

京管泰富优势企业混合型发起式证券投资
基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：北京京管泰富基金管理有限责任公司

基金托管人：北京银行股份有限公司

送出日期：2026 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人北京银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 20 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。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 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
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	62
8.12 投资组合报告附注	62
§ 9 基金份额持有人信息	62
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 10 开放式基金份额变动	64
§ 11 重大事件揭示	64
11.1 基金份额持有人大会决议	64
11.2 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	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
11.4 基金投资策略的改变	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	65
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
11.8 其他重大事件	67
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	70
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金	
基金简称	京管泰富优势混合	
基金主代码	007303	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 11 月 17 日	
基金管理人	北京京管泰富基金管理有限责任公司	
基金托管人	北京银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	204,252,379.69 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
下属分级基金的交易代码	007303	007304
报告期末下属分级基金的份额总额	201,816,316.05 份	2,436,063.64 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险和保持资产流动性的前提下，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略包括大类资产配置策略，股票投资策略，债券投资策略，可转换债券、可交换债券投资策略，资产支持证券投资策略，参与融资业务的策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则等差异以及汇率因素带来的特有风险。

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	北京京管泰富基金管理有限责任公司	北京银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张丽
	联系电话	010-59363007
	电子邮箱	zhangli@cdbsfund.com
客户服务电话	400-898-3299	95526
传真	010-59363298	010-89661115
注册地址	北京市怀柔区北房镇幸福西街 3	北京市西城区金融大街甲 17 号

	号 416 室	首层
办公地址	北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼	北京市西城区金融大街丙 17 号
邮政编码	100035	100033
法定代表人	朱瑜	霍学文

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cdbsfund.com
基金年度报告备置地点	北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼北京京管泰富基金管理有限责任公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 楼
注册登记机构	北京京管泰富基金管理有限责任公司	北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年 11 月 17 日(基金合同生效日) - 2023 年 12 月 31 日	
	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
本期已实现收益	52,864,115.98	605,675.82	10,734,199.93	-88,741.53	386,313.80	37,313.99
本期利润	55,560,099.47	579,354.43	8,221,451.62	251,052.83	107,542.30	-52,865.11
加权平均基金份额本期利润	0.2763	0.2870	0.0404	0.0335	0.0005	-0.0015
本期加权平均	24.38%	25.02%	4.12%	3.46%	0.05%	-0.15%

净值 利润率						
本期 基金 份额 净值 增长 率	26.78%	26.28%	4.07%	3.65%	0.05%	0.00%
3.1. 2 期 末数 据和 指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末 可供 分配 利润	55,991,998. 66	648,667.05	6,288,136.9 6	62,388.89	110,546.87	357.31
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.2774	0.2663	0.0313	0.0266	0.0005	0.0000
期末 基金 资产 净值	257,808,314 .71	3,084,730. 69	207,487,395 .86	2,411,709. 54	206,230,933 .79	12,983,368. 35
期末 基金 份额 净值	1.2774	1.2663	1.0313	1.0266	1.0005	1.0000
3.1. 3 累 计期 末指 标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	32.01%	30.89%	4.12%	3.65%	0.05%	0.00%

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要

低于所列数字；

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

3. 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；

4. 本基金基金合同生效日为 2023 年 11 月 17 日。

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

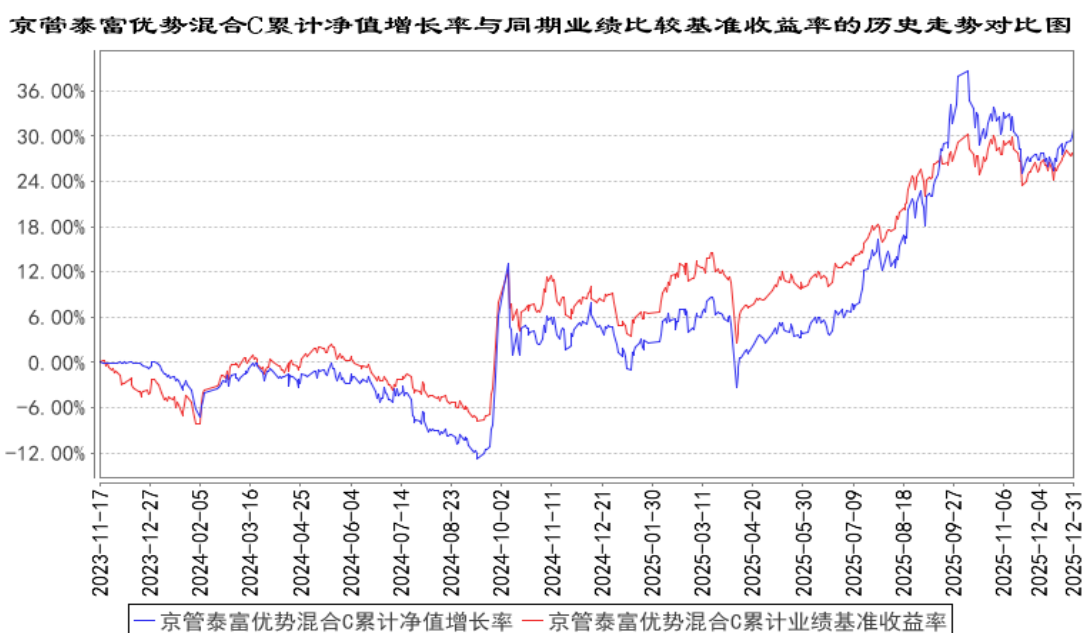
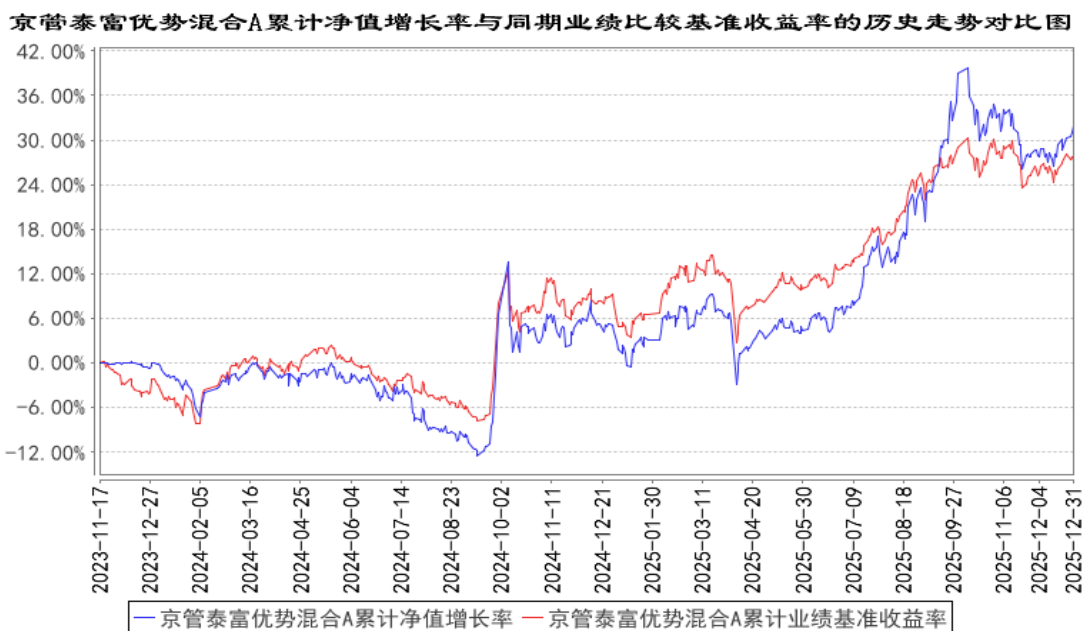
京管泰富优势混合 A

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	-5.03%	1.02%	-1.43%	0.79%	-3.60%	0.23%
过去六个月	22.63%	1.11%	12.96%	0.72%	9.67%	0.39%
过去一年	26.78%	1.09%	17.99%	0.85%	8.79%	0.24%
自基金合同生效起至今	32.01%	1.12%	27.27%	0.86%	4.74%	0.26%

京管泰富优势混合 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	-5.12%	1.02%	-1.43%	0.79%	-3.69%	0.23%
过去六个月	22.38%	1.11%	12.96%	0.72%	9.42%	0.39%
过去一年	26.28%	1.09%	17.99%	0.85%	8.29%	0.24%
自基金合同生效起至今	30.89%	1.11%	27.27%	0.86%	3.62%	0.25%

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

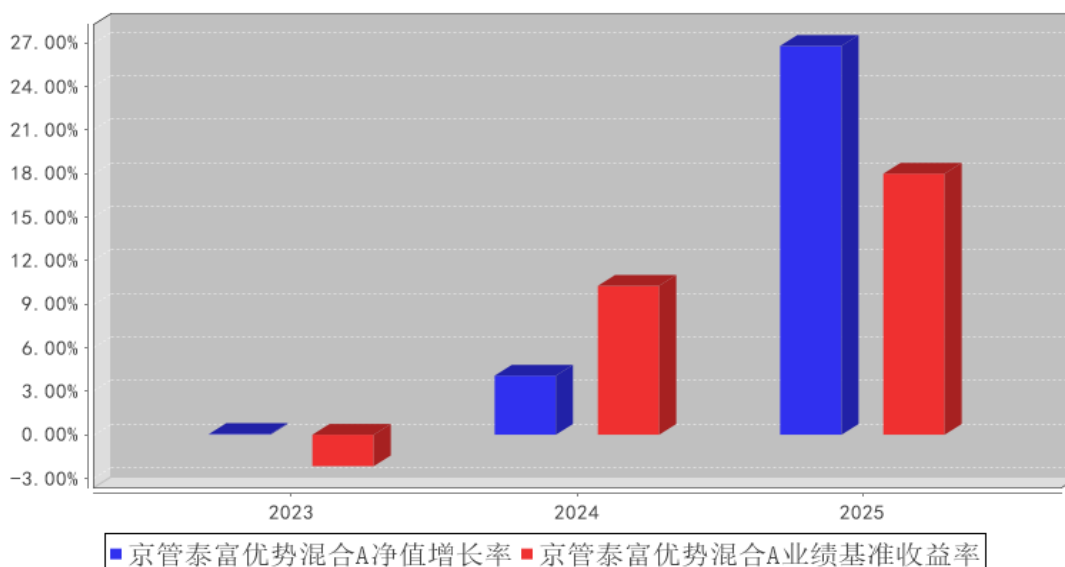


注：1. 本基金基金合同的生效日为 2023 年 11 月 17 日。按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例均符合合同约定；

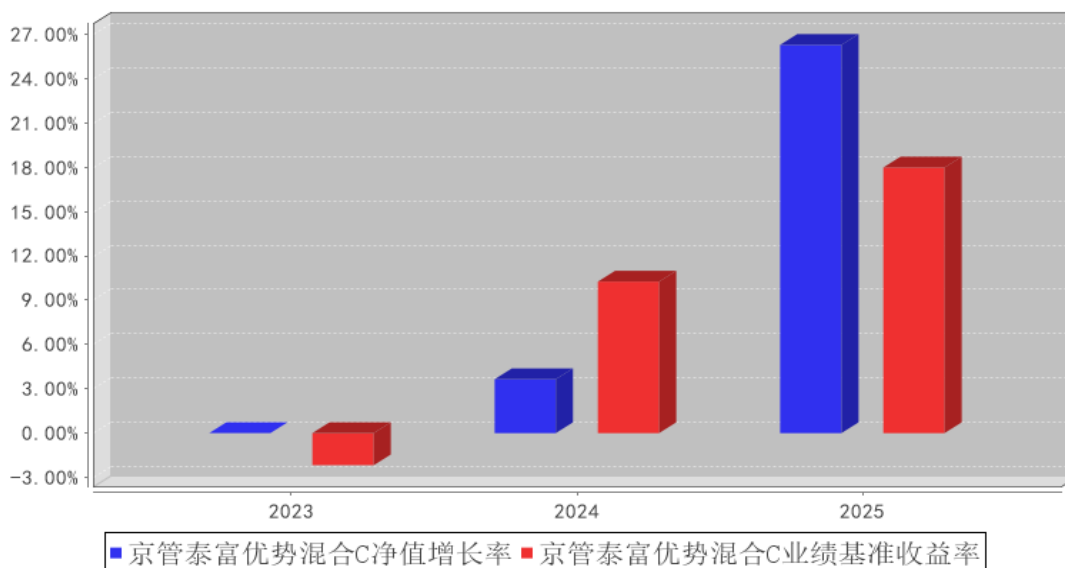
2. 本基金成立至 2025 年 1 月 7 日，业绩比较基准为中证 800 指数收益率×65%+中债新综合全价（总值）指数收益率×35%；2025 年 1 月 8 日起，业绩比较基准为中证 800 指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债总指数收益率×20%。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

京管泰富优势混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



京管泰富优势混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2023 年 11 月 17 日生效，合同生效当年相关数据和指标按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

京管泰富优势混合 A

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.3000	6,037,694.00	1,536.31	6,039,230.31	-
2024 年	0.1000	2,014,851.99	494.80	2,015,346.79	-

2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.4000	8,052,545.99	2,031.11	8,054,577.10	-

京管泰富优势混合 C

年度	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	年度利润分配合计	备注
2025 年	0.3000	73,295.60	6.37	73,301.97	-
2024 年	0.1000	30,792.63	0.98	30,793.61	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	0.4000	104,088.23	7.35	104,095.58	-

注：本基金基金合同生效日为2023年11月17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

北京京管泰富基金管理有限责任公司(原名为国开泰富基金管理有限责任公司)于 2013 年 6 月 28 日正式获得中国证券监督管理委员会批准成立,公司注册地位于北京市,注册资本为人民币叁亿陆仟万元整,其中北京国有资本运营管理有限公司出资比例为 66.7%,国泰证券投资信托股份有限公司出资比例为 33.3%。公司经营范围包括:基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2025 年 12 月 31 日,公司旗下管理 7 只公募基金,公募资产管理规模约为 142 亿元,同时公司还运作管理私募资产管理计划。

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		
王萍萍	本基金基金经理	2023 年 11 月 17 日	-	12 年	王萍萍,中央财经大学经济学硕士,持有基金从业资格证。2018 年 10 月加入公司,曾任公司投资经理。2023 年 11 月 17 日起至今,任京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金的基金经理。曾在华商基金管理有限公司任投资经理。

注:上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写,首任基金经理的任职日期按基金合同生效日填写。证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

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守《中华人民共和国证券投资基金法》和相关法律法规，以及《基金合同》、招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严控风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，本基金的投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，没有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 公平交易制度和控制方法

为保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，保护基金份额持有人和私募资产管理计划委托人的合法权益，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规准则以及公司内部规章，制定了《北京京管泰富基金管理有限责任公司公平交易管理办法》及《北京京管泰富基金管理有限责任公司异常交易监控管理办法》，对研究、决策、交易执行等各个环节做出了明确具体的规定并严格执行，严禁不同投资组合之间进行利益输送，切实保护投资者合法权益。

在投资决策过程中，不同投资组合能够公平充分地获得各类投资信息、投资建议，各投资组合享有公平的投资决策机会；在交易执行的过程中，严格实行集中交易制度，投资决策与交易执行相隔离，各投资组合享有公平的交易执行机会。对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的投资交易行为。

本基金管理人通过日常监测和定期报告的方式对不同投资组合的整体收益率差异、分类别资产的收益率差异及连续四个季度内不同时间窗下临近日同向交易价差进行分析，评估公平交易的执行情况并持续监督投资、研究、交易等各个环节对公司制度相关要求的落实情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，在保证本基金管理人管理的所有投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议、实施投资决策、交易执行等方面得到公平对待，并对买卖债券、股票的价格和市场价格差距较大，可能存在利益输送、操纵股价等违法违规情况进行监控。

本报告期内，公平交易制度执行情况良好，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合

不存在参与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 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年 A 股市场整体呈现“震荡上行、结构分化”的走势，主要指数全面上涨，科技与资源板块领涨，市场活跃度显著提升，政策与资金面共同推动市场走强。具体来看，2025 年 A 股主要指数均实现正收益，成长风格显著跑赢价值风格。其中，创业板指涨幅领跑、接下来为中证 500、深证成指、上证指数和沪深 300。北证市场表现同样突出，北证 50 指数全年上涨超 30%。

市场的核心特征是结构性分化，“科技+资源”成为贯穿全年的两大主线。以人工智能为核心的硬科技浪潮是主要驱动力量，从算力基础设施到下游应用，多个高科技板块涨幅居前。与此同时，资源板块同步崛起，有色金属行业指数全年涨幅超过 90%，使有色金属、通信、电子成为申万一级行业中涨幅前三的行业。相比之下，部分传统消费板块则表现相对低迷。2025 年 A 股市场的上涨是政策面、资金面、产业面、情绪面四重利好共振的结果。政策为市场指明了方向并注入了信心，流动性提供了充足的支撑，人工智能等新质生产力的产业浪潮创造了持续的热点与盈利预期，而经济基本面的韧性以及外部环境的缓和，则共同推动了市场整体的估值修复与信心回归。

2025 年本基金持仓延续均衡的配置思路，根据国内外宏观环境以及各个行业的基本面和估值的变化，对组合进行了持续的结构调整，下半年增加了顺周期、科技和新能源的仓位。目前主要持有行业包括银行、电子、新能源、计算机、化工等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金 A 类份额净值为 1.2774 元，报告期内基金份额净值增长率为 26.78%；截至本报告期末本基金 C 类份额净值为 1.2663 元，报告期内基金份额净值增长率为 26.28%；同期业绩比较基准收益率为 17.99%。

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 2026 年，作为“十五五”规划的开局之年，宏观政策定调积极。财政政策预计将保持扩张态势，通过加强基建与重大项目的集中落地，或带动投资增速回升。随着国内稳增长政策持续加码，经济有望实现温和复苏。盈利层面，2024 年年报已确认本轮 A 股盈利周期的底部。2026 年，伴随工业生产者出厂价格指数（PPI）回升带来的企业补库需求，叠加“十五五”规划首年开工需求的释放以及平稳的出口预期，A 股市场有望将迎来净利润增速与净资产收益率的持续修复。

流动性层面，2026 年国内外政策环境预计将构成“内松外宽”的格局。国内方面，货币政策或将延续“适度宽松”基调，灵活运用降准、降息等多种工具以保持流动性充裕和社会融资条件

相对宽松。海外方面，综合美国就业市场趋缓、通胀温和以及美联储领导层变动等因素，市场普遍预期美联储仍将处于相对宽松的降息通道，美元指数因此可能承压。在此背景下，叠加目前国内经济基本面保持韧性、中美贸易关系维持相对稳定，人民币汇率有望在均衡水平上实现温和升值。

基于上述宏观背景，本基金 2026 年的投资拟关注以下几条主线：1) 关注产能周期企稳带来的结构性机会：2026 年整体产能周期反转情况尚需观察，但 PPI 等线索或指向产能周期存在阶段性企稳的可能。这意味着部分行业可能存在产能出清带来的结构性机遇。结合需求、价格与估值情况，在传统板块中，电力新能源产业链、化工、建材等行业或存在值得关注的产能出清线索。2) 把握自主可控产业的长期战略机遇：在严峻的外部压力和强劲的内部需求驱动下，以国产算力为核心的自主可控产业链将进入商业化加速和市场份额提升的关键期，是具备长期战略价值的核心主线。3) 挖掘消费板块的结构性景气方向：在当前国内消费整体复苏基础尚需巩固的环境下，下游消费板块更多呈现结构性机会，2025 年第三季度以来，部分消费领域已出现改善信号，显示出回暖趋势。未来将持续关注并挖掘消费领域内部的高景气细分方向。

2026 年本基金将根据宏观经济和市场情况，不断优化配置结构，后续将延续相对均衡的配置思路。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核相关工作部门、风险控制相关工作部门定期与不定期的对基金的投资、研究、交易、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的合规审核及监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；通过信息技术建立多级投资交易预警系统；完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；根据新出台的法律法规和行业的新要求，督促公司及时制定、更新规章制度和业务流程；加强法律法规的教育和培训，促进公司合规文化的建设；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金

份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中 and 年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。报告期内，基金经理参加估值专业委员会会议，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。报告期内，与估值相关的定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。本基金所采用的估值流程及估值结果均已经托管银行复核确认。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，本基金进行了一次利润分配，情况如下：

本基金于 2025 年 11 月 15 日发布 2025 年度的第一次分红公告，按每 10 份基金份额派发红利 0.3000 元，其中现金形式发放总额 6,110,989.60 元，再投资形式发放总额 1,542.68 元；本次分红总金额为 6,112,532.28 元，权益登记日为 2025 年 11 月 17 日。

本基金本报告期内共计派发红利 6,112,532.28 元。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 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

报告期内未出现基金持有人数或基金资产净值预警情形。

§ 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

在本报告期内，本基金托管人在托管京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

在本报告期内，本基金托管人复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：

财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等内容, 复核内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2602300 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表, 包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表, 2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为, 后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制, 公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求, 我们独立于该基金, 并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信, 我们获取的审计证据是充分、适当的, 为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>该基金管理人北京京管泰富基金管理有限责任公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息, 但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息, 我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 在此过程中, 考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过</p>

	<p>程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别</p>

	出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	胡东方	刘莹
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8楼	
审计报告日期	2026年3月30日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	33,368,910.27	58,675,777.68
结算备付金		4,920,810.82	1,046,506.02
存出保证金		522,743.66	462,613.73
交易性金融资产	7.4.7.2	227,676,605.62	149,665,669.02
其中：股票投资		227,676,605.62	149,665,669.02
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		3,459,400.79	2,104,085.24
应收股利		57.60	-
应收申购款		154,814.36	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		270,103,343.12	211,954,651.69
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		8,376,321.68	1,116,467.12
应付赎回款		2,804.27	-
应付管理人报酬		259,182.21	216,699.05
应付托管费		43,197.03	36,116.51
应付销售服务费		1,032.42	905.22
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	7.4.7.9	527,760.11	685,358.39
负债合计		9,210,297.72	2,055,546.29
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	204,252,379.69	203,548,579.55
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	56,640,665.71	6,350,525.85
净资产合计		260,893,045.40	209,899,105.40
负债和净资产总计		270,103,343.12	211,954,651.69

注：2025年12月31日，基金份额总额204,252,379.69份，其中京管泰富优势混合A基金份额净值1.2774元，基金份额总额201,816,316.05份；京管泰富优势混合C基金份额净值1.2663元，基金份额总额2,436,063.64份。

7.2 利润表

会计主体：京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025年1月1日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
一、营业总收入		59,606,247.88	11,582,892.30
1. 利息收入		165,818.22	716,943.09
其中：存款利息收入	7.4.7.13	165,818.22	230,372.62
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		-	486,570.47
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		56,768,783.75	13,030,970.93

其中：股票投资收益	7.4.7.14	54,063,742.95	10,262,272.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	2,705,040.80	2,768,698.20
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）	7.4.7.20	2,669,662.10	-2,172,953.95
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	1,983.81	7,932.23
减：二、营业总支出		3,466,793.98	3,110,387.85
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,764,394.08	2,482,666.94
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	460,732.27	413,777.86
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	9,291.34	29,445.16
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	232,376.29	184,497.89
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		56,139,453.90	8,472,504.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		56,139,453.90	8,472,504.45
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		56,139,453.90	8,472,504.45

7.3 净资产变动表

会计主体：京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	203,548,579.55	-	6,350,525.85	209,899,105.40
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	203,548,579.55	-	6,350,525.85	209,899,105.40
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	703,800.14	-	50,290,139.86	50,993,940.00
(一)、综合收益总额	-	-	56,139,453.90	56,139,453.90
(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)	703,800.14	-	263,218.24	967,018.38
其中：1. 基金申购款	3,494,729.32	-	573,072.89	4,067,802.21
2. 基金赎回款	-2,790,929.18	-	-309,854.65	-3,100,783.83
(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)	-	-	-6,112,532.28	-6,112,532.28
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	204,252,379.69	-	56,640,665.71	260,893,045.40
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	219,103,397.96	-	110,904.18	219,214,302.14
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	219,103,397.96	-	110,904.18	219,214,302.14
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-15,554,818.41	-	6,239,621.67	-9,315,196.74
(一)、综合收益总额	-	-	8,472,504.45	8,472,504.45
(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)	-15,554,818.41	-	-186,742.38	-15,741,560.79
其中：1. 基金申购款	289,700.81	-	-720.74	288,980.07
2. 基金赎回款	-15,844,519.22	-	-186,021.64	-16,030,540.86
(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)	-	-	-2,046,140.40	-2,046,140.40
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	203,548,579.55	-	6,350,525.85	209,899,105.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

朱瑜

基金管理人负责人

苍志刚

主管会计工作负责人

姚劼

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金(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[2019]617号《关于准予国开泰富泰祥纯债债券型证券投资

基金注册的批复》和证监许可[2023]1572号《关于准予国开泰富泰祥纯债债券型证券投资基金变更注册的批复》注册，由北京京管泰富基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《京管泰富优势企业混合型发起式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。经向中国证监会备案，《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金合同》于2023年11月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为250,611,496.85份基金份额，其中认购资金利息折合158,181.25份基金份额。本基金的基金管理人为北京京管泰富基金管理有限责任公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为100,088,889.78份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《京管泰富优势企业混合型发起式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，包括国内依法发行或上市股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、政府支持机构债券、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债、公开发行的次级债等）、资产支持证券、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购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的相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的50%。本基金持有的现金（不含结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中证800指数收益率×60%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×20%+中债总指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益,在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债,相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,确认为应计利息,包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债,相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息,以发生违约的风险为权重,计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额,确认预期信用损失。

于每个资产负债表日,本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的,处于第一阶段,本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备;金融工具自初始确认后已经发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具,本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加,认定为处于第一阶段的金融工具,按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具,按照其未扣除减值准备的账面余额和实际

利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申

购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代

缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等收益分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值各自减去对应每单位基金份额收益分配金额后均不能低于面值。本基金两类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信[2021]20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(1) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含

在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分) 的利息收入, 继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务, 以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入, 暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股票的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司 (“挂牌公司”) 取得的股息红利所得, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50%计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入, 应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起, 证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票, 按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 对基金运营过程中缴纳的增值税, 分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率, 计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
	2025 年 12 月 31 日	2024 年 12 月 31 日
活期存款	33,368,910.27	58,675,777.68
等于：本金	33,353,110.49	58,669,596.26
加：应计利息	15,799.78	6,181.42
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	33,368,910.27	58,675,777.68

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	227,548,848.07	-	227,676,605.62	127,757.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	227,548,848.07	-	227,676,605.62	127,757.55
项目	上年度末			
	2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	152,207,573.57	-	149,665,669.02	-2,541,904.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	152,207,573.57	-	149,665,669.02	-2,541,904.55

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	0.03	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	478,260.08	515,858.39
其中：交易所市场	478,260.08	515,858.39
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	49,500.00	169,500.00
合计	527,760.11	685,358.39

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

京管泰富优势混合 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	201,199,258.90	201,199,258.90
本期申购	1,434,440.16	1,434,440.16
本期赎回（以“-”号填列）	-817,383.01	-817,383.01
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	201,816,316.05	201,816,316.05

京管泰富优势混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,349,320.65	2,349,320.65
本期申购	2,060,289.16	2,060,289.16
本期赎回（以“-”号填列）	-1,973,546.17	-1,973,546.17
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	2,436,063.64	2,436,063.64

注：若本基金有分红及转换业务，申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均未产生其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

京管泰富优势混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,160,533.15	-2,872,396.19	6,288,136.96
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	9,160,533.15	-2,872,396.19	6,288,136.96
本期利润	52,864,115.98	2,695,983.49	55,560,099.47
本期基金份额交易产生的变动数	179,875.06	3,117.48	182,992.54
其中：基金申购款	261,569.28	11,230.96	272,800.24

基金赎回款	-81,694.22	-8,113.48	-89,807.70
本期已分配利润	-6,039,230.31	-	-6,039,230.31
本期末	56,165,293.88	-173,295.22	55,991,998.66

京管泰富优势混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	95,819.18	-33,430.29	62,388.89
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	95,819.18	-33,430.29	62,388.89
本期利润	605,675.82	-26,321.39	579,354.43
本期基金份额交易产生的变动数	22,570.91	57,654.79	80,225.70
其中：基金申购款	223,682.24	76,590.41	300,272.65
基金赎回款	-201,111.33	-18,935.62	-220,046.95
本期已分配利润	-73,301.97	-	-73,301.97
本期末	650,763.94	-2,096.89	648,667.05

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	151,609.27	165,503.02
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	12,483.52	61,681.27
其他	1,725.43	3,188.33
合计	165,818.22	230,372.62

注：“其他”为存出保证金利息收入和认申购款利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	54,063,742.95	10,262,272.73
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	54,063,742.95	10,262,272.73

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
卖出股票成交总额	2,329,712,267.65	1,498,189,931.29
减：卖出股票成本 总额	2,271,502,076.28	1,485,458,433.27
减：交易费用	4,146,448.42	2,469,225.29
买卖股票差价收 入	54,063,742.95	10,262,272.73

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
股票投资产生的股利 收益	2,705,040.80	2,768,698.20
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	2,705,040.80	2,768,698.20

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
1. 交易性金融资产	2,669,662.10	-2,172,953.95
股票投资	2,669,662.10	-2,172,953.95
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值 变动产生的预估增值税	-	-
合计	2,669,662.10	-2,172,953.95

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
基金赎回费收入	1,983.81	7,932.23
合计	1,983.81	7,932.23

7.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31 日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	10,787.44	1,497.89
账户维护费	18,000.00	18,000.00
公证费	10,000.00	-
律师费	25,000.00	-
港股通证券组合费	3,588.85	-
合计	232,376.29	184,497.89

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
北京京管泰富基金管理有限责任公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
北京银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
北京国有资本运营管理有限公司	基金管理人的股东
国泰证券投资信托股份有限公司	基金管理人的股东
北京京管泰富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
第一创业证券股份有限公司	基金管理人股东关联方

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,764,394.08	2,482,666.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	17,043.92	60,693.96
应支付基金管理人的净管理费	2,747,350.16	2,421,972.98

注：支付基金管理人北京京管泰富基金管理有限责任公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.2% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	460,732.27	413,777.86

注：支付基金托管人北京银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提，

逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.2\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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 2025年1月1日至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C	合计
北京京管泰富基金管理有限责任公司	-	49.28	49.28
北京银行股份有限公司	-	4,387.81	4,387.81
合计	-	4,437.09	4,437.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C	合计
北京京管泰富基金管理有限责任公司	-	304.09	304.09
北京银行股份有限公司	-	19,884.40	19,884.40
合计	-	20,188.49	20,188.49

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给北京京管泰富基金管理有限责任公司，再由北京京管泰富基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日 C 类基金份额销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.4\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 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的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日

	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
基金合同生效日（2023 年 11 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	568,683.84	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	568,683.84	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2784%	-
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
基金合同生效日（2023 年 11 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

7.4.10.5.2 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

京管泰富优势混合 A

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
北京国有资本运营管理有限公司	100,088,889.78	49.0026	100,088,889.78	49.1720

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件规定支付。

7.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
北京银行股份有限公司	33,368,910.27	151,609.27	58,675,777.68	165,503.02

注：本基金的银行存款由基金托管人北京银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

京管泰富优势混合 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	2025年11 月17日	-	2025年11 月17日	0.3000	6,037,694.00	1,536.31	6,039,230.31	-
合计	-	-	-	0.3000	6,037,694.00	1,536.31	6,039,230.31	-
京管泰富优势混合 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	2025年11 月17日	-	2025年11 月17日	0.3000	73,295.60	6.37	73,301.97	-
合计	-	-	-	0.3000	73,295.60	6.37	73,301.97	-

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于混合型证券投资基金，其预期风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金，低于股票型基金。本基金的投资范围主要包括股票、债券、资产支持证券等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的稳定收益。

本基金管理人建立了由风险控制委员会、督察长、法律合规部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理部门在识别、计量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资决策委员会和风险控制委员会，协助风险控制政策、风险应对策略的制定与实施。同时各业务条线、各部门，按照公司的风险管理总体目标、风险管理战略，制定与实施与公司整体风险承受能力相匹配的风险管理制度和相关风险应对措施、控制流程，并不断及时、准确、全面地将各部门或岗位的风险信息与监测情况向相关部门负责人和风险管理部门报告，确保风险管理工作覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。

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，将风险控制在公司可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人在商业银行开立的托管账户，投资其他银行存款由基金管理人根据投资制度审慎选择存款银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年度末，本基金未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 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于约定开放日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于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金

的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2025 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种，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等。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理岗位对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	33,368,910.27	-	-	-	33,368,910.27
结算备付金	4,920,810.82	-	-	-	4,920,810.82
存出保证金	522,743.66	-	-	-	522,743.66
交易性金融资产	-	-	-	227,676,605.62	227,676,605.62
应收股利	-	-	-	57.60	57.60
应收申购款	-	-	-	154,814.36	154,814.36
应收清算款	-	-	-	3,459,400.79	3,459,400.79
资产总计	38,812,464.75	-	-	231,290,878.37	270,103,343.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,804.27	2,804.27
应付管理人报酬	-	-	-	259,182.21	259,182.21
应付托管费	-	-	-	43,197.03	43,197.03
应付清算款	-	-	-	8,376,321.68	8,376,321.68
应付销售服务费	-	-	-	1,032.42	1,032.42
其他负债	-	-	-	527,760.11	527,760.11
负债总计	-	-	-	9,210,297.72	9,210,297.72
利率敏感度缺口	38,812,464.75	-	-	-222,080,580.65	260,893,045.40
上年度末 2024年12月31日					
资产					
货币资金	58,675,777.68	-	-	-	58,675,777.68
结算备付金	1,046,506.02	-	-	-	1,046,506.02
存出保证金	462,613.73	-	-	-	462,613.73
交易性金融资产	-	-	-	149,665,669.02	149,665,669.02
应收清算款	-	-	-	2,104,085.24	2,104,085.24
资产总计	60,184,897.43	-	-	151,769,754.26	211,954,651.69

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	216,699.05	216,699.05
应付托管费	-	-	-	36,116.51	36,116.51
应付清算款	-	-	-	1,116,467.12	1,116,467.12
应付销售服务费	-	-	-	905.22	905.22
其他负债	-	-	-	685,358.39	685,358.39
负债总计	-	-	-	2,055,546.29	2,055,546.29
利率敏感度缺口	60,184,897.43	-	-	-149,714,207.97	209,899,105.40

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于报告期末及上年末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外币计价的资产进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	54,062,577.22	-	54,062,577.22
资产合计	-	54,062,577.22	-	54,062,577.22
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	-	54,062,577.22	-	54,062,577.22
项目	上年度末 2024年12月31日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
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	-	-	-	-

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	所有外币相对人民币升值 5%	2,703,128.86	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-2,703,128.86	-

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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	227,676,605.62	87.27	149,665,669.02	71.30

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	227,676,605.62	87.27	149,665,669.02	71.30

7.4.13.4.3.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	8,891,576.44	7,363,329.42
	沪深 300 指数下跌 5%	-8,891,576.44	-7,363,329.42

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
---------------	-------------------------	--------------------------

第一层次	227,676,605.62	149,665,669.02
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	227,676,605.62	149,665,669.02

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2024 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	227,676,605.62	84.29
	其中：股票	227,676,605.62	84.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	38,289,721.09	14.18
8	其他各项资产	4,137,016.41	1.53
9	合计	270,103,343.12	100.00

注：1. 本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 54,062,577.22 元，占期末资产净值比例为 20.72%；

2. 由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	9,391,278.00	3.60
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,118,286.90	27.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,986,350.00	3.44
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	8,122,855.00	3.11
H	住宿和餐饮业	13,238,397.50	5.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,081,219.00	3.86
J	金融业	23,291,890.00	8.93
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	8,510,400.00	3.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	19,873,352.00	7.62
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	173,614,028.40	66.55

8.2.2 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（%）
基础材料	19,599.87	0.01
消费者非必需品	18,602,204.28	7.13

消费者常用品	181,682.70	0.07
能源	-	-
金融	4,883,652.74	1.87
医疗保健	316,677.96	0.12
工业	3,714,799.36	1.42
信息技术	6,084,672.49	2.33
电信服务	20,259,287.82	7.77
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	54,062,577.22	20.72

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3 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	600919	江苏银行	1,171,400	12,182,560.00	4.67
2	601211	国泰海通	540,600	11,109,330.00	4.26
3	00700	腾讯控股	20,300	10,982,884.23	4.21
4	600258	首旅酒店	634,770	10,632,397.50	4.08
5	09988	阿里巴巴-W	78,400	10,112,017.57	3.88
6	600426	华鲁恒升	316,830	9,957,966.90	3.82
7	01024	快手-W	160,600	9,276,403.59	3.56
8	002271	东方雨虹	677,000	9,200,430.00	3.53
9	688390	固德威	145,000	9,008,850.00	3.45
10	605090	九丰能源	208,500	8,986,350.00	3.44
11	601888	中国中免	90,000	8,510,400.00	3.26
12	002928	华夏航空	735,100	8,122,855.00	3.11
13	000888	峨眉山A	600,100	7,873,312.00	3.02
14	600031	三一重工	367,400	7,763,162.00	2.98
15	603171	税友股份	135,500	7,470,115.00	2.86
16	600438	通威股份	361,700	7,422,084.00	2.84
17	300421	力星股份	196,900	7,241,982.00	2.78
18	600276	恒瑞医药	117,000	6,969,690.00	2.67
19	002714	牧原股份	136,000	6,878,880.00	2.64
20	603983	丸美生物	200,600	6,649,890.00	2.55
21	603199	九华旅游	168,900	6,208,764.00	2.38
22	00981	中芯国际	92,500	5,969,493.88	2.29
23	000978	桂林旅游	799,900	5,791,276.00	2.22
24	600882	妙可蓝多	210,000	5,279,400.00	2.02
25	09636	九方智投控股	107,600	4,771,855.78	1.83
26	02015	理想汽车-W	74,000	4,334,462.46	1.66
27	03690	美团-W	40,500	3,778,756.35	1.45
28	01055	中国南方航空	640,000	3,364,313.86	1.29

		股份			
29	601127	赛力斯	21,700	2,624,832.00	1.01
30	000997	新大陆	92,200	2,611,104.00	1.00
31	301073	君亭酒店	100,000	2,606,000.00	1.00
32	002772	众兴菌业	172,200	2,512,398.00	0.96
33	01530	三生制药	14,500	316,677.96	0.12
34	09896	名创优品	9,000	295,894.87	0.11
35	00001	长和	5,000	239,127.50	0.09
36	01318	毛戈平	1,900	140,206.84	0.05
37	00165	中国光大控股	12,000	97,656.15	0.04
38	00317	中船防务	8,000	94,368.43	0.04
39	00780	同程旅行	4,000	81,073.03	0.03
40	01810	小米集团-W	1,600	56,794.47	0.02
41	01112	H&H 国际控股	3,500	41,475.86	0.02
42	02498	速腾聚创	1,100	36,363.64	0.01
43	03800	协鑫科技	23,000	22,020.50	0.01
44	01313	华润建材科技	14,000	19,599.87	0.01
45	01519	极兔速递-W	1,800	16,989.57	0.01
46	03908	中金公司	800	14,140.81	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	688981	中芯国际	23,451,215.16	11.17
1	00981	中芯国际	22,121,053.17	10.54
2	600941	中国移动	28,205,612.92	13.44
2	00941	中国移动	7,317,405.45	3.49
3	600919	江苏银行	30,499,216.00	14.53
4	600030	中信证券	23,163,852.00	11.04
4	06030	中信证券	6,344,595.08	3.02
5	600031	三一重工	28,453,988.00	13.56
6	600893	航发动力	28,055,620.00	13.37
7	002714	牧原股份	27,148,234.00	12.93
8	09988	阿里巴巴-W	26,866,636.19	12.80
9	688390	固德威	24,758,954.18	11.80
10	300750	宁德时代	23,560,736.00	11.22
11	605090	九丰能源	22,870,691.00	10.90
12	600760	中航沈飞	22,205,479.00	10.58
13	00700	腾讯控股	21,830,446.21	10.40
14	601211	国泰海通	21,415,729.00	10.20
15	688120	华海清科	21,261,330.70	10.13
16	600323	瀚蓝环境	20,521,343.75	9.78

17	600438	通威股份	20,211,278.00	9.63
18	600276	恒瑞医药	19,957,609.80	9.51
19	03800	协鑫科技	18,633,199.76	8.88
20	01530	三生制药	18,338,094.29	8.74
21	688111	金山办公	17,947,872.40	8.55
22	600426	华鲁恒升	17,800,244.00	8.48
23	300421	力星股份	17,759,205.00	8.46
24	002025	航天电器	17,195,766.80	8.19
25	01024	快手-W	17,014,776.90	8.11
26	000831	中国稀土	16,017,675.00	7.63
27	002928	华夏航空	15,812,872.27	7.53
28	688235	百济神州	8,453,290.19	4.03
28	06160	百济神州	7,217,341.65	3.44
29	300922	天秦装备	15,582,680.80	7.42
30	000526	学大教育	15,374,049.84	7.32
31	600570	恒生电子	14,881,060.00	7.09
32	300413	芒果超媒	14,758,142.00	7.03
33	00753	中国国航	11,071,472.61	5.27
33	601111	中国国航	3,662,062.00	1.74
34	600316	洪都航空	14,567,943.00	6.94
35	603993	洛阳钼业	14,543,068.00	6.93
36	000519	中兵红箭	14,340,859.29	6.83
37	601100	恒立液压	13,931,175.00	6.64
38	03690	美团-W	13,924,268.56	6.63
39	601881	中国银河	9,480,779.00	4.52
39	06881	中国银河	4,264,472.11	2.03
40	002558	巨人网络	13,176,017.00	6.28
41	301236	软通动力	13,019,443.75	6.20
42	603225	新凤鸣	12,979,322.00	6.18
43	688041	海光信息	12,967,316.94	6.18
44	600060	海信视像	12,946,503.40	6.17
45	300033	同花顺	12,780,052.84	6.09
46	000933	神火股份	12,753,701.00	6.08
47	600039	四川路桥	12,685,941.00	6.04
48	600926	杭州银行	12,525,335.00	5.97
49	300661	圣邦股份	12,387,968.90	5.90
50	300502	新易盛	12,273,042.00	5.85
51	603171	税友股份	12,232,120.00	5.83
52	603801	志邦家居	11,950,211.00	5.69
53	601899	紫金矿业	11,867,640.00	5.65
54	600863	华能蒙电	11,832,472.00	5.64
55	688213	思特威	11,298,846.68	5.38
56	002179	中航光电	11,235,049.00	5.35

57	000333	美的集团	11,090,350.00	5.28
58	601117	中国化学	10,639,617.00	5.07
59	688012	中微公司	10,319,567.31	4.92
60	601336	新华保险	10,283,318.00	4.90
61	02498	速腾聚创	10,146,727.74	4.83
62	688008	澜起科技	10,060,473.22	4.79
63	601888	中国中免	10,045,182.26	4.79
64	000997	新大陆	9,960,634.00	4.75
65	600150	中国船舶	9,931,421.48	4.73
66	002241	歌尔股份	9,912,778.00	4.72
67	600258	首旅酒店	9,837,314.00	4.69
68	02015	理想汽车-W	9,798,384.59	4.67
69	00165	中国光大控股	9,598,405.39	4.57
70	600988	赤峰黄金	9,574,800.00	4.56
71	603901	永创智能	9,412,521.00	4.48
72	000425	徐工机械	9,391,611.00	4.47
73	601665	齐鲁银行	9,349,456.00	4.45
74	600900	长江电力	9,240,435.00	4.40
75	002601	龙佰集团	9,220,385.00	4.39
76	000158	常山北明	9,047,729.00	4.31
77	002271	东方雨虹	9,043,162.00	4.31
78	600642	申能股份	8,951,979.00	4.26
79	300002	神州泰岳	8,894,231.00	4.24
80	02628	中国人寿	8,848,441.52	4.22
81	600882	妙可蓝多	8,686,325.98	4.14
82	600398	海澜之家	8,581,766.00	4.09
83	01776	广发证券	4,822,710.81	2.30
83	000776	广发证券	3,704,070.00	1.76
84	601600	中国铝业	8,411,535.00	4.01
85	600764	中国海防	8,354,493.00	3.98
86	688220	翱捷科技	8,331,962.05	3.97
87	688750	金天钛业	8,318,006.49	3.96
88	03908	中金公司	8,220,869.33	3.92
89	603199	九华旅游	8,200,533.00	3.91
90	000807	云铝股份	8,185,018.32	3.90
91	300773	拉卡拉	8,158,319.00	3.89
92	603885	吉祥航空	8,143,976.00	3.88
93	300339	润和软件	8,079,216.00	3.85
94	002049	紫光国微	8,049,411.00	3.83
95	002226	江南化工	8,039,831.00	3.83
96	301600	慧翰股份	7,847,710.00	3.74
97	688361	中科飞测	7,845,787.44	3.74
98	600095	湘财股份	7,833,339.00	3.73

99	09992	泡泡玛特	7,780,402.89	3.71
100	601595	上海电影	7,774,230.00	3.70
101	00317	中船防务	7,727,261.91	3.68
102	09896	名创优品	7,696,602.73	3.67
103	002739	万达电影	7,651,207.99	3.65
104	09636	九方智投控股	7,649,634.47	3.64
105	000888	峨眉山 A	7,645,383.00	3.64
106	688484	南芯科技	7,547,849.57	3.60
107	600486	扬农化工	7,521,913.00	3.58
108	688543	国科军工	7,515,626.68	3.58
109	601688	华泰证券	7,435,115.00	3.54
110	000063	中兴通讯	7,343,535.00	3.50
111	601006	大秦铁路	7,312,700.00	3.48
112	300364	中文在线	7,248,519.00	3.45
113	300274	阳光电源	7,109,355.00	3.39
114	688036	传音控股	7,092,150.20	3.38
115	600536	中国软件	7,075,465.00	3.37
116	603258	电魂网络	7,053,263.00	3.36
117	603983	丸美生物	7,016,633.00	3.34
118	688072	拓荆科技	7,005,189.33	3.34
119	01313	华润建材科技	6,966,558.26	3.32
120	002539	云图控股	6,921,171.00	3.30
121	600118	中国卫星	6,883,478.00	3.28
122	300652	雷迪克	6,805,400.00	3.24
123	002273	水晶光电	6,740,367.00	3.21
124	600153	建发股份	6,718,824.00	3.20
125	01171	兖矿能源	6,718,366.40	3.20
126	000001	平安银行	6,678,200.00	3.18
127	000830	鲁西化工	6,665,589.00	3.18
128	002387	维信诺	6,621,171.00	3.15
129	300133	华策影视	6,613,481.00	3.15
130	000977	浪潮信息	6,582,135.00	3.14
131	01071	华电国际电力 股份	6,519,756.17	3.11
132	300394	天孚通信	6,505,737.00	3.10
133	000543	皖能电力	6,505,495.00	3.10
134	603119	浙江荣泰	6,431,869.00	3.06
135	603444	吉比特	6,268,410.00	2.99
136	688521	芯原股份	6,231,139.04	2.97
137	300395	菲利华	6,170,360.00	2.94
138	600309	万华化学	6,136,585.00	2.92
139	601699	潞安环能	6,045,664.00	2.88
140	600482	中国动力	6,023,748.00	2.87
141	000680	山推股份	5,994,253.00	2.86

142	000506	招金黄金	5,992,632.00	2.86
143	00916	龙源电力	5,947,896.32	2.83
144	601601	中国太保	5,834,872.00	2.78
145	300761	立华股份	5,833,153.00	2.78
146	603986	兆易创新	5,797,963.00	2.76
147	688288	鸿泉技术	5,788,952.89	2.76
148	002624	完美世界	5,787,100.00	2.76
149	000034	神州数码	5,746,646.00	2.74
150	01347	华虹半导体	5,708,233.01	2.72
151	688068	热景生物	5,615,191.39	2.68
152	02419	德康农牧	5,614,420.87	2.67
153	301307	美利信	5,574,949.00	2.66
154	600415	小商品城	5,551,882.00	2.65
155	603920	世运电路	5,489,316.00	2.62
156	600023	浙能电力	5,364,930.00	2.56
157	601328	交通银行	5,350,244.00	2.55
158	688234	天岳先进	5,325,576.99	2.54
159	002541	鸿路钢构	5,305,903.00	2.53
160	000978	桂林旅游	5,296,582.00	2.52
161	002709	天赐材料	5,201,768.04	2.48
162	603162	海通发展	5,142,266.00	2.45
163	01896	猫眼娱乐	5,103,830.82	2.43
164	605299	舒华体育	5,080,074.00	2.42
165	600862	中航高科	5,076,654.00	2.42
166	601519	大智慧	4,800,787.00	2.29
167	601872	招商轮船	4,797,103.00	2.29
168	300433	蓝思科技	4,785,911.00	2.28
169	002555	三七互娱	4,702,149.00	2.24
170	002085	万丰奥威	4,643,278.00	2.21
171	300553	集智股份	4,615,940.50	2.20
172	300567	精测电子	4,554,203.00	2.17
173	688500	慧辰股份	4,455,788.97	2.12
174	688778	厦钨新能	4,422,857.05	2.11
175	300740	水羊股份	4,414,236.00	2.10
176	300533	冰川网络	4,412,417.00	2.10
177	00001	长和	4,383,173.08	2.09
178	01810	小米集团-W	4,367,877.16	2.08
179	600547	山东黄金	4,289,436.00	2.04
180	601166	兴业银行	4,287,740.00	2.04
181	603019	中科曙光	4,245,796.00	2.02
182	603170	宝立食品	4,239,827.00	2.02
183	601009	南京银行	4,229,792.00	2.02
184	688722	同益中	4,225,966.27	2.01

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	27,221,130.15	12.97
1	00981	中芯国际	21,014,314.06	10.01
2	600941	中国移动	28,510,516.72	13.58
2	00941	中国移动	7,140,194.88	3.40
3	300750	宁德时代	32,675,207.34	15.57
4	600030	中信证券	23,902,359.95	11.39
4	06030	中信证券	7,583,595.12	3.61
5	600893	航发动力	28,666,742.00	13.66
6	688120	华海清科	26,029,273.02	12.40
7	600760	中航沈飞	22,424,312.00	10.68
8	600031	三一重工	21,105,810.00	10.06
9	600323	瀚蓝环境	20,988,066.00	10.00
10	002714	牧原股份	20,215,690.32	9.63
11	688111	金山办公	20,189,853.20	9.62
12	600926	杭州银行	20,035,099.00	9.55
13	600919	江苏银行	18,492,302.00	8.81
14	09988	阿里巴巴-W	18,350,318.63	8.74
15	605090	九丰能源	18,341,378.00	8.74
16	000425	徐工机械	18,314,846.24	8.73
17	01530	三生制药	18,135,528.30	8.64
18	03800	协鑫科技	18,005,636.83	8.58
19	688390	固德威	17,735,421.58	8.45
20	002025	航天电器	16,697,020.60	7.95
21	688235	百济神州	8,526,354.98	4.06
21	06160	百济神州	7,668,734.32	3.65
22	600438	通威股份	16,189,282.76	7.71
23	600316	洪都航空	15,555,429.00	7.41
24	300922	天秦装备	15,466,075.00	7.37
25	00753	中国国航	11,682,592.14	5.57
25	601111	中国国航	3,616,257.00	1.72
26	000519	中兵红箭	15,267,123.00	7.27
27	000831	中国稀土	15,264,463.45	7.27
28	603993	洛阳钼业	14,988,810.00	7.14
29	000526	学大教育	14,971,954.08	7.13
30	002475	立讯精密	14,917,466.00	7.11
31	600570	恒生电子	14,763,640.20	7.03
32	300413	芒果超媒	14,634,471.00	6.97
33	601100	恒立液压	14,081,310.78	6.71
34	688041	海光信息	13,780,020.65	6.57
35	601881	中国银河	9,611,412.00	4.58

35	06881	中国银河	3,959,541.47	1.89
36	300661	圣邦股份	13,513,012.64	6.44
37	300421	力星股份	13,212,103.00	6.29
38	600060	海信视像	13,203,880.48	6.29
39	600039	四川路桥	13,096,835.00	6.24
40	301236	软通动力	13,039,416.00	6.21
41	002241	歌尔股份	13,032,003.00	6.21
42	002558	巨人网络	12,912,222.00	6.15
43	600276	恒瑞医药	12,877,349.80	6.14
44	300033	同花顺	12,843,157.00	6.12
45	603801	志邦家居	12,757,426.00	6.08
46	600863	华能蒙电	12,573,662.00	5.99
47	688213	思特威	12,531,435.77	5.97
48	603225	新凤鸣	12,501,840.00	5.96
49	601899	紫金矿业	12,088,452.00	5.76
50	000333	美的集团	11,558,660.00	5.51
51	000933	神火股份	11,537,211.00	5.50
52	00700	腾讯控股	11,409,114.17	5.44
53	002179	中航光电	11,354,709.72	5.41
54	688008	澜起科技	11,160,610.12	5.32
55	601211	国泰海通	11,097,735.02	5.29
56	601336	新华保险	10,976,250.00	5.23
57	688012	中微公司	10,835,232.26	5.16
58	300502	新易盛	10,798,307.00	5.14
59	601117	中国化学	10,723,012.00	5.11
60	300773	拉卡拉	10,342,222.00	4.93
61	002273	水晶光电	10,149,822.00	4.84
62	603901	永创智能	10,133,363.00	4.83
63	600150	中国船舶	9,995,200.00	4.76
64	601665	齐鲁银行	9,869,374.00	4.70
65	002049	紫光国微	9,863,678.00	4.70
66	000680	山推股份	9,757,929.00	4.65
67	00165	中国光大控股	9,673,666.65	4.61
68	688750	金天钛业	9,528,731.18	4.54
69	600988	赤峰黄金	9,509,602.00	4.53
70	000063	中兴通讯	9,212,965.00	4.39
71	300002	神州泰岳	9,203,294.00	4.38
72	300652	雷迪克	9,126,689.00	4.35
73	01776	广发证券	5,394,235.15	2.57
73	000776	广发证券	3,701,750.00	1.76
74	000158	常山北明	9,082,631.00	4.33
75	300339	润和软件	9,047,010.00	4.31
76	02498	速腾聚创	9,024,373.03	4.30

77	600900	长江电力	8,975,056.00	4.28
78	000807	云铝股份	8,933,618.70	4.26
79	03690	美团-W	8,772,110.44	4.18
80	02628	中国人寿	8,732,356.81	4.16
81	600095	湘财股份	8,699,533.00	4.14
82	601600	中国铝业	8,607,400.00	4.10
83	603920	世运电路	8,541,098.00	4.07
84	600764	中国海防	8,510,325.00	4.05
85	002601	龙佰集团	8,501,560.00	4.05
86	600023	浙能电力	8,468,502.00	4.03
87	600426	华鲁恒升	8,416,003.00	4.01
88	600642	申能股份	8,377,225.00	3.99
89	601595	上海电影	8,171,081.00	3.89
90	002928	华夏航空	8,130,872.00	3.87
91	688361	中科飞测	8,085,820.50	3.85
92	600398	海澜之家	8,076,970.00	3.85
93	002938	鹏鼎控股	8,051,356.00	3.84
94	600486	扬农化工	7,994,944.00	3.81
95	688036	传音控股	7,983,019.36	3.80
96	603119	浙江荣泰	7,932,295.00	3.78
97	688484	南芯科技	7,895,245.43	3.76
98	01024	快手-W	7,879,837.46	3.75
99	603885	吉祥航空	7,863,454.00	3.75
100	688220	翱捷科技	7,798,567.11	3.72
101	688543	国科军工	7,764,079.85	3.70
102	600118	中国卫星	7,725,790.00	3.68
103	601688	华泰证券	7,667,685.00	3.65
104	603444	吉比特	7,651,434.00	3.65
105	03908	中金公司	7,593,693.56	3.62
106	301307	美利信	7,527,846.00	3.59
107	00317	中船防务	7,506,895.20	3.58
108	601006	大秦铁路	7,485,300.00	3.57
109	300274	阳光电源	7,471,818.00	3.56
110	002739	万达电影	7,438,497.00	3.54
111	603258	电魂网络	7,430,446.00	3.54
112	002226	江南化工	7,377,802.00	3.51
113	09992	泡泡玛特	7,333,642.22	3.49
114	688288	鸿泉技术	7,305,789.03	3.48
115	002539	云图控股	7,145,932.00	3.40
116	301600	慧翰股份	7,130,611.07	3.40
117	688072	拓荆科技	7,094,552.88	3.38
118	300364	中文在线	7,087,399.00	3.38
119	01071	华电国际电力 股份	7,080,283.92	3.37

120	600536	中国软件	7,055,835.00	3.36
121	300133	华策影视	7,038,622.00	3.35
122	002697	红旗连锁	7,021,485.00	3.35
123	000997	新大陆	7,016,682.00	3.34
124	002387	维信诺	6,875,764.00	3.28
125	603529	爱玛科技	6,849,377.06	3.26
126	002532	天山铝业	6,830,813.00	3.25
127	300395	菲利华	6,804,472.00	3.24
128	000543	皖能电力	6,778,150.00	3.23
129	600153	建发股份	6,772,567.00	3.23
130	01313	华润建材科技	6,661,353.73	3.17
131	601985	中国核电	6,651,804.00	3.17
132	000977	浪潮信息	6,648,932.00	3.17
133	688521	芯原股份	6,624,485.45	3.16
134	000830	鲁西化工	6,622,154.00	3.15
135	000001	平安银行	6,621,113.00	3.15
136	000913	钱江摩托	6,620,428.00	3.15
137	01171	兖矿能源	6,502,010.28	3.10
138	688068	热景生物	6,453,509.99	3.07
139	600163	中闽能源	6,419,320.00	3.06
140	09896	名创优品	6,348,210.42	3.02
141	002916	深南电路	6,344,353.00	3.02
142	00916	龙源电力	6,302,597.11	3.00
143	601166	兴业银行	6,302,370.00	3.00
144	601601	中国太保	6,248,412.00	2.98
145	01347	华虹半导体	6,110,395.66	2.91
146	603986	兆易创新	6,088,241.00	2.90
147	002709	天赐材料	6,019,775.00	2.87
148	600309	万华化学	5,924,157.00	2.82
149	603162	海通发展	5,819,844.54	2.77
150	000506	招金黄金	5,819,435.00	2.77
151	600415	小商品城	5,814,908.00	2.77
152	002624	完美世界	5,742,878.00	2.74
153	02419	德康农牧	5,681,312.16	2.71
154	300394	天孚通信	5,571,589.00	2.65
155	300761	立华股份	5,482,158.00	2.61
156	688234	天岳先进	5,466,070.08	2.60
157	605299	舒华体育	5,409,807.00	2.58
158	688500	慧辰股份	5,369,476.74	2.56
159	601519	大智慧	5,324,282.00	2.54
160	000034	神州数码	5,299,683.00	2.52
161	601328	交通银行	5,257,000.00	2.50
162	01896	猫眼娱乐	5,243,969.92	2.50

163	002541	鸿路钢构	5,194,449.00	2.47
164	601699	潞安环能	5,143,852.00	2.45
165	688518	联赢激光	5,034,232.39	2.40
166	002555	三七互娱	5,027,515.00	2.40
167	300308	中际旭创	5,026,031.80	2.39
168	600482	中国动力	4,915,021.00	2.34
169	300433	蓝思科技	4,909,533.00	2.34
170	603171	税友股份	4,866,939.00	2.32
171	300533	冰川网络	4,838,606.00	2.31
172	601872	招商轮船	4,832,282.00	2.30
173	300567	精测电子	4,713,751.00	2.25
174	600862	中航高科	4,707,622.00	2.24
175	00001	长和	4,700,209.45	2.24
176	600547	山东黄金	4,612,125.00	2.20
177	300119	瑞普生物	4,538,210.00	2.16
178	300553	集智股份	4,528,035.00	2.16
179	300740	水羊股份	4,399,864.09	2.10
180	688722	同益中	4,325,241.62	2.06
181	688629	华丰科技	4,311,448.39	2.05
182	300058	蓝色光标	4,272,247.00	2.04
183	601009	南京银行	4,254,600.00	2.03
184	603979	金诚信	4,199,456.00	2.00

8.4.3 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	2,346,843,350.78
卖出股票收入（成交）总额	2,329,712,267.65

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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

在报告编制日前一年内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京首旅酒店(集团)股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司出现了受到处罚的情况。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期内投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 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	522,743.66
2	应收清算款	3,459,400.79
3	应收股利	57.60
4	应收利息	-
5	应收申购款	154,814.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,137,016.41

8.12.4 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可转换债券。

8.12.5 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。

8.12.6 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，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总份 额比例 (%)
京管泰富 优势混合 A	105	1,922,060.15	200,718,685.34	99.46	1,097,630.71	0.54
京管泰富 优势混合 C	144	16,917.11	0.00	0.00	2,436,063.64	100.00
合计	249	820,290.68	200,718,685.34	98.27	3,533,694.35	1.73

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所 有从业人员持 有本基金	京管泰富优势混合 A	213,179.43	0.1056
	京管泰富优势混合 C	10,163.95	0.4172
	合计	223,343.38	0.1093

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、 基金投资和研 究部门负责 人持有本开 放式基金	京管泰富优势混合 A	10~50
	京管泰富优势混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经 理持有本开 放式基金	京管泰富优势混合 A	0~10
	京管泰富优势混合 C	-
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份 额 占基 金总 份 额 比 例 (%)	发起份 额总 数	发起份 额占 基金 总份 额 比 例(%)	发起份 额承 诺持 有 期 限
基金管理人固有资 金	-	-	-	-	-
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	100,088,889.78	49.0026	100,088,889.78	49.0026	不少于三 年
其他	-	-	-	-	-

合计	100,088,889.78	49.0026	100,088,889.78	49.0026	-
----	----------------	---------	----------------	---------	---

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	京管泰富优势混合 A	京管泰富优势混合 C
基金合同生效日 (2023 年 11 月 17 日) 基金份额总额	208,426,444.88	42,185,051.97
本报告期期初基金份 额总额	201,199,258.90	2,349,320.65
本报告期基金总申购 份额	1,434,440.16	2,060,289.16
减：本报告期基金总 赎回份额	817,383.01	1,973,546.17
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	201,816,316.05	2,436,063.64

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,会议投票表决时间自 2024 年 12 月 9 日起,至 2025 年 1 月 6 日 17:00 止,计票工作于 2025 年 1 月 8 日完成。本次基金份额持有人大会于 2025 年 1 月 8 日表决通过了《关于修改京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金合同有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。自 2025 年 1 月 8 日起,调整后的《基金合同》正式生效。详情请见本基金管理人 2025 年 1 月 9 日发布的《北京京管泰富基金管理有限责任公司关于京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》、更新后的《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金合同》及其他产品法律文件。

11.2 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

1. 报告期内,基金管理人无重大人事变动。
2. 报告期内,未发生基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

11.3 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,未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年 10 月 28 日起聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。报告期内本基金应支付审计费为 45,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人相关从业人员受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用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 (%)	
国泰海通证券股份有限公司	4	1,188,595,039.19	25.42	538,726.39	25.39	-
浙商证券股份有限公司	2	853,725,050.74	18.26	388,776.08	18.32	-
申万宏源证券有限公司	2	667,661,115.33	14.28	304,304.35	14.34	-
兴业证券股份有限公司	2	593,065,032.42	12.68	267,737.58	12.62	-
广发证券股份有限公司	2	570,358,599.43	12.20	258,184.53	12.17	-

中信建投证券股份有限公司	2	475,786,006.61	10.17	215,598.09	10.16	-
招商证券股份有限公司	2	327,364,774.71	7.00	148,364.75	6.99	-
第一创业证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-

注：1. 券商的选择标准和程序

(1) 券商选择标准：

- ①资质齐全，经营行为规范，在业内有良好的声誉。财务状况良好，具有持续盈利能力；
- ②具备健全且运行良好的合规风控管理架构，配备充足的合规风控人员，合规风控管理具备有效性。具备健全的内控制度，向公司提供的服务成果均经过证券公司内部审核，且对成果中包含的信息进行了识别、分析、处理，确保服务成果不包含任何内幕信息，合法合规；
- ③具备较强的交易服务能力，人员岗位配置充足，信息系统建设投入大，可提供安全、便捷、优质的证券交易服务；
- ④具备较强的研究能力，具备健全的研究服务内部管理制度、研究服务专业能力，业务质量与合规水平达标，并配备充足的专业人员，可以为公司在研究报告解读、跟踪研究等方面提供专业、审慎的研究服务。

(2) 券商选择与席位租用的流程：

- ①研究部遵照公司规章制度的标准对券商进行评估，提出拟选券商名单。
- ②经法律合规部、督察长审查通过后，研究部将拟选券商名单及相应的交易模式、席位租用安排（如有）、佣金费率、托管行等内容提交公司评审小组审议，评审小组组长由公司总经理担任。
- ③评审小组确定合作券商名单及相应交易模式、席位租用安排（如有）等内容后，研究部与相应券商签订相关协议，明确双方权利义务、服务内容、交易佣金的价格标准及计算方式。协议经相关部门、法律合规部、督察长、总经理审核后签署。
- ④协议签署完成后，研究部应将租用结果通知公司有关部门，有关部门据此进行相关工作安排。

2. 报告期内，本基金新增以下交易单元：第一创业证券股份有限公司交易单元 3 个，兴业证券股份有限公司交易单元 2 个。报告期内，本基金退租以下交易单元：国泰海通证券股份有限公司交易单元 2 个。

3. 本报告期内，国泰君安证券股份有限公司发布《国泰海通证券股份有限公司关于 2025 年 9

月 12 日实施法人切换、客户及业务迁移的公告》将原海通证券的客户及业务迁移合并入国泰海通。海通证券交易单元已整合至国泰海通证券，本报告期内涉及到的海通证券交易单元相关数据已合并至国泰海通证券列示。

11.7.2 基金租用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(%)
国泰海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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	北京京管泰富基金管理有限责任公司关于京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 9 日
2	京管泰富优势企业混合型发起式证券	基金管理人网站及中国	2025 年 1 月 9 日

	投资基金基金合同更新	证监会基金电子披露网站	
3	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金托管协议更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 9 日
4	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 9 日
5	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 9 日
6	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 9 日
7	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金更新基金合同及招募说明书提示性公告	上海证券报	2025 年 1 月 9 日
8	北京京管泰富基金管理有限责任公司关于京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的更正公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 9 日
9	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 22 日
10	北京京管泰富基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2025 年 1 月 22 日
11	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金开通转换业务公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 1 月 24 日
12	北京京管泰富基金管理有限责任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（2024 年度）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 29 日
13	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 3 月 29 日
14	北京京管泰富基金管理有限责任公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	上海证券报	2025 年 3 月 29 日
15	北京京管泰富基金管理有限责任公司关于警惕不法分子冒用公司名义进行非法活动的重要提示	上海证券报及基金管理人网站	2025 年 4 月 10 日
16	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 4 月 22 日

		站	
17	北京京管泰富基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2025 年 4 月 22 日
18	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 7 月 19 日
19	北京京管泰富基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2025 年 7 月 19 日
20	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 2025 年中期报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 8 月 30 日
21	北京京管泰富基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年中期报告提示性公告	上海证券报	2025 年 8 月 30 日
22	北京京管泰富基金管理有限责任公司关于旗下基金持有停牌股票估值调整的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 9 月 5 日
23	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金更新招募说明书和基金产品资料概要的提示性公告	上海证券报	2025 年 10 月 18 日
24	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 (A 类份额) 基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 18 日
25	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 (C 类份额) 基金产品资料概要更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 18 日
26	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金招募说明书更新	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 18 日
27	北京京管泰富基金管理有限责任公司旗下全部基金 2025 年 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2025 年 10 月 28 日
28	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 10 月 28 日
29	京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金 2025 年第一次分红公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 15 日
30	北京京管泰富基金管理有限责任公司关于调整旗下部分基金风险等级的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2025 年 11 月 21 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20250101-20251231	100,088,889.78	-	-	100,088,889.78	49.0026
	2	20250101-20251231	100,061,111.72	-	-	100,061,111.72	48.9890

产品特有风险

1. 报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20%的情况，由此可能导致的特有风险包括但不限于：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回、暂停赎回或延期办理赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权；

2. 《基金合同》生效满三年后继续存续的，连续 50 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，本基金将根据《基金合同》的约定进入清算程序并终止，无需召开基金份额持有人大会。投资人将面临基金合同可能终止的不确定性风险；

3. 本基金为发起式基金，本基金发起资金提供方对本基金的认购，并不代表对本基金的风险或收益的任何判断、预测、推荐和保证，发起资金也并不用于对投资者投资亏损的补偿，投资者及发起资金提供方均自行承担投资风险。本基金发起资金认购的本基金份额持有期限自基金合同生效日起满 3 年后，发起资金提供方将根据自身情况决定是否继续持有，届时发起资金提供方有可能赎回认购的基金份额。另外，基金合同生效之日起三年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止。因此，投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金募集注册的文件；
2. 《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金基金合同》；
3. 《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金托管协议》；
4. 《京管泰富优势企业混合型发起式证券投资基金招募说明书》；

5. 基金管理人业务资格批准文件、营业执照；
6. 报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

基金管理人地址：北京市西城区西直门南小街国英园 9 号楼。

13.3 查阅方式

1. 投资者可登录基金管理人官方网站（www.cdbsfund.com）或在营业时间内到北京京管泰富基金管理有限责任公司免费查阅上述文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

2. 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人北京京管泰富基金管理有限责任公司。
客户服务中心电话：400-898-3299。

北京京管泰富基金管理有限责任公司

2026 年 3 月 31 日