

东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东财基金管理有限公司

基金托管人:中国民生银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告.....	9
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.....	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.....	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.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	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.....	14
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.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
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.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 本报告期投资基金情况.....	45
7.13 投资组合报告附注.....	48

§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 盈利投资者数量占比	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
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	51
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	51
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	53
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	53
10.8 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	53
10.9 其他重大事件	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	
基金简称	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）	
基金主代码	015237	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年05月17日	
基金管理人	东财基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,251,901.60份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C
下属分级基金的交易代码	015237	015238
报告期末下属分级基金的份额总额	25,389,180.66份	19,862,720.94份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过大类资产配置和精选优质基金构建投资组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	1、大类资产配置策略。本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券、基金和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。 2、基金优选策略。主动管理型基金以“基金经理”为主要研究对象，主要选择投资风格稳定、中长期业绩较好、操作上知行合一的基金经理所管理的基金，研究方法上定量、定性相结合。被动管理型基金方面，主要通过对跟踪指数研究、基金跟踪情况两方面进行

	考量。 其他投资策略还包括：股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×50%+中债总全价指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 本基金还可投资港股通标的股票。本基金投资港股通标的股票的，除了需要承担与内地证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，还面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		东财基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾勇	林盛
	联系电话	021-23526999	010-58560666
	电子邮箱	vip@dongcaijijin.com	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-9210-107	95568
传真		021-23526940	010-57093382
注册地址		西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼2层01室	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		200030	100031
法定代表人		戴彦	高迎欣

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
----------------	-------

登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.dongcaijijin.com
基金中期报告置备地点	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东财基金管理有限公司	上海市徐汇区宛平南路88号金座5楼

§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01月01日-2026年06月30日)	
	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C
本期已实现收益	82,332.37	187,964.91
本期利润	-339,083.82	-206,826.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0140	-0.0083
本期加权平均净值利润率	-1.42%	-0.86%
本期基金份额净值增长率	-1.22%	-1.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-948,680.35	-1,060,124.75
期末可供分配基金份额利润	-0.0374	-0.0534
期末基金资产净值	24,440,500.31	18,802,596.19
期末基金份额净值	0.9626	0.9466
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-3.74%	-5.34%

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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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。

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

东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）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	0.66%	0.76%	6.17%	0.63%	-5.51%	0.13%
过去六个月	-1.22%	0.80%	4.22%	0.57%	-5.44%	0.23%
过去一年	13.30%	0.86%	12.24%	0.51%	1.06%	0.35%
过去三年	9.50%	1.47%	17.73%	0.54%	-8.23%	0.93%
自基金合同 生效起至今	-3.74%	1.32%	17.11%	0.53%	-20.85%	0.79%

东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）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	0.56%	0.76%	6.17%	0.63%	-5.61%	0.13%
过去六个月	-1.42%	0.80%	4.22%	0.57%	-5.64%	0.23%
过去一年	12.82%	0.86%	12.24%	0.51%	0.58%	0.35%
过去三年	8.17%	1.46%	17.73%	0.54%	-9.56%	0.92%
自基金合同 生效起至今	-5.34%	1.32%	17.11%	0.53%	-22.45%	0.79%

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变动的比较

东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年05月17日-2026年06月30日)



东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年05月17日-2026年06月30日)



注：1、本基金基金合同于2022年5月17日生效。

2、本基金基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。

§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

东财基金管理有限公司成立于2018年10月26日，是由东方财富证券股份有限公司全资设立的子公司，公司坚持投资人利益优先原则，致力于在合规管理、风险控制的基础上，以市场变化和客户需求为导向，努力发展成为一家有先进经营理念、清晰发展战略、优秀经营团队、前瞻性产品规划、严谨投资流程和强烈使命感的基金管理公司，为投资者提供高品质的专业资产管理服务。

截至2026年6月30日，公司旗下管理62只证券投资基金--东财上证50交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证通信技术主题指数型发起式证券投资基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证医药卫生指数型发起式证券投资基金、东财量化精选混合型发起式证券投资基金、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证有色金属指数增强型发起式证券投资基金、东财中证高端装备制造指数增强型发起式证券投资基金、东财中证银行指数型发起式证券投资基金、东财中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证龙头家电指数型发起式证券投资基金、东财中证证券保险领先指数型发起式证券投资基金、东财中证云计算与大数据主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财国证消费电子主题指数增强型发起式证券投资基金、东财中证食品饮料指数增强型发起式证券投资基金、东财中证新能源指数增强型证券投资基金、东财数字经济优选混合型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金、东财稳健配置六个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、东财中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、东财中证证券公司30交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞利债券型证券投资基金、东财中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、东财慧心优选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份指数型发起式证券投资基金、东财中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金、东财卓越成长混合型发起式证券投资基金、东财景气驱动混合型发起式证券投资基金、东财中证细分化工产业主题指数型发起式证券投资基金、东财中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金、东财北证50成份指数型发起式证券投资基金、东财沪深300交易型开放式指数证券投资基金、东财中证500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证50交易型开放式指数证券投资基金、东财中证1-3年国债交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金、东财中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财创业板交易型开放式指数证券投资基金、东财

中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、东财30天滚动持有债券型发起式证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金、东财创业板综合增强策略交易型开放式指数证券投资基金、东财上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财上证科创板综合价格交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、东财鑫享30天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财禧悦90天滚动持有中短债债券型证券投资基金、东财启和混合型证券投资基金、东财北证50成份指数增强型发起式证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金联接基金、东财中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金、东财瑞兴债券型证券投资基金、东财新兴产业锐选混合型发起式证券投资基金、东财上证科创板100指数型证券投资基金、东财上证科创板200交易型开放式指数证券投资基金、东财中证工程机械主题交易型开放式指数证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
孟鸣	本基金基金经理	2022-10-31	-	11.5年	上海外国语大学文学学士。曾任上投摩根基金管理有限公司基金经理，现任东财基金管理有限公司FOF投资部副总监、基金经理。
王世忠	本基金基金经理助理	2025-11-10	-	7年	新加坡国立大学金融工程硕士。曾任国盛证券资产管理有限公司投资经理助理、天风（上海）证券资产管理有限公司投资研究岗，现任东财基金管理有限公司基金经理助理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期。

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3、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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规、基金合同的相关规定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，未发现存在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

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于公平交易管理的相关内部制度规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。公平交易制度规范的范围包括上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动以及包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

报告期内，基金管理人公平交易制度执行情况良好，未发现存在违反公平交易管理要求的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和基金管理人关于异常交易管理的相关内部制度规定，对本基金的异常交易行为进行监督检查，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

今年上半年各类资产的表现非常动荡，美国伊朗冲突为最主要的宏观事件，冲突的升级和降级以及由此引发的原油大涨大跌也影响了投资者对通胀和美联储加息预期的变化，从而也影响了黄金的上涨趋势，以及加息预期下对科技股高估值的担忧。在其他资产大幅波动的情况下，债券资产作为相对稳定的品种，在整个上半年波动相对较小，获得了资金的流入。

今年国内权益开局不错，多数板块呈现普涨的态势，随后机构在上证指数4100点以上持续对ETF进行大幅减持，市场虽然消化了减持压力，但市场风格开始越来越向科技板块集中，并且这种集中度在后期愈演愈烈，还出现了少数板块涨多数板块跌的跷跷板现象。我们从2季度公布的基金季报里面也看到，基金对电子通信板块的合计持仓比例也达到了历史最高水平。

我们的多资产组合在上半年结合宏观事件在大宗商品上的处理相对较好获得超额收益，主要的投资负贡献来自于国内权益资产，在极致的分化下，我们持有的低估值权重股和滞涨的其他科技板块并没有获得好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A份额净值为0.9626元，报告期内基金份额净值增长率为-1.22%，同期业绩比较基准收益率为4.22%；东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C份额净值为0.9466元，报告期内基金份额净值增长率为-1.42%，同期业绩比较基准收益率为4.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年的大类资产，我们认为美联储未来的加息预期变化依然是最值得关注的宏观线索，如果原油价格能够震荡下行，未来黄金的投资机会也值得关注。权益方面，当前美股和A股的科技板块都经历了大幅调整，目前位置的投资性价比会更优，我们会密切市场的变化和潜在的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。日常估值由基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值、基金资产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基金份额净值。

本基金基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会。估值委员会会对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、2026年1月27日至2026年4月28日、2026年5月14日至2026年6月30日，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。
- 2、本报告期内，本基金未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，按照相关法律法规规定和基金合同、托管协议的有关约定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的约定进行。

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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“关联方证券出借”、“各关联方投资本基金的情况”、“关联方承销证券”和“金融工具风险及管理”部分未在本托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§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：东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
-----	-----	--------------------	---------------------

资产：			
货币资金	6.4.7.1	2,998,843.74	4,444,563.62
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	40,045,297.43	45,223,556.27
其中：股票投资		-	-
基金投资		40,045,297.43	45,223,556.27
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		535,858.53	1,000,000.00
应收股利		49.29	13.09
应收申购款		10,435.37	168,656.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		43,590,484.36	50,836,789.79
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		249,029.41	362,185.17
应付管理人报酬		37,270.99	43,291.05
应付托管费		5,590.43	6,493.45

应付销售服务费		6,879.26	9,360.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	48,617.77	98,324.64
负债合计		347,387.86	519,654.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	45,251,901.60	52,052,478.30
未分配利润	6.4.7.8	-2,008,805.10	-1,735,343.24
净资产合计		43,243,096.50	50,317,135.06
负债和净资产总计		43,590,484.36	50,836,789.79

注：报告截止日2026年6月30日，东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A基金份额净值人民币0.9626元，基金份额总额25,389,180.66份；东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C基金份额净值人民币0.9466元，基金份额总额19,862,720.94份。基金份额总额合计为45,251,901.60份。

6.2 利润表

会计主体：东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		-171,748.99	4,448,831.20
1.利息收入		9,532.37	22,430.06
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,532.37	22,430.06
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-

其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		629,549.62	628,076.44
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	517,697.37	533,675.63
债券投资收益	6.4.7.12	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	111,852.25	94,400.81
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-816,207.56	3,793,337.21
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	5,376.58	4,987.49
减：二、营业总支出		374,161.29	636,581.87
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	238,353.43	432,117.20
2.托管费	6.4.10.2.2	35,751.82	61,350.34
3.销售服务费	6.4.10.2.3	48,018.12	135,040.88
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7.税金及附加		2,388.83	179.35
8.其他费用	6.4.7.21	49,649.09	7,894.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-545,910.28	3,812,249.33

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-545,910.28	3,812,249.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-545,910.28	3,812,249.33

6.3 净资产变动表

会计主体：东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	52,052,478.30	-1,735,343.24	50,317,135.06
二、本期期初净资产	52,052,478.30	-1,735,343.24	50,317,135.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,800,576.70	-273,461.86	-7,074,038.56
（一）、综合收益总额	-	-545,910.28	-545,910.28
（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）	-6,800,576.70	272,448.42	-6,528,128.28
其中：1.基金申购款	11,828,334.38	-115,861.20	11,712,473.18
2.基金赎回款	-18,628,911.08	388,309.62	-18,240,601.46
（三）、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	45,251,901.60	-2,008,805.10	43,243,096.50
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	22,083,001.85	-4,536,668.62	17,546,333.23
二、本期期初净资产	22,083,001.85	-4,536,668.62	17,546,333.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	215,322,172.53	-33,364,053.34	181,958,119.19
（一）、综合收益总额	-	3,812,249.33	3,812,249.33
（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）	215,322,172.53	-37,176,302.67	178,145,869.86
其中：1.基金申购款	233,555,267.35	-40,270,608.60	193,284,658.75
2.基金赎回款	-18,233,094.82	3,094,305.93	-15,138,788.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	237,405,174.38	-37,900,721.96	199,504,452.42

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:

顾勇

侯福岩

陆文澄

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

东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）（原西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金，已于2026年4月3日完成更名，以下简称“本基金”）系由基金管理人东财基金管理有限公司(原西藏东财基金管理有限公司,已于2025年9月15日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规以及《西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》（以下简称“基金合同”）、《西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书》（以下简称“招募说明书”）的规定，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[2022]155号文准予公开募集注册。本基金为契约型开放式基金，存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为56,347,262.05份，经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验证，并出具了编号为德师报（验）字（22）第00220号验资报告。经向中国证监会备案，基金合同于2022年5月17日正式生效。本基金的基金管理人为东财基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、基金合同及截至报告期末最新公告的招募说明书的有关规定，本基金投资于依法发行或上市的基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含QDII基金、香港互认基金）的基金份额、股票（包含主板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票及港股通标的股票、存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、现金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）。本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（含QDII基金、香港互认基金）的基金份额的比例不低于基金资产的80%；本基金对权益类资产的投资合计占基金资产的比例为30%-70%（其中，本基金投资于港股通标的股票不超过股票资产的50%）；本基金投资的权益类资产包括股票、股票型基金以及至少满足以下标准之一的混合型基金：（1）基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于

60%；（2）基金最近四个季度的定期报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于60%。本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，投资于货币市场基金的比例不超过基金资产的15%。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×50%＋中债总全价指数收益率×50%。

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、应用指南、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”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（财会[2022]14号）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况以及2026年1月1日至2026年6月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[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》、2008年9月18日上海证券交易所发布的《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》

及深圳交易所发布的《关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部国家税务总局证监会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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2021]33号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财税[2024]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》、国务院令第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、财税[2026]12号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

（2）对证券投资基金取得的自2025年8月8日之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复缴纳增值税；取得的在2025年8月8日之前已发行的国债、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）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；

（4）对证券投资基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。其中，对基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所挂牌交易的上市公司限售股，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。对基金通过港股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。基金通过港股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；

（5）对于证券投资基金从事A股买卖，出让方按0.10%的税率缴纳证券（股票）交易印花税，受让方不再缴纳印花税；自2023年8月28日起，出让方减按0.05%的税率缴纳证券（股票）交易印花税。对于基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税；

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	1,332,865.35
等于：本金	1,332,720.05
加：应计利息	145.30
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	1,665,978.39
等于：本金	1,665,722.03
加：应计利息	256.36
减：坏账准备	-
合计	2,998,843.74

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-	-
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		40,391,970.78	-	40,045,297.43	-346,673.35
其他		-	-	-	-
合计		40,391,970.78	-	40,045,297.43	-346,673.35

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
----	--------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	19.27
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	8,926.92
预提费用-信息披露费	39,671.58
合计	48,617.77

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A

金额单位：人民币元

项目 (东财均衡配置三个月持有混 合发起式（FOF）A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	23,559,335.91	23,559,335.91
本期申购	7,290,856.32	7,290,856.32
本期赎回（以“-”号填列）	-5,461,011.57	-5,461,011.57
本期末	25,389,180.66	25,389,180.66

6.4.7.7.2 东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C

金额单位：人民币元

项目 (东财均衡配置三个月持有混 合发起式（FOF）C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,493,142.39	28,493,142.39
本期申购	4,537,478.06	4,537,478.06
本期赎回（以“-”号填列）	-13,167,899.51	-13,167,899.51
本期末	19,862,720.94	19,862,720.94

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**6.4.7.8.1 东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A**

单位：人民币元

项目 (东财均衡配置三个月 持有混合发起式（FO F）A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-331,894.87	-269,049.10	-600,943.97
本期期初	-331,894.87	-269,049.10	-600,943.97
本期利润	82,332.37	-421,416.19	-339,083.82
本期基金份额交易产 生的变动数	47,520.95	-56,173.51	-8,652.56
其中：基金申购款	73,438.88	-108,761.71	-35,322.83
基金赎回款	-25,917.93	52,588.20	26,670.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-202,041.55	-746,638.80	-948,680.35

6.4.7.8.2 东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C

单位：人民币元

项目 (东财均衡配置三个月 持有混合发起式（FO F）C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-811,384.51	-323,014.76	-1,134,399.27
本期期初	-811,384.51	-323,014.76	-1,134,399.27
本期利润	187,964.91	-394,791.37	-206,826.46
本期基金份额交易产 生的变动数	140,203.71	140,897.27	281,100.98
其中：基金申购款	-47,386.99	-33,151.38	-80,538.37
基金赎回款	187,590.70	174,048.65	361,639.35
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-483,215.89	-576,908.86	-1,060,124.75
-----	-------------	-------------	---------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	2,308.50
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	6,212.15
结算备付金利息收入	-
其他	1,011.72
合计	9,532.37

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

本基金本报告期无买卖股票差价收入。

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期无证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	150,270,927.46
减：卖出/赎回基金成本总额	149,646,873.50
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	19,906.97
减：交易费用	86,449.62
基金投资收益	517,697.37

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	111,852.25
合计	111,852.25

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-816,207.56
——股票投资	-
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-816,207.56
——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	-816,207.56

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	5,376.58
合计	5,376.58

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	7,326.51
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	111,511.98
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	25,195.40

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期未发生信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	8,926.92
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-

汇划手续费	1,050.59
合计	49,649.09

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无需要披露的重大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

本报告期间存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
东财基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国民生银行股份有限公司（“民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
东方财富证券股份有限公司（“东财证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构、基金证券经纪商
上海天天基金销售有限公司（“天天基金”）	与管理人受同一实际控制人控制的公司、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东财证券	247,574,015.83	100.00%	377,679,040.98	100.00%

6.4.10.1.6 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01月01日至2026年06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
东财证券	58,395.56	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06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
东财证券	74,170.96	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	238,353.43	432,117.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	72,428.54	117,825.45
应支付基金管理人的净管理费	165,924.89	314,291.75

注：本基金对基金财产中持有的基金管理人自身管理的基金部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中持有的基金管理人自身管理的其他基金部分所对应资产净值后剩余部分的1.00%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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扣除所持有本基金管理人自身管理的基金所对应的基金资产净值后余额，若为负数，则E取0

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	35,751.82	61,350.34

注：本基金对基金财产中持有的基金托管人自身托管的基金部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中持有的基金托管人自身托管的其他基金部分所对应资产净值后剩余部分的0.15%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.15\%\div \text{当年天数}$$

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扣除所持有本基金托管人自身托管的基金所对应的基金资产净值后余额，若为负数，则E取0

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01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财均衡配置三个月持有混合 发起式（FOF）A	东财均衡配置三个月持有混合 发起式（FOF）C	合计
民生银行	0.00	996.83	996.83
天天基金	0.00	28,089.81	28,089.81
东财证券	0.00	12,893.58	12,893.58
合计	0.00	41,980.22	41,980.22
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东财均衡配置三个月持有混合 发起式（FOF）A	东财均衡配置三个月持有混合 发起式（FOF）C	合计
民生银行	0.00	1,151.64	1,151.64
东财基金 管理有限公司	0.00	10,946.25	10,946.25
天天基金	0.00	84,132.89	84,132.89
东财证券	0.00	10,482.40	10,482.40
合计	0.00	106,713.18	106,713.18

			3.18
--	--	--	------

注：支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日C类基金份额对应的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的银行间同业市场债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	10,003,667.03	10,003,667.03
报告期间申购/买入总份额	3,523,253.47	-
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	13,526,920.50	10,003,667.03

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	53.28%	34.01%
---------------------	--------	--------

东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
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	-	-

注：1、本基金基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、申购份额含红利再投、转换入份额；赎回份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
民生银行-托管户	1,332,865.35	2,308.50	19,721,818.37	10,171.20
东财证券-证券资金户	1,665,978.39	6,212.15	5,693,622.37	9,640.80

注：1、本基金的银行存款由基金托管人民生银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于东财证券基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间无交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因从事证券交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

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

本基金为基金中基金，其预期收益和预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。本基金投资的金融工具主要包括基金投资、股票投资和债券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金基金管理人从事风险管理的主要目标是在有效控制上述风险的前提下，通过大类资产配置和精选优质基金构建投资组合，追求基金资产的长期增值，使本基金在风险和收益之间取得最佳平衡。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了由董事会、合规审计委员会、风险管理委员会、督察长、合规审计部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系，并明确了相应风险管理职能。

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同责任，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行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了投资银行存款白名单，通过对存款银行的信用评估来控制银行存款信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与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，违约风险发生的可能性很小。

本基金本报告期末未持有债券（上期末：同）。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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于锁定期届满后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自基金合同生效日满三个月起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约定了巨额赎回条款，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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过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。本基金主要投资于证券投资基金，其可在基金销售机构申购、赎回，不存在具有重大流动性风险的投资品种。

截至本报告期末，本基金无重大流动性风险。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年0 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	2,998,843.74	-	-	-	2,998,843.74
交易性金融资产	-	-	-	40,045,297.43	40,045,297.43
应收清算款	-	-	-	535,858.53	535,858.53
应收股利	-	-	-	49.29	49.29
应收申购款	-	-	-	10,435.37	10,435.37
资产总计	2,998,843.74	-	-	40,591,640.62	43,590,484.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	249,029.41	249,029.41
应付管理人报酬	-	-	-	37,270.99	37,270.99
应付托管费	-	-	-	5,590.43	5,590.43
应付销售服务费	-	-	-	6,879.26	6,879.26

其他负债	-	-	-	48,617.77	48,617.77
负债总计	-	-	-	347,387.86	347,387.86
利率敏感度缺口	2,998,843.74	-	-	40,244,252.76	43,243,096.50
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	4,444,563.62	-	-	-	4,444,563.62
交易性金融资产	-	-	-	45,223,556.27	45,223,556.27
应收清算款	-	-	-	1,000,000.00	1,000,000.00
应收股利	-	-	-	13.09	13.09
应收申购款	-	-	-	168,656.81	168,656.81
资产总计	4,444,563.62	-	-	46,392,226.17	50,836,789.79
负债					
应付赎回款	-	-	-	362,185.17	362,185.17
应付管理人报酬	-	-	-	43,291.05	43,291.05
应付托管费	-	-	-	6,493.45	6,493.45
应付销售服务费	-	-	-	9,360.42	9,360.42

其他负债	-	-	-	98,324.64	98,324.64
负债总计	-	-	-	519,654.73	519,654.73
利率敏感度缺口	4,444,563.62	-	-	45,872,571.44	50,317,135.06

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期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（上期末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于依法发行或上市的基金、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在构建和管理投资组合过程中，通过在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券、基金和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整；通过对单个证券的定性及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行动态修正，以主动应对可能发生的其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	40,045,297.43	92.61	45,223,556.27	89.88
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	40,045,297.43	92.61	45,223,556.27	89.88

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,309,559.98	3,581,981.29
	业绩比较基准下降5%	-2,309,559.98	-3,581,981.29

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：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值是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；

第三层次输入值是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06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	40,045,297.43	45,223,556.27
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	40,045,297.43	45,223,556.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收款项和其他金融负债，其公允价值和账面价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	40,045,297.43	91.87
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	2,998,843.74	6.88
8	其他各项资产	546,343.19	1.25
9	合计	43,590,484.36	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

本基金本报告期末未持有境内股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

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

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未进行股票投资。

7.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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投资。

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

股指期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

国债期货暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

主动管理型基金的优选：主动管理型基金以“基金经理”为主要研究对象，主要选择投资风格稳定、中长期业绩较好、操作上知行合一的基金经理所管理的基金，研究方法上定量、定性相结合。定量层面主要考量基金的收益、风险、稳定性、风格等特征；定性层面可通过基金经理访谈和调研的方式，对基金的投资理念、投资流程、风险控制

等进行全面梳理。定性访谈与定量数据校验，最终定位基金经理的投资风格特点，并以此形成基金库，后期进行持续跟踪和评估。

被动管理型基金的优选：被动管理型基金方面，主要通过对跟踪指数研究、基金跟踪情况两方面进行考量。指数研究层面，基金管理人将重点关注市场长期趋势与市场风格，通过研究指数基金所跟踪的标的指数，可对标的指数的行业分布、市值特征、风格特征等进行研究，结合市场确定指数的投资价值；基金跟踪层面，主要考量基金对指数的跟踪误差等。在ETF投资方面，基金管理人将结合基金的风险收益表现、基金规模、流动性、市场折（溢）价情况，选择市场表现良好、投资管理能力强、跟踪误差小、流动性好的ETF进行投资。

本基金通过大类资产配置和精选优质基金构建投资组合，在控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。

报告期内，本基金主要投资于开放式基金，符合基金合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	159206	卫星ETF永赢	交易型开放式	2,100,000.00	3,685,500.00	8.52	否
2	000385	景顺长城景颐双利债券A类	契约型开放式	1,808,646.61	3,465,366.90	8.01	否
3	206018	鹏华产业债债券A	契约型开放式	2,734,604.69	3,177,884.11	7.35	否
4	159502	嘉实标普生物科技精选行业ETF(QDII)	交易型开放式	1,800,000.00	2,943,000.00	6.81	否
5	159985	华夏饲料豆粕期货ETF	交易型开放式	1,400,000.00	2,779,000.00	6.43	否

6	015790	永赢高端装备智选混合发起C	契约型 开放式	1,872,468. 22	2,764,886. 57	6.39	否
7	518880	华安黄金ETF	交易型 开放式	250,000.0 0	2,094,500. 00	4.84	否
8	001235	中银国有企业债A	契约型 开放式	1,525,674. 18	1,973,459. 55	4.56	否
9	512070	易方达沪深300非银ETF	交易型 开放式	2,200,000. 00	1,724,800. 00	3.99	否
10	159980	大成有色金属期货ETF	交易型 开放式	800,000.0 0	1,644,800. 00	3.80	否
11	513120	广发中证香港创新药(QDII-ETF)	交易型 开放式	1,400,000. 00	1,481,200. 00	3.43	否
12	159227	华夏国证航天航空行业ETF	交易型 开放式	1,300,000. 00	1,452,100. 00	3.36	否
13	003474	南方天天利货币B	契约型 开放式	1,336,229. 57	1,336,229. 57	3.09	否
14	003401	工银可转债债券	契约型 开放式	747,088.0 2	1,233,965. 28	2.85	否
15	511090	鹏扬中债-30年期国债ETF	交易型 开放式	10,000.00	1,168,170. 00	2.70	否
16	513180	华夏恒生科技ETF(QDII)	交易型 开放式	2,000,000. 00	1,134,000. 00	2.62	否
17	512800	华宝中证银行ETF	交易型 开放式	1,500,000. 00	1,101,000. 00	2.55	否
18	000598	长盛生态环境混合A	契约型 开放式	130,666.1 3	872,888.9 5	2.02	否
19	512710	富国中证军工龙头ETF	交易型 开放式	1,100,000. 00	754,600.0 0	1.75	否
20	513010	易方达恒生科技ETF(QDII)	交易型 开放式	1,100,000. 00	642,400.0 0	1.49	否
21	159851	华宝中证金融科技主题ETF	交易型 开放式	1,000,000. 00	623,000.0 0	1.44	否
22	159941	广发纳指100ETF	交易型	300,000.0	494,400.0	1.14	否

			开放式	0	0		
23	511010	国泰上证5年期国债ETF	交易型 开放式	3,000.00	422,376.0 0	0.98	否
24	512880	国泰中证全指证券公司ETF	交易型 开放式	300,000.0 0	337,800.0 0	0.78	否
25	516100	华夏中证金融科技主题ETF	交易型 开放式	300,000.0 0	311,100.0 0	0.72	否
26	159981	建信能源化工期货ETF	交易型 开放式	150,000.0 0	212,700.0 0	0.49	否
27	008320	鹏华全球中短债债券C类人民币(QDII)	契约型 开放式	287,159.8 3	156,013.9 4	0.36	否
28	002401	南方亚洲美元收益债券(QDII)C(人民币)	契约型 开放式	49,805.76	48,446.06	0.11	否
29	001669	诺安聚鑫宝货币C	契约型 开放式	8,012.71	8,012.71	0.02	否
30	004137	博时合惠货币B	契约型 开放式	1,697.79	1,697.79	0.00	否

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

7.13.2 本基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票资产。

7.13.3 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	-

2	应收清算款	535,858.53
3	应收股利	49.29
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,435.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	546,343.19

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 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。

§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
东财 均衡 配置 三个 月持 有混	449	56,546.06	19,507,300.93	76.8 3%	5,881,879.73	23.17%

合发起式 (FOF) A						
东财均衡配置三个月持有混合发起式 (FOF) C	769	25,829.29	12,060,632.74	60.72%	7,802,088.20	39.28%
合计	1,185	38,187.26	31,567,933.67	69.76%	13,683,967.93	30.24%

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	80.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	东财均衡配置三个月持有混合发起式 (FOF) A	101,982.87	0.40%
	东财均衡配置三个月持有混合发起式 (FOF) C	-	-
	合计	101,982.87	0.23%

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	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A	0
	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A	10~50
	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C	0
	合计	10~50

8.5 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	13,526,920.50	29.89%	10,003,667.03	22.11%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	101,982.87	0.23%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	13,628,903.37	30.12%	10,003,667.03	22.11%	3年

注：仅基金管理人固有资金持有发起份额。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）A	东财均衡配置三个月持有混合发起式（FOF）C
基金合同生效日(2022年05月17日)基金份额总额	21,811,257.42	34,536,004.63
本报告期期初基金份额总额	23,559,335.91	28,493,142.39
本报告期基金总申购份额	7,290,856.32	4,537,478.06
减：本报告期基金总赎回份额	5,461,011.57	13,167,899.51
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,389,180.66	19,862,720.94

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：（1）自2026年2月13日起，倪永彪新任基金管理人督察长，离任总经理助理；沙福贵不再代任督察长。（2）自2026年2月27日起，顾勇新任基金管理人总经理、财务负责人，离任副总经理；沙福贵离任总经理、财务负责人。（3）根据基金管理人2026年2月28日发布的《东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告》，基金管理人近12个月内进行了董事变更。

基金托管人：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

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务的诉讼。本报告期内，无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内未改变投资策略

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

报告期内，本基金所投资的子基金未发生包括转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同、召开基金份额持有人大会及大会表决意见等重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到关于证券投资基金托管业务受调查或处罚的情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未收到证券投资基金托管业务相关从业人员受调查或处罚的情况。

10.8 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

10.8.1 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	
东财证券	4	-	-	58,395.56	100.00%	-

- 1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。
- 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、研究能力等因素的基础上，选择证券经纪商。

3、选择券商的程序：

- (1) 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商；
- (2) 本基金管理人与被选择的券商签订证券经纪服务协议。

10.8.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东财证券	-	-	-	-	-	-	247,574,015.83	100.00%

10.9 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	西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2025年第4季度报告	证监会规定网站	2026-01-22
2	东财基金管理有限公司关于更新旗下基金产品风险等级评价结果的公告	证监会规定网站及报刊	2026-01-29
3	东财基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-14
4	东财基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
5	东财基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证监会规定网站及报刊	2026-02-28
6	东财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）	证监会规定网站及报刊	2026-03-31
7	西藏东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2025年年度报告	证监会规定网站	2026-03-31

8	东财基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金全称的公告	证监会规定网站及报刊	2026-04-03
9	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-04-03
10	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议	证监会规定网站	2026-04-03
11	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同	证监会规定网站	2026-04-03
12	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）更新招募说明书	证监会规定网站	2026-04-03
13	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)2026年第1季度报告	证监会规定网站	2026-04-21
14	东财基金管理有限公司关于旗下证券投资基金投资资产支持证券的公告	证监会规定网站及报刊	2026-05-13
15	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金产品资料概要更新	证监会规定网站	2026-06-27
16	东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）招募说明书更新	证监会规定网站	2026-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额 份额占比

类别		20%的时间区间					
机构	1	2026-01-27至2026-06-30	10,003,667.03	3,523,253.47	-	13,526,920.50	29.89%
	2	2026-01-01至2026-06-30	12,060,632.74	-	-	12,060,632.74	26.65%
产品特有风险							
本基金由于存在上述单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况，存在以下特有风险：（1）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的基金份额净值波动风险；（2）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的流动性风险；（3）持有基金份额比例达到或超过20%的投资者大额赎回导致的巨额赎回风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会准予东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）募集注册的文件
- 二、《东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）基金合同》
- 三、《东财均衡配置三个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）托管协议》
- 四、法律意见书
- 五、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 六、基金托管人业务资格批件、营业执照
- 七、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可以在基金管理人或基金托管人办公场所查阅。

东财基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日