
81	600884	杉杉股份	321,200	4,352,260.00	0.03
82	603507	振江股份	128,092	4,212,945.88	0.03
83	601166	兴业银行	246,600	4,083,696.00	0.03
84	600030	中信证券	142,000	4,079,660.00	0.03
85	688275	万润新能	31,831	4,060,044.05	0.03
86	688072	拓荆科技	4,573	4,022,090.69	0.03
87	300590	移为通信	279,400	4,009,390.00	0.03
88	688536	思瑞浦	10,973	3,995,159.57	0.03
89	002812	恩捷股份	59,400	3,974,454.00	0.03
90	600487	亨通光电	36,000	3,936,240.00	0.03
91	600183	生益科技	22,600	3,918,840.00	0.03
92	688002	睿创微纳	25,329	3,918,143.01	0.03
93	300432	富临精工	194,900	3,915,541.00	0.03
94	600499	科达制造	282,500	3,898,500.00	0.03
95	688521	芯原股份	10,461	3,882,495.54	0.03
96	688390	固德威	35,551	3,857,639.01	0.03
97	000975	山金国际	225,500	3,833,500.00	0.03
98	002487	大金重工	65,200	3,779,644.00	0.03
99	002111	威海广泰	418,900	3,770,100.00	0.03

100	603256	宏和科技	14,200	3,767,686.00	0.03
101	600596	新安股份	235,200	3,753,792.00	0.03
102	300059	东方财富	182,300	3,715,274.00	0.03
103	000552	甘肃能化	1,633,500	3,659,040.00	0.03
104	300307	慈星股份	495,800	3,654,046.00	0.03
105	301371	敷尔佳	137,800	3,582,800.00	0.03
106	000657	中钨高新	36,800	3,522,496.00	0.03
107	002132	恒星科技	647,500	3,502,975.00	0.03
108	600874	创业环保	649,400	3,480,784.00	0.03
109	600955	维远股份	234,900	3,457,728.00	0.03
110	002376	新北洋	600,300	3,451,725.00	0.03
111	300408	三环集团	20,500	3,421,450.00	0.03
112	603799	华友钴业	70,500	3,402,330.00	0.03
113	601398	工商银行	472,300	3,339,161.00	0.02
114	301216	万凯新材	145,100	3,335,849.00	0.02
115	603118	共进股份	271,900	3,292,709.00	0.02
116	300476	胜宏科技	9,300	3,221,799.00	0.02
117	000301	东方盛虹	280,600	3,212,870.00	0.02
118	001298	好上好	154,700	3,210,025.00	0.02
119	600489	中金黄金	177,200	3,198,460.00	0.02
120	002594	比亚迪	40,100	3,195,970.00	0.02
121	002463	沪电股份	20,500	3,132,400.00	0.02
122	600685	中船防务	120,700	3,070,608.00	0.02
123	002067	景兴纸业	831,900	3,061,392.00	0.02
124	300047	天源迪科	336,400	2,987,232.00	0.02
125	601211	国泰海通	163,800	2,981,160.00	0.02
126	000807	云铝股份	132,400	2,931,336.00	0.02
127	000988	华工科技	15,400	2,842,994.00	0.02
128	600233	圆通速递	179,400	2,825,550.00	0.02
129	600288	大恒科技	212,400	2,824,920.00	0.02
130	001314	亿道信息	45,100	2,787,180.00	0.02
131	300443	金雷股份	129,100	2,785,978.00	0.02
132	002532	天山铝业	258,900	2,777,997.00	0.02
133	000989	九芝堂	356,000	2,766,120.00	0.02
134	000885	城发环境	229,800	2,764,494.00	0.02
135	301308	江波龙	3,800	2,674,440.00	0.02
136	600203	福日电子	216,100	2,625,615.00	0.02
137	002737	葵花药业	232,100	2,601,841.00	0.02
138	601288	农业银行	422,000	2,561,540.00	0.02
139	600176	中国巨石	34,600	2,521,648.00	0.02
140	002938	鹏鼎控股	23,900	2,518,582.00	0.02
141	000651	格力电器	65,500	2,456,250.00	0.02
142	601233	桐昆股份	113,300	2,452,945.00	0.02

143	688368	晶丰明源	11,231	2,431,736.12	0.02
144	605117	德业股份	22,800	2,420,904.00	0.02
145	603901	永创智能	222,000	2,413,140.00	0.02
146	000426	兴业银锡	72,400	2,386,304.00	0.02
147	600595	中孚实业	421,100	2,366,582.00	0.02
148	603993	洛阳钼业	134,200	2,355,210.00	0.02
149	002204	大连重工	446,000	2,354,880.00	0.02
150	001203	大中矿业	78,300	2,345,085.00	0.02
151	600081	东风科技	258,100	2,343,548.00	0.02
152	605016	百龙创园	90,500	2,339,425.00	0.02
153	600869	远东股份	69,600	2,329,512.00	0.02
154	600919	江苏银行	214,500	2,312,310.00	0.02
155	000893	亚钾国际	56,500	2,310,285.00	0.02
156	002545	东方铁塔	141,000	2,287,020.00	0.02
157	603019	中科曙光	21,000	2,251,830.00	0.02
158	000612	焦作万方	212,300	2,248,257.00	0.02
159	000045	深纺织 A	213,100	2,246,074.00	0.02
160	601163	三角轮胎	176,800	2,243,592.00	0.02
161	301606	绿联科技	36,700	2,239,434.00	0.02
162	300972	万辰集团	12,900	2,236,989.00	0.02
163	002956	西麦食品	107,200	2,225,472.00	0.02
164	300219	鸿利智汇	212,800	2,219,504.00	0.02
165	000858	五 粮 液	29,000	2,146,000.00	0.02
166	000338	潍柴动力	78,700	2,144,575.00	0.02
167	600584	长电科技	20,700	2,143,485.00	0.02
168	002274	华昌化工	462,700	2,142,301.00	0.02
169	002458	益生股份	273,100	2,121,987.00	0.02
170	301260	格力博	153,249	2,070,393.99	0.02
171	603305	旭升集团	164,500	1,993,740.00	0.01
172	603068	博通集成	49,200	1,979,316.00	0.01
173	601816	京沪高铁	432,000	1,956,960.00	0.01
174	002916	深南电路	4,200	1,923,180.00	0.01
175	300124	汇川技术	28,400	1,883,772.00	0.01
176	600101	明星电力	235,500	1,858,095.00	0.01
177	600111	北方稀土	38,600	1,854,730.00	0.01
178	600309	万华化学	27,000	1,847,070.00	0.01
179	002415	海康威视	54,000	1,846,800.00	0.01
180	301339	通行宝	179,100	1,832,193.00	0.01
181	000544	中原环保	262,100	1,826,837.00	0.01
182	600966	博汇纸业	376,800	1,801,104.00	0.01
183	601218	吉鑫科技	417,300	1,794,390.00	0.01
184	002745	木林森	142,700	1,790,885.00	0.01
185	000100	TCL 科技	305,900	1,780,338.00	0.01

186	002772	众兴菌业	156,600	1,778,976.00	0.01
187	002354	天娱数科	190,500	1,771,650.00	0.01
188	603317	天味食品	134,200	1,745,942.00	0.01
189	601688	华泰证券	83,900	1,730,018.00	0.01
190	600000	浦发银行	199,200	1,715,112.00	0.01
191	600089	特变电工	76,200	1,714,500.00	0.01
192	000063	中兴通讯	47,300	1,711,787.00	0.01
193	688222	成都先导	52,671	1,691,265.81	0.01
194	603588	高能环境	88,000	1,689,600.00	0.01
195	000415	渤海租赁	409,300	1,665,851.00	0.01
196	002756	永兴材料	29,300	1,659,552.00	0.01
197	601857	中国石油	191,100	1,658,748.00	0.01
198	688388	嘉元科技	37,568	1,652,992.00	0.01
199	002876	三利谱	46,100	1,623,181.00	0.01
200	300666	江丰电子	4,400	1,621,840.00	0.01
201	002738	中矿资源	27,200	1,604,528.00	0.01
202	300953	震裕科技	12,000	1,604,400.00	0.01
203	300857	协创数据	4,700	1,597,530.00	0.01
204	601088	中国神华	40,600	1,585,024.00	0.01
205	002028	思源电气	9,100	1,574,300.00	0.01
206	300433	蓝思科技	29,200	1,566,872.00	0.01
207	600031	三一重工	86,100	1,487,808.00	0.01
208	002166	莱茵生物	235,700	1,480,196.00	0.01
209	300014	亿纬锂能	22,600	1,469,678.00	0.01
210	002050	三花智控	33,000	1,446,390.00	0.01
211	601601	中国太保	50,200	1,431,704.00	0.01
212	002142	宁波银行	48,200	1,431,058.00	0.01
213	000792	盐湖股份	47,200	1,424,968.00	0.01
214	000001	平安银行	140,800	1,415,040.00	0.01
215	002353	杰瑞股份	9,000	1,372,500.00	0.01
216	600406	国电南瑞	59,300	1,355,005.00	0.01
217	601668	中国建筑	308,500	1,338,890.00	0.01
218	000737	北方铜业	99,300	1,312,746.00	0.01
219	601229	上海银行	145,300	1,261,204.00	0.01
220	002602	世纪华通	88,500	1,247,850.00	0.01
221	300213	佳讯飞鸿	205,900	1,247,754.00	0.01
222	601919	中远海控	93,700	1,242,462.00	0.01
223	300760	迈瑞医疗	8,900	1,208,887.00	0.01
224	601939	建设银行	124,500	1,198,935.00	0.01
225	601012	隆基绿能	91,300	1,197,856.00	0.01
226	600660	福耀玻璃	23,700	1,195,428.00	0.01
227	002746	仙坛股份	234,300	1,194,930.00	0.01
228	601988	中国银行	208,500	1,192,620.00	0.01

229	603501	豪威集团	12,500	1,185,625.00	0.01
230	601728	中国电信	227,500	1,180,725.00	0.01
231	600941	中国移动	13,600	1,171,368.00	0.01
232	600016	民生银行	363,700	1,171,114.00	0.01
233	603026	石大胜华	13,100	1,170,747.00	0.01
234	601225	陕西煤业	57,400	1,168,090.00	0.01
235	002230	科大讯飞	28,000	1,143,520.00	0.01
236	002352	顺丰控股	36,500	1,140,990.00	0.01
237	600690	海尔智家	54,800	1,118,468.00	0.01
238	002460	赣锋锂业	17,000	1,111,800.00	0.01
239	603906	龙蟠科技	41,800	1,108,954.00	0.01
240	601985	中国核电	121,600	1,098,048.00	0.01
241	600999	招商证券	51,900	1,095,090.00	0.01
242	002709	天赐材料	21,200	1,090,316.00	0.01
243	600926	杭州银行	74,300	1,073,635.00	0.01
244	601169	北京银行	216,600	1,061,340.00	0.01
245	300033	同花顺	4,300	1,036,300.00	0.01
246	600160	巨化股份	19,200	1,017,792.00	0.01
247	301500	飞南资源	38,700	1,008,135.00	0.01
248	600938	中国海油	36,900	1,001,835.00	0.01
249	002202	金风科技	41,900	1,001,410.00	0.01
250	601600	中国铝业	121,200	996,264.00	0.01
251	300442	润泽科技	11,900	988,533.00	0.01
252	000776	广发证券	41,700	975,780.00	0.01
253	300498	温氏股份	78,700	969,584.00	0.01
254	000425	徐工机械	119,700	968,373.00	0.01
255	688126	沪硅产业	24,110	961,747.90	0.01
256	000938	紫光股份	33,300	961,038.00	0.01
257	600050	中国联通	239,700	958,800.00	0.01
258	600028	中国石化	212,200	946,412.00	0.01
259	688082	盛美上海	2,189	945,648.00	0.01
260	002600	领益智造	53,800	932,892.00	0.01
261	300661	圣邦股份	6,500	932,620.00	0.01
262	601009	南京银行	93,800	927,682.00	0.01
263	601766	中国中车	178,200	926,640.00	0.01
264	002179	中航光电	19,700	910,140.00	0.01
265	603985	恒润股份	37,000	888,740.00	0.01
266	002049	紫光国微	10,000	887,500.00	0.01
267	601628	中国人寿	24,700	873,145.00	0.01
268	600460	士兰微	15,900	869,094.00	0.01
269	601100	恒立液压	8,000	860,480.00	0.01
270	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
271	000568	泸州老窖	10,900	844,968.00	0.01

272	301246	宏源药业	31,200	839,280.00	0.01
273	002241	歌尔股份	36,800	829,104.00	0.01
274	000408	藏格矿业	11,900	824,908.00	0.01
275	601818	光大银行	285,000	823,650.00	0.01
276	600905	三峡能源	221,700	822,507.00	0.01
277	002837	英维克	10,300	819,468.00	0.01
278	601888	中国中免	15,100	811,021.00	0.01
279	601006	大秦铁路	175,800	810,438.00	0.01
280	600809	山西汾酒	7,300	798,401.00	0.01
281	601658	邮储银行	161,000	793,730.00	0.01
282	002625	光启技术	26,000	788,320.00	0.01
283	000630	铜陵有色	123,300	784,188.00	0.01
284	600893	航发动力	20,300	778,302.00	0.01
285	688271	联影医疗	7,685	777,952.55	0.01
286	601127	赛力斯	12,700	777,875.00	0.01
287	600010	包钢股份	344,500	768,235.00	0.01
288	002027	分众传媒	155,400	752,136.00	0.01
289	601336	新华保险	12,600	751,716.00	0.01
290	688111	金山办公	3,528	751,640.40	0.01
291	600118	中国卫星	9,100	746,655.00	0.01
292	601689	拓普集团	12,900	727,818.00	0.01
293	688396	华润微	7,443	726,064.65	0.01
294	600019	宝钢股份	132,900	721,647.00	0.01
295	688775	影石创新	5,152	714,324.80	0.01
296	600958	东方证券	75,300	710,832.00	0.01
297	600760	中航沈飞	17,200	706,920.00	0.01
298	688221	前沿生物	31,270	700,448.00	0.01
299	600362	江西铜业	16,000	692,800.00	0.01
300	600104	上汽集团	70,700	690,032.00	0.01
301	601838	成都银行	38,400	679,680.00	0.01
302	600230	沧州大化	51,200	666,624.00	0.00
303	600433	冠豪高新	207,200	665,112.00	0.00
304	601825	沪农商行	88,500	662,865.00	0.00
305	601727	上海电气	93,400	653,800.00	0.00
306	300450	先导智能	16,000	651,520.00	0.00
307	601390	中国中铁	156,100	650,937.00	0.00
308	600875	东方电气	22,600	650,202.00	0.00
309	301048	金鹰重工	75,400	649,194.00	0.00
310	000538	云南白药	13,600	644,232.00	0.00
311	600795	国电电力	137,900	643,993.00	0.00
312	688183	生益电子	4,838	640,551.20	0.00
313	002001	新 和 成	22,500	639,450.00	0.00
314	002422	科伦药业	16,600	639,432.00	0.00

315	600989	宝丰能源	31,300	636,329.00	0.00
316	603296	华勤技术	8,400	623,868.00	0.00
317	600585	海螺水泥	36,500	618,675.00	0.00
318	600015	华夏银行	96,700	617,913.00	0.00
319	601669	中国电建	130,600	613,820.00	0.00
320	600547	山东黄金	26,500	611,885.00	0.00
321	601995	中金公司	16,800	607,320.00	0.00
322	601916	浙商银行	230,800	607,004.00	0.00
323	002406	远东传动	92,500	606,800.00	0.00
324	601377	兴业证券	100,200	605,208.00	0.00
325	000166	申万宏源	137,300	604,120.00	0.00
326	603893	瑞芯微	3,200	602,752.00	0.00
327	601698	中国卫通	19,600	592,900.00	0.00
328	300015	爱尔眼科	71,000	586,460.00	0.00
329	300316	晶盛机电	9,600	579,840.00	0.00
330	600482	XD 中国动	17,600	577,280.00	0.00
331	002311	海大集团	12,900	575,469.00	0.00
332	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.00
333	601998	中信银行	81,300	563,409.00	0.00
334	600346	恒力石化	31,800	563,178.00	0.00
335	300418	昆仑万维	13,600	548,896.00	0.00
336	601868	中国能建	205,200	547,884.00	0.00
337	600426	华鲁恒升	22,900	547,768.00	0.00
338	000625	长安汽车	76,300	547,071.00	0.00
339	600066	宇通客车	20,200	541,562.00	0.00
340	002558	巨人网络	19,400	534,664.00	0.00
341	601066	中信建投	18,100	526,167.00	0.00
342	000157	中联重科	75,200	524,144.00	0.00
343	600011	华能国际	69,000	523,710.00	0.00
344	300016	北陆药业	67,500	517,725.00	0.00
345	688036	传音控股	8,721	514,102.95	0.00
346	600221	海航控股	379,600	512,460.00	0.00
347	600438	通威股份	42,300	512,253.00	0.00
348	605499	东鹏饮料	4,100	506,063.00	0.00
349	600048	保利发展	108,700	503,281.00	0.00
350	600436	片仔癀	4,600	502,688.00	0.00
351	601077	渝农商行	81,800	499,798.00	0.00
352	002236	大华股份	30,100	496,349.00	0.00
353	600886	国投电力	37,100	493,801.00	0.00
354	003816	中国广核	123,600	483,276.00	0.00
355	688047	龙芯中科	3,117	482,106.39	0.00
356	002736	国信证券	46,800	467,532.00	0.00
357	600188	兖矿能源	26,300	467,351.00	0.00

358	601360	三六零	53,700	466,653.00	0.00
359	002074	国轩高科	16,900	464,919.00	0.00
360	601058	赛轮轮胎	40,300	464,659.00	0.00
361	300803	指南针	5,000	458,350.00	0.00
362	601901	方正证券	63,400	456,480.00	0.00
363	600570	恒生电子	21,400	453,466.00	0.00
364	600115	中国东航	118,600	451,866.00	0.00
365	301026	浩通科技	22,000	444,840.00	0.00
366	000768	中航西飞	21,400	438,272.00	0.00
367	600009	上海机场	18,900	436,590.00	0.00
368	601788	光大证券	30,100	434,343.00	0.00
369	600415	小商品城	42,700	433,832.00	0.00
370	600196	复星医药	19,300	433,671.00	0.00
371	600219	南山铝业	108,000	430,920.00	0.00
372	600674	川投能源	30,200	427,934.00	0.00
373	600029	南方航空	82,400	426,832.00	0.00
374	601881	中国银河	33,200	417,324.00	0.00
375	601186	中国铁建	70,100	417,095.00	0.00
376	601877	正泰电器	16,600	416,162.00	0.00
377	601117	中国化学	55,900	410,865.00	0.00
378	600026	中远海能	22,700	407,238.00	0.00
379	301269	华大九天	3,400	406,028.00	0.00
380	601456	国联民生	45,700	403,988.00	0.00
381	601111	中国国航	66,200	400,510.00	0.00
382	600372	中航机载	36,400	394,940.00	0.00
383	301236	软通动力	9,300	394,785.00	0.00
384	002920	德赛西威	4,700	383,050.00	0.00
385	600741	华域汽车	24,000	372,480.00	0.00
386	000963	华东医药	13,200	371,184.00	0.00
387	688506	百利天恒	1,261	370,771.83	0.00
388	000895	双汇发展	15,600	349,440.00	0.00
389	601898	中煤能源	28,600	348,348.00	0.00
390	002304	洋河股份	9,100	347,165.00	0.00
391	300866	安克创新	3,300	344,850.00	0.00
392	601021	春秋航空	7,500	341,850.00	0.00
393	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
394	600023	浙能电力	63,200	332,432.00	0.00
395	601319	中国人保	48,400	327,184.00	0.00
396	002239	奥特佳	131,500	324,805.00	0.00
397	600039	四川路桥	40,300	315,146.00	0.00
398	601800	中国交建	53,900	307,769.00	0.00
399	000002	万 科 A	102,500	303,400.00	0.00
400	688223	晶科能源	63,268	300,523.00	0.00

401	601633	长城汽车	19,300	291,237.00	0.00
402	001965	招商公路	31,200	285,792.00	0.00
403	600600	青岛啤酒	5,400	282,042.00	0.00
404	600588	用友网络	30,400	279,072.00	0.00
405	603369	今世缘	11,700	277,407.00	0.00
406	600027	华电国际	61,800	275,010.00	0.00
407	601618	中国中冶	108,400	264,496.00	0.00
408	601607	上海医药	17,100	263,340.00	0.00
409	302132	中航成飞	4,500	262,440.00	0.00
410	603260	合盛硅业	5,400	260,604.00	0.00
411	600918	中泰证券	48,700	259,084.00	0.00
412	000617	中油资本	39,300	258,987.00	0.00
413	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
414	600025	华能水电	28,900	256,921.00	0.00
415	600061	国投资本	39,000	255,450.00	0.00
416	688472	阿特斯	23,581	255,146.42	0.00
417	300832	新产业	6,000	252,000.00	0.00
418	300251	光线传媒	22,600	250,634.00	0.00
419	300628	亿联网络	7,400	250,268.00	0.00
420	601059	信达证券	15,000	242,850.00	0.00
421	600085	同仁堂	10,400	240,344.00	0.00
422	600515	海南机场	87,400	239,476.00	0.00
423	000999	华润三九	10,100	227,149.00	0.00
424	600803	新奥股份	14,200	224,360.00	0.00
425	600845	宝信软件	13,200	219,516.00	0.00
426	300999	金龙鱼	9,200	213,992.00	0.00
427	300122	智飞生物	18,300	213,927.00	0.00
428	600018	上港集团	42,400	200,128.00	0.00
429	000596	古井贡酒	2,500	199,500.00	0.00
430	000708	中信特钢	15,500	195,610.00	0.00
431	300896	爱美客	2,200	191,840.00	0.00
432	601018	宁波港	59,400	187,110.00	0.00
433	688009	中国通号	38,646	183,954.96	0.00
434	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.00
435	688303	大全能源	10,100	176,043.00	0.00
436	601238	广汽集团	34,100	173,228.00	0.00
437	001280	中国铀业	2,549	170,018.30	0.00
438	300413	芒果超媒	11,300	165,319.00	0.00
439	301611	珂玛科技	900	162,063.00	0.00
440	603392	万泰生物	5,800	156,426.00	0.00
441	603036	如通股份	9,700	140,262.00	0.00
442	301165	锐捷网络	1,700	136,765.00	0.00
443	300923	研奥股份	5,800	129,224.00	0.00

444	603818	曲美家居	43,000	127,710.00	0.00
445	603617	君禾股份	17,800	126,736.00	0.00
446	300694	蠡湖股份	12,700	121,920.00	0.00
447	301185	鸥玛软件	8,200	121,852.00	0.00
448	600768	宁波富邦	8,100	121,338.00	0.00
449	002381	双箭股份	23,400	121,212.00	0.00
450	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
451	301103	何氏眼科	7,900	118,342.00	0.00
452	300823	建科智能	8,000	116,640.00	0.00
453	600833	第一医药	12,900	116,358.00	0.00
454	300387	富邦科技	17,100	116,109.00	0.00
455	003008	开普检测	6,800	116,076.00	0.00
456	601136	首创证券	8,300	115,785.00	0.00
457	300800	力合科技	12,500	115,625.00	0.00
458	300771	智莱科技	11,200	115,584.00	0.00
459	002566	益盛药业	19,100	115,364.00	0.00
460	600354	敦煌种业	24,200	115,192.00	0.00
461	300030	阳普医疗	19,800	115,038.00	0.00
462	600697	欧亚集团	11,800	114,696.00	0.00
463	603900	莱绅通灵	20,300	114,289.00	0.00
464	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
465	000757	浩物股份	33,500	114,235.00	0.00
466	600455	博通股份	5,200	114,192.00	0.00
467	605001	威奥股份	20,900	113,905.00	0.00
468	000605	渤海股份	21,200	113,420.00	0.00
469	002760	凤形股份	6,900	113,298.00	0.00
470	001231	农心科技	6,200	113,088.00	0.00
471	003003	天元股份	11,300	112,435.00	0.00
472	301063	海锅股份	6,700	112,292.00	0.00
473	605122	四方新材	10,400	112,112.00	0.00
474	600883	博闻科技	16,000	112,000.00	0.00
475	603041	美思德	10,800	111,996.00	0.00
476	301167	建研设计	9,000	111,510.00	0.00
477	605033	美邦股份	6,700	111,488.00	0.00
478	603096	新经典	8,300	111,054.00	0.00
479	300743	天地数码	7,600	110,884.00	0.00
480	688021	奥福科技	5,696	110,274.56	0.00
481	001336	楚环科技	5,000	110,100.00	0.00
482	605151	西上海	6,200	109,182.00	0.00
483	301429	森泰股份	6,800	106,556.00	0.00
484	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.00
485	688781	视涯科技	1,300	61,893.00	0.00
486	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00

487	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
488	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
489	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
490	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
491	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
492	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
493	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
494	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
495	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
496	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
497	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
498	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
499	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
500	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
501	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
502	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
503	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
504	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
505	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
506	301667	纳百川	101	7,304.32	0.00
507	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
508	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
509	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
510	301449	天溯计量	65	2,515.50	0.00
511	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
512	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
513	603248	锡华科技	92	1,940.28	0.00
514	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
515	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
516	002948	青岛银行	100	508.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	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	002371	北方华创	97,600,199.53	1.47
2	688777	中控技术	86,485,466.91	1.30
3	002493	荣盛石化	80,402,678.68	1.21
4	688041	海光信息	79,890,170.86	1.20
5	600026	中远海能	73,642,905.98	1.11
6	300308	中际旭创	71,926,863.00	1.08
7	300750	宁德时代	71,148,906.00	1.07
8	601138	工业富联	70,158,226.28	1.06
9	601872	招商轮船	70,058,460.61	1.06

10	600519	贵州茅台	68,846,879.00	1.04
11	000688	国城矿业	65,659,172.00	0.99
12	002008	大族激光	61,293,041.06	0.92
13	002738	中矿资源	59,727,052.32	0.90
14	603799	华友钴业	55,010,772.12	0.83
15	002415	海康威视	54,279,774.00	0.82
16	600150	中国船舶	53,221,429.41	0.80
17	001979	招商蛇口	52,827,195.81	0.80
18	600346	恒力石化	51,968,257.00	0.78
19	688630	芯碁微装	51,235,496.46	0.77
20	600938	中国海油	51,093,044.00	0.77

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600026	中远海能	107,304,390.88	1.62
2	002738	中矿资源	79,154,664.66	1.19
3	000688	国城矿业	78,726,223.00	1.19
4	002008	大族激光	61,375,744.00	0.93
5	600938	中国海油	55,225,136.00	0.83
6	002415	海康威视	54,382,452.28	0.82
7	300750	宁德时代	48,721,108.40	0.73
8	002371	北方华创	47,574,379.98	0.72
9	600989	宝丰能源	47,354,582.00	0.71
10	000408	藏格矿业	42,979,360.00	0.65
11	000975	山金国际	42,809,289.29	0.65
12	601600	中国铝业	42,601,927.00	0.64
13	600346	恒力石化	42,058,067.00	0.63
14	603799	华友钴业	41,922,901.90	0.63
15	300308	中际旭创	39,767,292.00	0.60
16	600150	中国船舶	39,012,960.11	0.59
17	600988	赤峰黄金	37,126,069.14	0.56
18	688702	盛科通信	36,875,740.51	0.56
19	601699	潞安环能	36,858,438.00	0.56
20	601899	紫金矿业	35,802,585.60	0.54

注：卖出金额均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 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	7,992,734,116.65
卖出股票收入（成交）总额	7,140,555,022.94

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

关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	486,893,851.43	3.64
2	央行票据	—	—
3	金融债券	5,928,568,240.56	44.33
	其中：政策性金融债	2,537,172,015.05	18.97
4	企业债券	289,499,722.53	2.16
5	企业短期融资券	50,428,136.99	0.38
6	中期票据	3,950,809,438.53	29.54
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	358,766,621.33	2.68
10	合计	11,064,966,011.37	82.75

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	230210	23 国开 10	3,300,000	355,967,835.62	2.66
2	260205	26 国开 05	2,500,000	254,638,630.14	1.90
3	260007	26 附息国债 07	2,000,000	202,411,397.26	1.51
4	250431	25 农发 31	1,800,000	182,284,372.60	1.36
5	242380008	23 中行永续债 01	1,700,000	175,707,761.64	1.31

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。

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

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管

理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的，以争取回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量，以力争相应债券组合的超额收益。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国农业发展银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

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	22,057,964.32
2	应收清算款	140,406,837.71
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	28,130,514.95
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	190,595,316.98

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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
中 欧 瑾 通 灵 活 配 置 混 合 A	391,873	4,206.69	347,282,539.49	21.07%	1,301,206,242.20	78.93%
中 欧 瑾 通 灵 活 配 置 混 合 C	514,017	13,056.19	1,368,439,046.88	20.39%	5,342,662,371.82	79.61%
中 欧 瑾 通 灵 活 配 置 混 合 E	204,202	2,593.45	248,957,741.84	47.01%	280,629,080.28	52.99%
合 计	1,110,092	8,007.60	1,964,679,328.21	22.10%	6,924,497,694.30	77.90%

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（%）	82.19

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	中欧瑾通灵活配置混合 A	2,094,217.84	0.13%
	中欧瑾通灵活配置混合 C	202,543.41	0.00%
	中欧瑾通灵活配置混合 E	4,032,395.28	0.76%

金			
	合计	6,329,156.53	0.07%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧瑾通灵活配置混合 A	10~50
	中欧瑾通灵活配置混合 C	0~10
	中欧瑾通灵活配置混合 E	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧瑾通灵活配置混合 A	0~10
	中欧瑾通灵活配置混合 C	0~10
	中欧瑾通灵活配置混合 E	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中欧瑾通灵活配置混合 A	中欧瑾通灵活配置混合 C	中欧瑾通灵活配置混合 E
基金合同生效日（2015 年 11 月 17 日）基金份额总额	290.68	2,500,193,796.11	—
本报告期期初基金份额总额	940,562,168.69	3,348,026,609.80	152,777,223.79
本报告期基金总申购份额	1,176,318,248.31	7,871,971,332.04	467,895,055.62
减：本报告期基金总赎回份额	468,391,635.31	4,508,896,523.14	91,085,457.29
本报告期基金拆分变动份额	—	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,648,488,781.69	6,711,101,418.70	529,586,822.12

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

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**10.2.1 基金管理人的重大人事变动**

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 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，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。本报告期无涉及基金财产的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

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**

报告期内，基金管理人不存在受调查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员不存在受调查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况**10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	1	3,539,202,086.48	23.40	1,542,745.04	23.40	—
申万宏源	1	3,231,750,92	21.36	1,408,718.20	21.36	—

证券		7.02				
华泰证券	1	2,321,792,00 5.05	15.35	1,012,054.02	15.35	-
招商证券	1	1,776,773,51 4.62	11.75	774,465.19	11.75	-
华西证券	1	1,621,672,96 9.13	10.72	706,891.78	10.72	-
国泰海通	1	1,386,840,52 5.48	9.17	604,528.63	9.17	-
国都证券	2	1,243,007,36 4.23	8.22	541,824.23	8.22	-
长江证券	1	6,861,028.10	0.05	2,504.35	0.04	-
光大证券	1	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

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(%)
广发证券	-	-	22,000,000.0 0	3.27	-	-
申万宏源证券	-	-	30,000,000.0 0	4.46	-	-
华泰证券	-	-	507,000,000. 00	75.45	-	-
招商证券	-	-	63,000,000.0 0	9.38	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国都证券	367,864,413 .47	100.00	50,000,000.0 0	7.44	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

光大证 券	-	-	-	-	-	-
----------	---	---	---	---	---	---

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果（被动股票型基金不适用）。

2、根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-13
2	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2026-01-16
3	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2026-01-20
4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
5	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-01-22
6	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
7	中欧基金管理有限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）	中国证监会指定媒介	2026-03-31
8	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定媒介	2026-03-31
9	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定媒介	2026-04-14
10	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
11	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2026-04-22
12	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2026-05-20
13	中欧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	中国证监会指定媒介	2026-06-06
14	中欧瑾通灵活配置混合型证券投资基金基金合同（修订）	中国证监会指定媒介	2026-06-26

15	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2026-06-26
----	---	-----------	------------

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与各基金托管人协商一致，本基金管理人于 2026 年 7 月 27 日起调整旗下部分基金的业绩比较基准，并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。具体可参见管理人于 2026 年 6 月 27 日发布的公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2026 年 8 月 29 日