

东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年1月1日起至2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	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	13
§5 托管人报告	13
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	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	71
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	71
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	71
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	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 盈利投资者数量占比	73

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73
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	73
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	73
§9 开放式基金份额变动	74
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	74
10.4 基金投资策略的改变	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	74
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	75
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	75
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	79
§12 备查文件目录	79
12.1 备查文件目录	79
12.2 存放地点	79
12.3 查阅方式	79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金	
基金简称	东兴宸泰量化选股混合发起	
基金主代码	021812	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024年09月26日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,423,966.62份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴宸泰量化选股混合发起A	东兴宸泰量化选股混合发起C
下属分级基金的交易代码	021812	021813
报告期末下属分级基金的份额总额	78,249,096.35份	37,174,870.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的方式跟踪国内外宏观经济数据及政策变化，密切关注市场流动性变化情况，动态评估不同资产的估值水平变化，合理确定组合中权益资产、债券资产、货币市场工具及其他金融工具的投资比例。 1、资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、存托凭证投资策略；5、其他金融工具投资策略
业绩比较基准	中证全指指数收益率*80%+中债综合指数收益率*20%
风险收益特征	本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和预期风险水平理论上高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		东兴基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李宛霖	许俊
	联系电话	400-670-1800	010-66596688
	电子邮箱	xxpl@dnamc.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-670-1800	95566
传真		010-83770122	010-66594942
注册地址		北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		王洪亮	葛海蛟

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	http://www.dnamc.cn
基金中期报告置备地点	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期	
	(2026年01月01日-2026年06月30日)	
	东兴宸泰量化选股	东兴宸泰量化选股

	混合发起A	混合发起C
本期已实现收益	20,030.91	3,569,044.15
本期利润	-4,513,648.11	751,273.92
加权平均基金份额本期利润	-0.1379	0.0226
本期加权平均净值利润率	-8.38%	1.39%
本期基金份额净值增长率	11.54%	11.21%
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	47,863,886.62	22,115,979.12
期末可供分配基金份额利润	0.6117	0.5949
期末基金资产净值	129,224,374.49	60,750,952.32
期末基金份额净值	1.6514	1.6342
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	65.14%	63.42%

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

2、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3、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。

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

东兴宸泰量化选股混合发起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	6.34%	1.38%	9.83%	1.10%	-3.49%	0.28%
过去六个月	11.54%	1.49%	8.83%	1.06%	2.71%	0.43%
过去一年	36.93%	1.25%	25.24%	0.92%	11.69%	0.33%
自基金合同 生效起至今	65.14%	1.33%	51.58%	1.14%	13.56%	0.19%

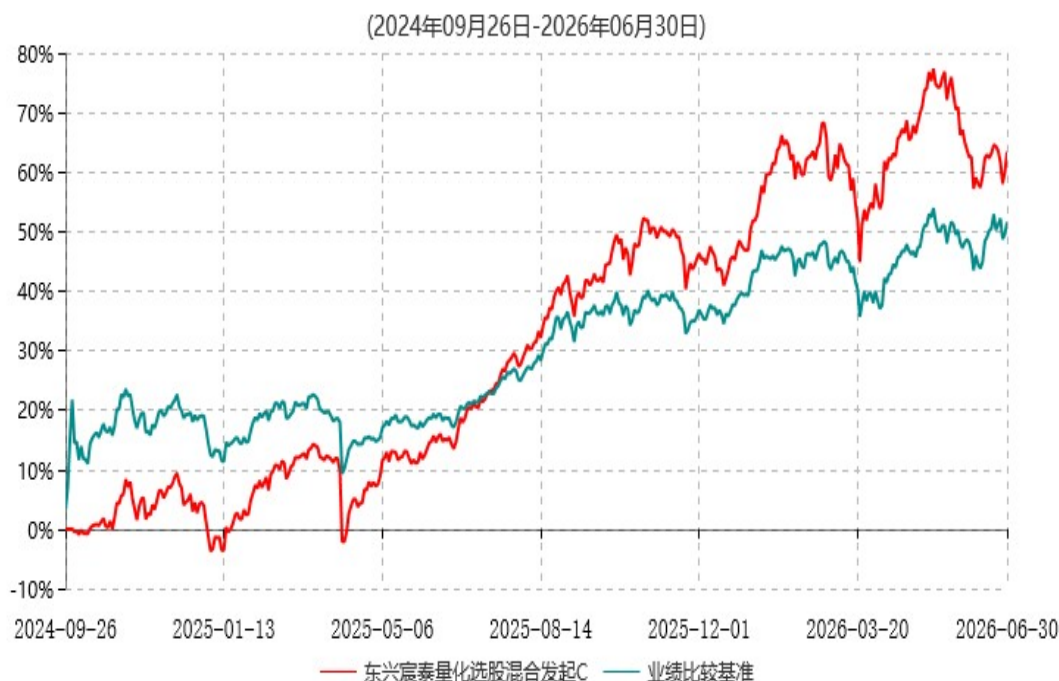
东兴宸泰量化选股混合发起C

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	6.19%	1.38%	9.83%	1.10%	-3.64%	0.28%
过去六个月	11.21%	1.49%	8.83%	1.06%	2.38%	0.43%
过去一年	36.12%	1.25%	25.24%	0.92%	10.88%	0.33%
自基金合同 生效起至今	63.42%	1.33%	51.58%	1.14%	11.84%	0.19%

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



东兴宸泰量化选股混合发起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



注：1、本基金基金合同生效日为2024年9月26日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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

东兴基金管理有限公司成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司，实际控制人为中央汇金投资有限责任公司。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：特色指数类产品--在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品--以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品--坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，75%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，坚持以投资者利益为上的原则，精心打造守正拓新、忠诚担当、团结协作、专业精进的专业化人才队伍，秉承“守正、诚信、专业、协作的”核心价值观，以“客户为本、践行担当、同心同行、稳健致远”为使命，努力打造专业稳健、普惠为民、深受信赖的新时代公募基金管理公司。

截至2026年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金、东兴数字经济混合型发起式证券投资基金、东兴鑫颐3个月滚动持有纯债债券型证券投资基金、东兴成长优选混合型发起式证券投资基金、东兴医药生物量化选股混合型证券投资基金、东兴兴诚利率债债券型证券投资基金、东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金、东兴红利优选混合型证券投资基金、东兴中证A500指数增强型证券投资基金、东兴产业升级混合型发起式证券投资基金、东兴中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、东兴低碳经济混合型发起式证券投资基金、东兴中证全指指数量化增强型证券投资基金共30只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
李兵伟 先生	本基 金基 金经 理	2024- 09-26	-	15年	毕业于中央财经大学金融学专业，硕士研究生学历。2010年7月至2015年9月，先后任职于信达证券股份有限公司研究开发中心、资产管理部；2015年9月至2021年5月，任职于东兴证券股份有限公司基金业务部；2021

					年5月至2025年1月，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理；2025年1月至今，任职东兴基金管理有限公司量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，"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。

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

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》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统中的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由分管投资的公司领导决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的同向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量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

2026年上半年，主要宽基指数均录得正收益。但结构表现极度分化，周期板块和硬科技先后驱动市场行情，而美伊冲突是指数层面走势的重要扰动。整个上半年来看，资金不断缩圈聚焦于AI上游硬科技产业链，挖掘细分领域投资机会，而内需整体承压。从基本面上看，AI资本开支带动了硬科技板块的高增长，无论是从上市公司财报还是高频数据均可以得到印证。而消费在多重深层次因素叠加下，基本面承压，社零单月转负。周期板块在海外加息预期下，二季度也出现明显调整。但市场在对新老经济体基本面分化定价的过程中，我们认为还是出现了一些非理性的判断，一些基本面优质的上市公司估值已经明显低于其内在价值。这种极端分化的市场环境，确实给我们的量化策略带来一定的考验。但我们的策略经历过反复的迭代优化，在市场波动中经受住了考验。

东兴宸泰的投资策略依旧侧重于组合的构建而非择时，围绕经济转型方向，重点布局代表新质生产力的板块，底层的选股逻辑为主要基于基本面多因子模型，采用分散化投资理念，重点关注兼具估值和成长性的公司。通过模型筛选，重点选择成长性好，盈利能力强的公司，结合估值预期形成投资组合，2026年上半年量化选股模型有效地抓住了结构性机会。同时，组合构建过程中的风险控制模块发挥了极大的作用，将我们的回撤控制在一个较低的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2026年1月1日起至2026年6月30日，本基金A类份额净值增长率为11.54%，业绩比较基准收益率为8.83%，高于业绩比较基准2.71%；本基金C类份额净值增长率为11.21%，业绩比较基准收益率为8.83%，高于业绩比较基准2.38%。

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，新旧经济动能的此消彼长仍将是宏观层面的核心叙事主线。出口端，AI产业链的景气外溢将继续支撑高增，成为增长的主要压舱石；消费端，虽受制于居民预期偏弱，修复动能有限，但在基数走低与政策边际加力的共同作用下，预计将呈现弱复苏态势，其中服务消费的相对优势仍将延续。投资结构上，以“六张网”为代表的新型基建将持续发力，而传统地产基建链条则难有明显起色。尽管“新强旧弱”的格局是下半年基准情景，但我们判断，随着财政资金拨付节奏加快、地缘不确定性逐步消化，新旧经济之间的分化幅度有望边际收窄。

映射到二级市场，上半年指数上行更多由流动性宽松与估值抬升驱动，而进入下半年，市场定价逻辑将向内生增长回归。我们认为指数整体有望维持温和震荡上行的趋势，但上行斜率将取决于两个变量：AI产业基本面的实际兑现程度，以及内需修复的真实强度。当前，AI板块在经历估值快速扩张后，后续行情将高度依赖业绩落地的验证；而传统消费、制造等板块估值已处于历史偏低水位，随着下半年需求端企稳，部分被市场过度悲观定价的优质个股有望迎来估值修复窗口。总体来看，下半年阿尔法收益将优于贝塔收益，个股基本面将成为决定超额收益的关键标尺。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内无基金持有人数或资产净值预警情形。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、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：东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金

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	4,530,303.90	1,231,629.37
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	189,445,757.15	67,708,306.27
其中：股票投资		178,471,789.97	64,078,853.32
基金投资		-	-
债券投资		10,973,967.18	3,629,452.95

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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		78,395.60	35,422.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		194,054,456.65	68,975,357.97
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		158.10	36.00
应付赎回款		3,758,422.82	627,438.14
应付管理人报酬		201,439.30	63,541.93
应付托管费		25,179.91	7,942.75
应付销售服务费		31,792.05	17,847.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		300.41	15.77
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	61,837.25	99,501.60
负债合计		4,079,129.84	816,323.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	115,423,966.62	46,246,627.74

未分配利润	6.4.7.8	74,551,360.19	21,912,406.93
净资产合计		189,975,326.81	68,159,034.67
负债和净资产总计		194,054,456.65	68,975,357.97

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额115,423,966.62份；东兴宸泰量化选股混合发起A基金份额净值1.6514元，基金份额总额78,249,096.35份,东兴宸泰量化选股混合发起C基金份额净值1.6342元，基金份额总额37,174,870.27份。

6.2 利润表

会计主体：东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金

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2025年06月30 日
一、营业总收入		-2,819,463.34	5,968,689.46
1.利息收入		1,869.03	716.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,869.03	716.46
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）		4,218,362.04	3,168,322.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,671,849.15	2,858,550.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	32,126.79	12,130.47
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,514,386.10	297,641.18
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”	6.4.7.16	-7,351,449.25	2,752,521.99

号填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	311,754.84	47,128.91
减：二、营业总支出		942,910.85	265,312.79
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	637,093.62	186,176.35
2.托管费	6.4.10.2.2	79,636.74	23,272.06
3.销售服务费	6.4.10.2.3	161,760.07	28,170.95
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		69.54	-
8.其他费用	6.4.7.19	64,350.88	27,693.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-3,762,374.19	5,703,376.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-3,762,374.19	5,703,376.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,762,374.19	5,703,376.67

6.3 净资产变动表

会计主体：东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金

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	46,246,627.74	21,912,406.93	68,159,034.67
二、本期期初净资产	46,246,627.74	21,912,406.93	68,159,034.67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	69,177,338.88	52,638,953.26	121,816,292.14

（一）、综合收益总额	-	-3,762,374.19	-3,762,374.19
（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）	69,177,338.88	56,401,327.45	125,578,666.33
其中：1.基金申购款	142,864,223.58	100,301,618.32	243,165,841.90
2.基金赎回款	-73,686,884.70	-43,900,290.87	-117,587,175.57
（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	115,423,966.62	74,551,360.19	189,975,326.81
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	42,890,751.85	562,220.53	43,452,972.38
二、本期期初净资产	42,890,751.85	562,220.53	43,452,972.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,487,970.78	3,807,546.94	-17,680,423.84
（一）、综合收益总额	-	5,703,376.67	5,703,376.67
（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）	-21,487,970.78	-1,895,829.73	-23,383,800.51
其中：1.基金申购款	10,343,390.20	1,033,842.39	11,377,232.59
2.基金赎回款	-31,831,360.98	-2,929,672.12	-34,761,033.10
（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	21,402,781.07	4,369,767.47	25,772,548.54

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：

王洪亮

黄言

王广辉

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

东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2024年6月20日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2024]961号）的批复，自2024年9月11日至2024年9月24日公开募集设立。本基金为混合型发起式证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集184,785,237.75元人民币，业经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）“毕马威华振验字第2400513号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》于2024年9月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为184,798,626.70份，其中认购资金利息折合13,388.95份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易的可转换债券）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款等)、同业存单、货币市场工具、国债期货、股票期权、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。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：本基金股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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、存出保证金和应收申购款等；股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

6.4.2 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《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2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要求,真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、2026年1月1日至2026年6月30日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、会计估计与上一年年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2026年1月1日至2026年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、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摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式,在此情形下,所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类,否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,分类为以摊余成本计量的金融资产:

-本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标;

-该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

1、金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

2、金融工具的后续计量

初始确认后，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以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

3、金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

4、金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

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。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量。估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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

损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入；买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本 and 对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

① 持有期间的利息收入：分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益；

② 交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本 and 对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

（3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

- (1) 根据基金合同，基金管理费按前一日基金资产净值的1.20%的年费率逐日计提；
- (2) 根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率逐日计提；
- (3) 根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%的年费率计提；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货、期权交易和结算费用；基金的银行汇划费用；基金的证券、期货账户开户费用、账户维护费用；按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用；根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

- 1、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，具体分配方案详见届时基金管理人发布的公告，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；
- 2、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同一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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的该类基金份额净值转成相应类别的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；
- 3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；
- 4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；
- 5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；
- 6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。法律法规或中国证监会另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在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

本基金在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

本基金在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[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[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号文《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[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、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 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。
- 3、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。
- 4、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。

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	213,972.78
等于：本金	213,905.40
加：应计利息	67.38
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	4,316,331.12
等于：本金	4,316,245.94
加：应计利息	85.18
减：坏账准备	-
合计	4,530,303.90

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金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		185,828,462.22	-	178,471,789.97	-7,356,672.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,900,097.01	70,677.18	10,973,967.18	3,192.99
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,900,097.01	70,677.18	10,973,967.18	3,192.99
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		196,728,559.23	70,677.18	189,445,757.15	-7,353,479.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	3,870.35
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	57,966.90
合计	61,837.25

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东兴宸泰量化选股混合发起A

金额单位：人民币元

项目 (东兴宸泰量化选股混合发起 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	18,166,040.23	18,166,040.23
本期申购	85,908,523.03	85,908,523.03
本期赎回（以“-”号填列）	-25,825,466.91	-25,825,466.91
本期末	78,249,096.35	78,249,096.35

6.4.7.7.2 东兴宸泰量化选股混合发起C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(东兴宸泰量化选股混合发起C)	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	28,080,587.51	28,080,587.51
本期申购	56,955,700.55	56,955,700.55
本期赎回（以“-”号填列）	-47,861,417.79	-47,861,417.79
本期末	37,174,870.27	37,174,870.27

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东兴宸泰量化选股混合发起A

单位：人民币元

项目 (东兴宸泰量化选股混合发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,187,213.45	-457,867.98	8,729,345.47
本期期初	9,187,213.45	-457,867.98	8,729,345.47
本期利润	20,030.91	-4,533,679.02	-4,513,648.11
本期基金份额交易产生的变动数	38,656,642.26	8,102,938.52	46,759,580.78
其中：基金申购款	54,681,132.31	8,515,422.52	63,196,554.83
基金赎回款	-16,024,490.05	-412,484.00	-16,436,974.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	47,863,886.62	3,111,391.52	50,975,278.14

6.4.7.8.2 东兴宸泰量化选股混合发起C

单位：人民币元

项目 (东兴宸泰量化选股混合发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,890,416.70	-707,355.24	13,183,061.46
本期期初	13,890,416.70	-707,355.24	13,183,061.46
本期利润	3,569,044.15	-2,817,770.23	751,273.92
本期基金份额交易产	4,656,518.27	4,985,228.40	9,641,746.67

生的变动数			
其中：基金申购款	34,234,161.26	2,870,902.23	37,105,063.49
基金赎回款	-29,577,642.99	2,114,326.17	-27,463,316.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,115,979.12	1,460,102.93	23,576,082.05

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	1,232.72
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	602.98
结算备付金利息收入	-
其他	33.33
合计	1,869.03

注：1、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金的利息收入。

2、其他为申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	395,685,004.43
减：卖出股票成本总额	392,360,401.73
减：交易费用	652,753.55
买卖股票差价收入	2,671,849.15

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	36,105.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,979.09
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	32,126.79

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,035,440.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,000,991.12
减：应计利息总额	35,718.93
减：交易费用	2,709.97
买卖债券差价收入	-3,979.09

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 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	1,514,386.10
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	1,514,386.10

6.4.7.16 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	-7,351,449.25
——股票投资	-7,354,660.37
——债券投资	3,211.12
——资产支持证券投资	-
——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	-7,351,449.25

6.4.7.17 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	309,105.52
转换费收入	2,649.32
合计	311,754.84

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 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	7,439.10
信息披露费	46,027.80
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,883.98
账户维护费	9,000.00
合计	64,350.88

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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期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
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 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 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年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	637,093.62	186,176.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	240,709.04	60,411.84
应支付基金管理人的净管理费	396,384.58	125,764.51

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行

资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年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	79,636.74	23,272.06

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。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

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年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		
	东兴宸泰量化选股 混合发起A	东兴宸泰量化选 股混合发起C	合计
	东兴证券股份有限公司	0.00	149.76
中国银行股份有限公司	0.00	983.34	983.34
东兴基金管理有限公司	0.00	1,139.31	1,139.31
合计	0.00	2,272.41	2,272.41
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		

	东兴宸泰量化选股 混合发起A	东兴宸泰量化选 股混合发起C	合计
东兴证券股份有限公司	0.00	13.23	13.23
中国银行股份有限公司	0.00	316.74	316.74
合计	0.00	329.97	329.97

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.60%的年费率计提。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间，未与关联方进行银行间同业市场的债券(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，未发生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。

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，未发生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。

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

东兴宸泰量化选股混合发起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	10,000,000.00	10,000,000.00
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	10,000,000.00	10,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	12.78%	70.40%

东兴宸泰量化选股混合发起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	600,384.25	-
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	600,384.25	-
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	1.62%	-

注：基金管理人运用固有资金投资本基金的交易费用按招募说明书中规定的费率收取。

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

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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

中国银行股份有限公司	213,972.78	1,232.72	907,313.84	419.68
------------	------------	----------	------------	--------

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

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

根据本基金基金合同的相关规定，结合本基金实际运作情况，本基金本报告期末进行利润分配。

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/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026-06-29	筹划发行股份购买资产暨关联交易事项	9.05	2026-07-13	9.96	800	6,768.99	7,240.00	-
603137	恒尚节能	2026-06-16	筹划发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金事项	12.94	2026-07-01	14.23	200	2,116.02	2,588.00	-

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

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗力拒抗的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由风险控制与审计委员会、投资决策委员会、风险管理部门组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,468,457.59	3,022,627.06
合计	10,468,457.59	3,022,627.06

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	505,509.59	606,825.89
合计	505,509.59	606,825.89

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券

不得超过该证券的10%。本基金所持证券除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告所称流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照“组合管理、分散投资”的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

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。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,530,151.34	-	-	-	-	152.56	4,530,303.90
交易性金融资产	800,160.00	500,350.00	9,602,780.00	-	-	178,542,467.15	189,445,757.15
应收申购款	-	-	-	-	-	78,395.60	78,395.60
资产总计	5,330,311.34	500,350.00	9,602,780.00	-	-	178,621,015.31	194,054,456.65
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,758,422.82	3,758,422.82
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	201,439.30	201,439.30
应付托管费	-	-	-	-	-	25,179.91	25,179.91
应付销售服务费	-	-	-	-	-	31,792.05	31,792.05
应交税费	-	-	-	-	-	300.41	300.41
其他负债	-	-	-	-	-	61,837.25	61,837.25
应付清算款	-	-	-	-	-	158.10	158.10
负债总计	-	-	-	-	-	4,079,129.84	4,079,129.84
利率敏感度缺口	5,330,311.34	500,350.00	9,602,780.00	-	-	174,541,885.47	189,975,326.81
上年度末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,231,503.94	-	-	-	-	125.43	1,231,629.37
交易性金融资产	100,000.00	200,280.00	3,301,010.00	-	-	64,107,016.27	67,708,306.27
应收申购款	-	-	-	-	-	35,422.33	35,422.33
资产总计	1,331,503.94	200,280.00	3,301,010.00	-	-	64,142,564.03	68,975,357.97
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	627,438.14	627,438.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	63,541.93	63,541.93
应付托管费	-	-	-	-	-	7,942.75	7,942.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,847.11	17,847.11
应交税费	-	-	-	-	-	15.77	15.77
其他负债	-	-	-	-	-	99,501.60	99,501.60
应付清算款	-	-	-	-	-	36.00	36.00
负债总计	-	-	-	-	-	816,323.30	816,323.30
利率敏感度缺口	1,331,503.94	200,280.00	3,301,010.00	-	-	63,326,240.73	68,159,034.67

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，市场利率上升或下降25个基点，对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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	178,471,789.97	93.94	64,078,853.32	94.01
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,973,967.18	5.78	3,629,452.95	5.33
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	189,445,757.15	99.72	67,708,306.27	99.34

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；	
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	上年度末
		2026年06月30日	2025年12月31日
	业绩比较基准变动+5%	11,501,319.40	3,890,941.50
	业绩比较基准变动-5%	-11,501,319.40	-3,890,941.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	178,461,961.97	64,078,853.32
第二层次	10,983,795.18	3,629,452.95
第三层次	-	-
合计	189,445,757.15	67,708,306.27

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

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、应收申购款、应付赎回款和其他应付款项，其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	178,471,789.97	91.97
	其中：股票	178,471,789.97	91.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,973,967.18	5.66
	其中：债券	10,973,967.18	5.66
	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	4,530,303.90	2.33
8	其他各项资产	78,395.60	0.04
9	合计	194,054,456.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,253,939.00	2.77
C	制造业	123,046,570.83	64.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	858,622.00	0.45
E	建筑业	290,902.00	0.15

F	批发和零售业	12,392,867.23	6.52
G	交通运输、仓储和邮政业	122,169.00	0.06
H	住宿和餐饮业	103,740.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,716,444.15	7.75
J	金融业	5,337,681.34	2.81
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	102,747.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	8,820,648.72	4.64
N	水利、环境和公共设施管理业	4,405,959.70	2.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,686,040.00	0.89
Q	卫生和社会工作	307,090.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	1,026,369.00	0.54
S	综合	-	-
	合计	178,471,789.97	93.94

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300738	奥飞数据	400,300	8,094,066.00	4.26
2	600051	宁波联合	1,398,300	7,872,429.00	4.14
3	603061	金海通	14,300	7,181,746.00	3.78
4	688390	固德威	55,766	6,051,168.66	3.19
5	688681	科汇股份	380,451	5,318,704.98	2.80
6	300236	上海新阳	40,300	5,299,450.00	2.79
7	688372	伟测科技	26,092	4,853,112.00	2.55
8	301130	西点药业	194,700	4,668,906.00	2.46
9	002616	长青集团	982,500	4,391,775.00	2.31
10	300371	汇中股份	448,620	4,387,503.60	2.31
11	600259	中稀有色	42,300	4,298,103.00	2.26

12	688667	菱电电控	27,519	3,677,914.35	1.94
13	688717	艾罗能源	43,654	3,604,510.78	1.90
14	688616	西力科技	355,459	3,590,135.90	1.89
15	688239	航宇科技	59,647	3,568,680.01	1.88
16	688293	奥浦迈	83,396	3,476,779.24	1.83
17	688486	龙迅股份	52,988	3,368,977.04	1.77
18	603998	方盛制药	365,700	3,302,271.00	1.74
19	688198	佰仁医疗	36,516	3,258,687.84	1.72
20	300855	图南股份	100,500	3,141,630.00	1.65
21	002961	瑞达期货	158,600	3,105,388.00	1.63
22	603071	物产环能	260,700	2,883,342.00	1.52
23	688700	东威科技	31,812	2,843,992.80	1.50
24	688255	凯尔达	96,052	2,670,245.60	1.41
25	688533	上声电子	127,602	2,661,777.72	1.40
26	688678	福立旺	103,424	2,499,758.08	1.32
27	688392	骄成超声	10,914	2,479,442.52	1.31
28	688410	山外山	168,008	2,412,594.88	1.27
29	688356	键凯科技	30,577	2,356,875.16	1.24
30	688025	杰普特	4,884	2,295,480.00	1.21
31	603041	美思德	212,200	2,200,514.00	1.16
32	002566	益盛药业	341,300	2,061,452.00	1.09
33	300602	飞荣达	40,200	2,058,240.00	1.08
34	001283	豪鹏科技	40,630	1,991,682.60	1.05
35	300693	盛弘股份	39,100	1,906,125.00	1.00
36	301608	博实结	36,000	1,809,360.00	0.95
37	600455	博通股份	76,300	1,675,548.00	0.88
38	688113	联测科技	45,926	1,612,002.60	0.85
39	301606	绿联科技	25,200	1,537,704.00	0.81
40	688236	春立医疗	99,906	1,444,640.76	0.76
41	000686	东北证券	167,400	1,406,160.00	0.74
42	002043	兔宝宝	122,700	1,359,516.00	0.72

43	300987	川网传媒	105,900	1,302,570.00	0.69
44	300363	博腾股份	70,800	1,149,792.00	0.61
45	601686	友发集团	228,859	1,105,388.97	0.58
46	300424	航新科技	70,100	1,103,374.00	0.58
47	688155	先惠技术	13,460	1,088,779.40	0.57
48	301160	翔楼新材	23,170	1,080,880.50	0.57
49	603926	铁流股份	58,700	1,038,403.00	0.55
50	301086	鸿富瀚	4,900	1,025,472.00	0.54
51	605577	龙版传媒	115,200	1,014,912.00	0.53
52	301393	昊帆生物	14,900	965,073.00	0.51
53	603309	维力医疗	84,700	950,334.00	0.50
54	688328	深科达	9,203	880,727.10	0.46
55	603198	迎驾贡酒	29,200	864,320.00	0.45
56	002479	富春环保	198,400	835,264.00	0.44
57	688269	凯立新材	26,030	825,411.30	0.43
58	688059	华锐精密	3,754	749,711.34	0.39
59	688203	海正生材	72,808	726,623.84	0.38
60	002833	弘亚数控	37,400	721,446.00	0.38
61	003017	大洋生物	29,060	668,380.00	0.35
62	300592	华凯易佰	37,400	661,980.00	0.35
63	301391	卡莱特	11,000	628,100.00	0.33
64	002576	通达动力	43,300	612,695.00	0.32
65	301345	涛涛车业	2,300	531,300.00	0.28
66	603323	苏农银行	135,992	526,289.04	0.28
67	688045	必易微	6,478	523,292.84	0.28
68	688636	智明达	14,397	521,603.31	0.27
69	600037	歌华有线	82,600	517,902.00	0.27
70	605266	健之佳	31,200	456,768.00	0.24
71	600419	天润乳业	57,900	438,303.00	0.23
72	301080	百普赛斯	8,840	424,320.00	0.22
73	603489	八方股份	15,100	422,196.00	0.22

74	600395	盘江股份	89,900	409,944.00	0.22
75	600833	第一医药	44,900	404,998.00	0.21
76	002541	鸿路钢构	19,100	330,812.00	0.17
77	301103	何氏眼科	20,500	307,090.00	0.16
78	600573	惠泉啤酒	34,400	306,160.00	0.16
79	603909	建发合诚	33,800	288,314.00	0.15
80	688309	恒誉环保	4,422	269,211.36	0.14
81	002494	华斯股份	57,900	257,076.00	0.14
82	688067	爱威科技	12,618	254,252.70	0.13
83	600150	中国船舶	6,968	235,448.72	0.12
84	603659	璞泰来	8,100	234,333.00	0.12
85	603036	如通股份	16,200	234,252.00	0.12
86	301033	迈普医学	4,400	227,876.00	0.12
87	300990	同飞股份	2,100	220,647.00	0.12
88	002284	亚太股份	21,500	204,035.00	0.11
89	002128	电投能源	8,200	189,584.00	0.10
90	605117	德业股份	1,756	186,452.08	0.10
91	300976	达瑞电子	2,280	181,602.00	0.10
92	300743	天地数码	12,200	177,998.00	0.09
93	601233	桐昆股份	8,100	175,365.00	0.09
94	688002	睿创微纳	1,110	171,705.90	0.09
95	688411	海博思创	567	165,110.40	0.09
96	301163	宏德股份	7,400	164,132.00	0.09
97	002988	豪美新材	7,300	161,038.00	0.08
98	301031	中熔电气	1,344	160,540.80	0.08
99	301161	唯万密封	4,000	154,440.00	0.08
100	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.08
101	300073	当升科技	3,200	153,728.00	0.08
102	000975	山金国际	9,000	153,000.00	0.08
103	600989	宝丰能源	7,400	150,442.00	0.08
104	601688	华泰证券	6,900	142,278.00	0.07

105	000807	云铝股份	6,200	137,268.00	0.07
106	600059	古越龙山	18,200	133,224.00	0.07
107	301110	青木科技	3,500	132,510.00	0.07
108	688536	思瑞浦	351	127,795.59	0.07
109	300922	天秦装备	8,407	127,366.05	0.07
110	301162	国能日新	2,880	126,000.00	0.07
111	002463	沪电股份	800	122,240.00	0.06
112	601899	紫金矿业	4,500	113,130.00	0.06
113	000933	神火股份	5,200	110,240.00	0.06
114	002487	大金重工	1,900	110,143.00	0.06
115	002080	中材科技	1,200	108,000.00	0.06
116	603256	宏和科技	400	106,132.00	0.06
117	000657	中钨高新	1,100	105,292.00	0.06
118	002985	北摩高科	3,800	105,260.00	0.06
119	002384	东山精密	400	104,940.00	0.06
120	301087	可孚医疗	2,200	104,830.00	0.06
121	600183	生益科技	600	104,040.00	0.05
122	301073	君亭酒店	5,700	103,740.00	0.05
123	301185	鸥玛软件	6,900	102,534.00	0.05
124	001218	丽臣实业	4,600	101,476.00	0.05
125	688200	华峰测控	188	98,718.80	0.05
126	688127	蓝特光学	1,000	97,600.00	0.05
127	601665	齐鲁银行	16,800	96,936.00	0.05
128	002357	富临运业	10,500	93,450.00	0.05
129	688778	厦钨新能	1,707	92,860.80	0.05
130	002353	杰瑞股份	600	91,500.00	0.05
131	002008	大族激光	600	90,066.00	0.05
132	688378	奥来德	1,431	88,722.00	0.05
133	001316	润贝航科	2,480	81,790.40	0.04
134	603986	兆易创新	100	81,500.00	0.04
135	002712	思美传媒	19,500	80,925.00	0.04

136	688600	皖仪科技	2,285	76,044.80	0.04
137	300694	蠡湖股份	7,800	74,880.00	0.04
138	000603	盛达资源	3,200	73,920.00	0.04
139	002206	海利得	14,200	73,414.00	0.04
140	002864	盘龙药业	2,800	72,240.00	0.04
141	301489	思泉新材	420	69,123.60	0.04
142	300645	正元智慧	5,800	68,266.00	0.04
143	300772	运达股份	5,200	63,960.00	0.03
144	688633	星球石墨	2,141	63,651.93	0.03
145	000935	四川双马	2,300	60,007.00	0.03
146	603187	海容冷链	5,000	57,450.00	0.03
147	688692	达梦数据	200	48,858.00	0.03
148	688258	卓易信息	411	48,719.94	0.03
149	688484	南芯科技	847	47,847.03	0.03
150	688550	瑞联新材	795	45,990.75	0.02
151	002838	道恩股份	1,500	45,930.00	0.02
152	300908	仲景食品	2,001	44,102.04	0.02
153	688345	博力威	719	41,759.52	0.02
154	688690	纳微科技	924	40,748.40	0.02
155	688049	炬芯科技	839	39,357.49	0.02
156	688358	祥生医疗	1,213	37,081.41	0.02
157	688123	聚辰股份	172	36,567.20	0.02
158	688401	路维光电	378	36,280.44	0.02
159	688386	泛亚微透	396	35,576.64	0.02
160	688362	甬矽电子	356	34,318.40	0.02
161	688095	福昕软件	559	33,221.37	0.02
162	301219	腾远钴业	600	32,880.00	0.02
163	603500	祥和实业	2,800	32,536.00	0.02
164	688073	毕得医药	598	32,184.36	0.02
165	688787	海天瑞声	236	31,730.20	0.02
166	300756	金马游乐	960	31,728.00	0.02

167	002671	龙泉股份	8,500	31,535.00	0.02
168	688279	峰岬科技	140	31,421.60	0.02
169	301319	唯特偶	187	31,290.71	0.02
170	688610	埃科光电	116	30,554.40	0.02
171	688668	鼎通科技	81	30,237.30	0.02
172	688357	建龙微纳	991	29,204.77	0.02
173	301106	骏成科技	1,400	29,036.00	0.02
174	688368	晶丰明源	131	28,364.12	0.01
175	688008	澜起科技	91	28,200.90	0.01
176	002293	罗莱生活	2,800	27,692.00	0.01
177	688233	神工股份	128	27,445.76	0.01
178	603676	卫信康	3,100	24,955.00	0.01
179	003010	若羽臣	1,000	24,300.00	0.01
180	688087	英科再生	707	23,627.94	0.01
181	688347	华虹宏力	70	23,541.00	0.01
182	300893	松原安全	1,400	22,680.00	0.01
183	301607	富特科技	420	21,945.00	0.01
184	603713	密尔克卫	300	21,351.00	0.01
185	603551	奥普科技	2,300	20,677.00	0.01
186	688377	迪威尔	876	20,656.08	0.01
187	688519	南亚新材	54	20,522.16	0.01
188	600262	北方股份	1,000	19,790.00	0.01
189	603013	亚普股份	1,200	18,948.00	0.01
190	688321	微芯生物	710	18,694.30	0.01
191	688669	聚石化学	170	18,190.00	0.01
192	603181	皇马科技	1,100	17,842.00	0.01
193	688503	聚和材料	132	17,516.40	0.01
194	688103	国力电子	230	17,114.30	0.01
195	600549	厦门钨业	200	17,040.00	0.01
196	688267	中触媒	853	16,804.10	0.01
197	001266	宏英智能	300	14,730.00	0.01

198	603297	永新光学	100	14,695.00	0.01
199	603311	金海高科	400	14,660.00	0.01
200	688591	泰凌微	425	14,611.50	0.01
201	300833	浩洋股份	483	14,576.94	0.01
202	603228	景旺电子	200	14,482.00	0.01
203	688686	奥普特	85	14,313.15	0.01
204	600057	厦门象屿	2,600	14,092.00	0.01
205	300535	达威股份	968	13,193.84	0.01
206	301218	华是科技	300	12,360.00	0.01
207	600522	中天科技	200	12,136.00	0.01
208	688332	中科蓝讯	77	12,127.50	0.01
209	688618	三旺通信	390	12,000.30	0.01
210	601609	金田股份	1,100	11,880.00	0.01
211	688131	皓元医药	120	11,352.00	0.01
212	002673	西部证券	1,700	11,033.00	0.01
213	603823	百合花	200	10,914.00	0.01
214	603236	移远通信	211	10,796.87	0.01
215	688685	迈信林	193	10,595.70	0.01
216	600999	招商证券	500	10,550.00	0.01
217	688663	新风光	118	10,438.28	0.01
218	603507	振江股份	300	9,867.00	0.01
219	603102	百合股份	300	9,471.00	0.00
220	688160	步科股份	87	9,462.99	0.00
221	002980	华盛昌	80	9,323.20	0.00
222	688046	药康生物	376	9,099.20	0.00
223	002023	海特高新	700	9,072.00	0.00
224	601137	博威合金	400	8,932.00	0.00
225	688261	东微半导	85	8,919.05	0.00
226	002687	乔治白	1,700	8,908.00	0.00
227	603556	海兴电力	400	8,800.00	0.00
228	603678	火炬电子	100	8,300.00	0.00

229	603856	东宏股份	600	8,298.00	0.00
230	688209	英集芯	283	8,229.64	0.00
231	688419	耐科装备	102	8,022.30	0.00
232	688513	苑东生物	178	7,824.88	0.00
233	000034	神州数码	280	7,770.00	0.00
234	688689	银河微电	120	7,766.40	0.00
235	603267	鸿远电子	100	7,748.00	0.00
236	601878	浙商证券	800	7,600.00	0.00
237	002156	通富微电	100	7,587.00	0.00
238	688035	德邦科技	82	7,527.60	0.00
239	688286	敏芯股份	65	7,479.55	0.00
240	300816	艾可蓝	100	7,320.00	0.00
241	688091	上海谊众	181	7,276.20	0.00
242	601798	蓝科高新	1,000	7,240.00	0.00
242	601369	陕鼓动力	800	7,240.00	0.00
243	688696	极米科技	111	7,163.94	0.00
244	603700	宁水集团	600	6,966.00	0.00
245	688099	晶晨股份	65	6,688.50	0.00
246	603810	丰山集团	600	6,678.00	0.00
247	600482	中国动力	200	6,560.00	0.00
248	300439	美康生物	800	6,424.00	0.00
249	688557	兰剑智能	205	6,361.15	0.00
250	002637	赞宇科技	600	6,318.00	0.00
251	601766	中国中车	1,200	6,240.00	0.00
252	688621	阳光诺和	112	6,149.92	0.00
253	600301	华锡有色	100	6,132.00	0.00
254	600969	郴电国际	800	6,104.00	0.00
255	688252	天德钰	246	5,904.00	0.00
256	603466	风语筑	600	5,874.00	0.00
257	300610	晨化股份	600	5,850.00	0.00
258	600023	浙能电力	1,100	5,786.00	0.00

259	600459	贵研铂业	200	5,776.00	0.00
260	000415	渤海租赁	1,400	5,698.00	0.00
261	688029	南微医学	77	5,528.60	0.00
262	603890	春秋电子	200	5,524.00	0.00
263	688408	中信博	171	5,497.65	0.00
264	688772	珠海冠宇	280	5,496.40	0.00
265	600323	瀚蓝环境	200	5,492.00	0.00
266	002605	姚记科技	300	5,481.00	0.00
267	600938	中国海油	200	5,430.00	0.00
268	605098	行动教育	100	5,416.00	0.00
269	300433	蓝思科技	100	5,366.00	0.00
270	688677	海泰新光	52	5,258.76	0.00
271	002734	利民股份	300	5,151.00	0.00
272	600163	中闽能源	1,000	5,150.00	0.00
273	000598	兴蓉环境	800	5,136.00	0.00
274	000823	超声电子	200	5,130.00	0.00
275	688162	巨一科技	216	5,106.24	0.00
276	000526	学大教育	200	5,076.00	0.00
277	002839	张家港行	1,300	5,070.00	0.00
278	688395	正弦电气	229	5,060.90	0.00
279	605319	无锡振华	220	4,991.80	0.00
280	688522	纳睿雷达	245	4,904.90	0.00
281	601377	兴业证券	800	4,832.00	0.00
282	688355	明志科技	251	4,831.75	0.00
283	601298	青岛港	600	4,830.00	0.00
284	603799	华友钴业	100	4,826.00	0.00
285	600998	九州通	1,000	4,690.00	0.00
286	688296	和达科技	407	4,656.08	0.00
287	601607	上海医药	300	4,620.00	0.00
288	301257	普蕊斯	100	4,538.00	0.00
289	000528	柳工	600	4,530.00	0.00

290	603170	宝立食品	400	4,520.00	0.00
291	688018	乐鑫科技	35	4,477.20	0.00
292	600757	长江传媒	600	4,386.00	0.00
293	600488	津药药业	900	4,347.00	0.00
294	688085	三友医疗	362	4,333.14	0.00
295	600362	江西铜业	100	4,330.00	0.00
296	688501	青达环保	225	4,320.00	0.00
297	688013	天臣医疗	175	4,317.25	0.00
298	300653	正海生物	300	4,308.00	0.00
299	603617	君禾股份	600	4,272.00	0.00
300	300994	久祺股份	400	4,268.00	0.00
301	688565	力源科技	443	4,186.35	0.00
302	002429	兆驰股份	400	4,156.00	0.00
303	605507	国邦医药	280	4,144.00	0.00
304	605020	永和股份	100	4,072.00	0.00
305	002948	青岛银行	800	4,064.00	0.00
306	688077	大地熊	153	4,052.97	0.00
307	603161	科华控股	300	3,981.00	0.00
308	688687	凯因科技	243	3,963.33	0.00
309	600299	安迪苏	500	3,925.00	0.00
310	300002	神州泰岳	500	3,905.00	0.00
311	603367	辰欣药业	300	3,849.00	0.00
312	301327	华宝新能	80	3,845.60	0.00
313	603628	清源股份	400	3,760.00	0.00
314	603596	伯特利	148	3,676.32	0.00
315	688391	钜泉科技	102	3,658.74	0.00
316	603337	杰克科技	100	3,623.00	0.00
317	688015	交控科技	235	3,614.30	0.00
318	605066	天正电气	525	3,564.75	0.00
319	688253	英诺特	59	3,556.52	0.00
320	603320	迪贝电气	200	3,490.00	0.00

321	000725	京东方A	400	3,472.00	0.00
322	688093	世华科技	94	3,468.60	0.00
323	688523	航天环宇	66	3,458.40	0.00
324	301353	普莱得	208	3,454.88	0.00
325	688219	会通股份	262	3,390.28	0.00
326	688129	东来技术	127	3,326.13	0.00
327	601089	福元医药	200	3,256.00	0.00
328	601231	环旭电子	100	3,240.00	0.00
329	603331	百达精工	300	3,198.00	0.00
330	301061	匠心家居	91	3,191.37	0.00
331	000419	通程控股	700	3,157.00	0.00
332	301300	远翔新材	100	3,137.00	0.00
333	301215	中汽股份	600	3,114.00	0.00
334	002056	横店东磁	100	3,048.00	0.00
335	300473	德尔股份	100	3,040.00	0.00
336	603919	金徽酒	200	3,010.00	0.00
337	600470	六国化工	500	2,900.00	0.00
338	600958	东方证券	300	2,832.00	0.00
339	600380	健康元	300	2,826.00	0.00
340	600316	洪都航空	100	2,794.00	0.00
341	605378	野马电池	200	2,772.00	0.00
342	688517	金冠电气	157	2,744.36	0.00
343	600066	宇通客车	100	2,681.00	0.00
344	603383	顶点软件	100	2,656.00	0.00
345	688336	三生国健	49	2,601.90	0.00
346	603137	恒尚节能	200	2,588.00	0.00
347	605016	百龙创园	100	2,585.00	0.00
348	603861	白云电器	200	2,582.00	0.00
349	605286	同力天启	100	2,549.00	0.00
350	002155	湖南黄金	100	2,387.00	0.00
351	688188	柏楚电子	22	2,347.40	0.00

352	002817	黄山胶囊	400	2,344.00	0.00
353	002688	金河生物	500	2,310.00	0.00
354	600547	山东黄金	100	2,309.00	0.00
355	688314	康拓医疗	68	2,303.84	0.00
356	600128	苏豪弘业	300	2,277.00	0.00
357	600595	中孚实业	400	2,248.00	0.00
358	601825	沪农商行	300	2,247.00	0.00
359	688163	赛伦生物	46	2,245.26	0.00
360	600967	内蒙一机	200	2,170.00	0.00
361	603790	雅运股份	100	2,134.00	0.00
362	688056	莱伯泰科	33	2,130.15	0.00
363	600415	小商品城	200	2,032.00	0.00
364	601211	国泰海通	110	2,002.00	0.00
365	600219	南山铝业	500	1,995.00	0.00
366	688819	天能股份	89	1,975.80	0.00
367	000951	中国重汽	100	1,951.00	0.00
368	002880	卫光生物	100	1,948.00	0.00
369	600697	欧亚集团	200	1,944.00	0.00
370	688708	佳驰科技	38	1,930.40	0.00
371	600517	国网英大	400	1,872.00	0.00
372	301004	嘉益股份	60	1,860.00	0.00
373	600862	中航高科	100	1,803.00	0.00
374	603939	益丰药房	100	1,798.00	0.00
375	603600	永艺股份	200	1,774.00	0.00
375	603048	浙江黎明	100	1,774.00	0.00
376	688181	八亿时空	28	1,752.80	0.00
377	601577	长沙银行	200	1,742.00	0.00
378	603192	汇得科技	100	1,694.00	0.00
379	605033	美邦股份	100	1,664.00	0.00
380	300634	彩讯股份	84	1,643.88	0.00
381	688800	瑞可达	17	1,631.49	0.00

382	000550	江铃汽车	100	1,622.00	0.00
383	600062	华润双鹤	100	1,604.00	0.00
384	600694	大商股份	121	1,600.83	0.00
385	688259	创耀科技	39	1,525.68	0.00
386	688283	坤恒顺维	46	1,523.06	0.00
387	000153	丰原药业	300	1,521.00	0.00
388	301330	熵基科技	60	1,503.60	0.00
389	603233	大参林	100	1,503.00	0.00
390	601579	会稽山	100	1,469.00	0.00
391	688543	国科军工	37	1,459.65	0.00
392	002468	申通快递	100	1,456.00	0.00
393	600926	杭州银行	100	1,445.00	0.00
394	002495	佳隆股份	700	1,435.00	0.00
395	603339	四方科技	100	1,429.00	0.00
396	603020	爱普股份	100	1,410.00	0.00
397	002340	格林美	200	1,322.00	0.00
398	688120	华海清科	4	1,288.72	0.00
399	605158	华达新材	200	1,280.00	0.00
400	002863	今飞凯达	300	1,272.00	0.00
401	000708	中信特钢	100	1,262.00	0.00
402	601881	中国银河	100	1,257.00	0.00
403	603326	我乐家居	200	1,232.00	0.00
404	600551	时代出版	180	1,197.00	0.00
405	600098	广州发展	200	1,182.00	0.00
406	600268	国电南自	100	1,162.00	0.00
407	000902	新洋丰	100	1,156.00	0.00
408	601058	赛轮轮胎	100	1,153.00	0.00
409	600901	江苏金租	200	1,150.00	0.00
410	003011	海象新材	60	1,090.20	0.00
411	002170	芭田股份	100	1,086.00	0.00
412	002492	恒基达鑫	200	1,082.00	0.00

413	000159	国际实业	200	1,076.00	0.00
414	002532	天山铝业	100	1,073.00	0.00
415	002736	国信证券	100	999.00	0.00
416	000783	长江证券	100	975.00	0.00
417	601128	常熟银行	165	960.30	0.00
418	605166	聚合顺	100	959.00	0.00
419	600479	千金药业	100	930.00	0.00
420	688597	煜邦电力	133	864.50	0.00
421	002410	广联达	100	816.00	0.00
422	300845	捷安高科	60	796.80	0.00
423	600420	国药现代	100	795.00	0.00
424	600572	康恩贝	200	784.00	0.00
425	603136	天目湖	90	754.20	0.00
426	603987	康德莱	100	690.00	0.00
427	688092	爱科科技	31	658.44	0.00
428	600386	北巴传媒	200	624.00	0.00
429	688136	科兴制药	30	621.30	0.00
430	600496	精工钢构	200	620.00	0.00
431	002159	三特索道	50	618.50	0.00
432	688798	艾为电子	8	586.56	0.00
433	688118	普元信息	29	583.48	0.00
434	688526	科前生物	43	520.30	0.00
435	300771	智莱科技	50	516.00	0.00
436	688032	禾迈股份	6	507.12	0.00
437	600713	南京医药	100	500.00	0.00
438	605001	威奥股份	90	490.50	0.00
439	600282	南钢股份	100	459.00	0.00
440	000999	华润三九	20	449.80	0.00
441	688288	鸿泉技术	23	408.71	0.00
442	600854	春兰股份	100	407.00	0.00
443	600050	中国联通	100	400.00	0.00

444	688606	奥泰生物	8	328.64	0.00
445	600664	哈药股份	100	299.00	0.00
446	600300	维维股份	100	282.00	0.00
447	688398	赛特新材	8	207.28	0.00
448	688089	嘉必优	16	169.76	0.00
449	688508	芯朋微	1	92.96	0.00
450	688109	品茗科技	1	75.70	0.00
451	002955	鸿合科技	2	71.50	0.00
452	688212	澳华内镜	2	58.80	0.00
453	688786	悦安新材	1	46.08	0.00
454	688208	道通科技	1	25.19	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688681	科汇股份	10,360,646.77	15.20
2	600051	宁波联合	9,913,948.00	14.55
3	300738	奥飞数据	9,182,072.00	13.47
4	300855	图南股份	8,987,980.00	13.19
5	002833	弘亚数控	8,610,984.00	12.63
6	603071	物产环能	8,105,781.00	11.89
7	688636	智明达	6,849,564.82	10.05
8	688390	固德威	6,793,642.99	9.97
9	002616	长青集团	6,443,851.00	9.45
10	688616	西力科技	6,099,672.78	8.95
11	300371	汇中股份	5,905,620.00	8.66
12	001283	豪鹏科技	5,696,794.00	8.36
13	603187	海容冷链	5,610,857.00	8.23
14	301130	西点药业	5,588,681.50	8.20

15	000686	东北证券	5,495,854.00	8.06
16	688372	伟测科技	5,416,502.19	7.95
17	605266	健之佳	5,312,051.00	7.79
18	600259	中稀有色	5,176,553.00	7.59
19	603061	金海通	5,020,654.00	7.37
20	688198	佰仁医疗	4,890,060.69	7.17
21	603556	海兴电力	4,853,573.00	7.12
22	688255	凯尔达	4,708,293.89	6.91
23	688717	艾罗能源	4,582,979.20	6.72
24	300363	博腾股份	4,556,578.00	6.69
25	301606	绿联科技	4,546,377.00	6.67
26	300236	上海新阳	4,509,659.00	6.62
27	002687	乔治白	4,420,534.00	6.49
28	688293	奥浦迈	4,410,692.49	6.47
29	688239	航宇科技	4,350,054.75	6.38
30	600037	歌华有线	4,331,711.00	6.36
31	688786	悦安新材	4,149,342.84	6.09
32	600573	惠泉啤酒	4,123,359.00	6.05
33	688356	键凯科技	4,100,389.11	6.02
34	688667	菱电电控	4,064,725.27	5.96
35	603998	方盛制药	3,826,541.00	5.61
36	002961	瑞达期货	3,788,665.00	5.56
37	688486	龙迅股份	3,747,344.18	5.50
38	301160	翔楼新材	3,732,693.00	5.48
39	688600	皖仪科技	3,727,834.01	5.47
40	603700	宁水集团	3,542,464.00	5.20
41	600455	博通股份	3,491,260.00	5.12
42	688113	联测科技	3,345,441.09	4.91
43	688410	山外山	3,313,569.10	4.86
44	688484	南芯科技	3,313,542.98	4.86
45	688550	瑞联新材	3,284,917.64	4.82

46	688025	杰普特	3,279,104.54	4.81
47	603323	苏农银行	3,206,480.00	4.70
48	688700	东威科技	3,131,426.32	4.59
49	688533	上声电子	3,016,954.08	4.43
50	688633	星球石墨	3,000,100.30	4.40
51	603236	移远通信	2,938,696.00	4.31
52	300693	盛弘股份	2,831,317.00	4.15
53	300772	运达股份	2,815,140.00	4.13
54	688095	福昕软件	2,813,393.52	4.13
55	688551	科威尔	2,797,623.58	4.10
56	300592	华凯易佰	2,754,697.00	4.04
57	688357	建龙微纳	2,753,287.90	4.04
58	301080	百普赛斯	2,743,496.00	4.03
59	300756	金马游乐	2,705,221.00	3.97
60	688045	必易微	2,700,708.85	3.96
61	688345	博力威	2,660,005.76	3.90
62	603198	迎驾贡酒	2,639,719.00	3.87
63	301103	何氏眼科	2,633,064.00	3.86
64	605577	龙版传媒	2,599,792.00	3.81
65	688279	峰岬科技	2,594,083.59	3.81
66	688358	祥生医疗	2,556,709.75	3.75
67	688401	路维光电	2,550,507.02	3.74
68	688123	聚辰股份	2,506,596.03	3.68
69	001218	丽臣实业	2,501,095.00	3.67
70	301086	鸿富瀚	2,497,117.00	3.66
71	688678	福立旺	2,452,838.93	3.60
72	300602	飞荣达	2,420,258.00	3.55
73	688155	先惠技术	2,376,281.80	3.49
74	603041	美思德	2,362,819.00	3.47
75	688269	凯立新材	2,339,325.84	3.43
76	000603	盛达资源	2,305,964.00	3.38

77	002566	益盛药业	2,294,912.00	3.37
78	301031	中熔电气	2,261,339.00	3.32
79	688557	兰剑智能	2,251,436.92	3.30
80	600057	厦门象屿	2,202,114.00	3.23
81	688536	思瑞浦	2,195,687.41	3.22
82	688029	南微医学	2,191,912.36	3.22
83	688219	会通股份	2,172,845.17	3.19
84	688392	骄成超声	2,167,315.23	3.18
85	002206	海利得	2,161,543.00	3.17
86	600262	北方股份	2,156,705.00	3.16
87	688686	奥普特	2,140,500.19	3.14
88	688049	炬芯科技	1,993,761.23	2.93
89	688309	恒誉环保	1,951,554.51	2.86
90	300987	川网传媒	1,951,412.00	2.86
91	603267	鸿远电子	1,950,810.00	2.86
92	688131	皓元医药	1,947,815.65	2.86
93	002293	罗莱生活	1,901,161.00	2.79
94	603351	威尔药业	1,895,845.00	2.78
95	300535	达威股份	1,888,341.00	2.77
96	688087	英科再生	1,875,427.19	2.75
97	603102	百合股份	1,859,913.00	2.73
98	301608	博实结	1,859,714.00	2.73
99	002043	兔宝宝	1,853,951.00	2.72
100	002284	亚太股份	1,826,307.00	2.68
101	603300	海南华铁	1,825,384.00	2.68
102	688677	海泰新光	1,807,913.65	2.65
103	688286	敏芯股份	1,743,374.46	2.56
104	000935	四川双马	1,737,443.00	2.55
105	688657	浩辰软件	1,734,222.76	2.54
106	688073	毕得医药	1,696,153.62	2.49
107	688162	巨一科技	1,691,881.44	2.48

108	688668	鼎通科技	1,686,776.76	2.47
109	688708	佳驰科技	1,652,111.98	2.42
110	300845	捷安高科	1,646,737.00	2.42
111	301163	宏德股份	1,600,117.00	2.35
112	002576	通达动力	1,596,343.00	2.34
113	300922	天秦装备	1,592,637.00	2.34
114	688236	春立医疗	1,592,389.20	2.34
115	300292	吴通控股	1,591,538.00	2.34
116	603214	爱婴室	1,581,991.00	2.32
117	688591	泰凌微	1,578,777.14	2.32
118	603901	永创智能	1,570,069.00	2.30
119	301607	富特科技	1,562,994.00	2.29
120	688215	瑞晟智能	1,539,284.56	2.26
121	603810	丰山集团	1,514,558.00	2.22
122	300893	松原安全	1,447,274.00	2.12
123	603073	彩蝶实业	1,446,278.00	2.12
124	002864	盘龙药业	1,426,520.00	2.09
125	605098	行动教育	1,425,620.00	2.09
126	688267	中触媒	1,379,409.03	2.02
127	300357	我武生物	1,365,140.00	2.00
128	601686	友发集团	1,363,206.59	2.00

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票。

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002833	弘亚数控	7,265,658.00	10.66

2	688636	智明达	5,731,483.94	8.41
3	603071	物产环能	5,420,715.00	7.95
4	603187	海容冷链	4,963,804.00	7.28
5	688786	悦安新材	4,564,584.76	6.70
6	603556	海兴电力	4,519,908.00	6.63
7	300855	图南股份	4,435,900.00	6.51
8	688681	科汇股份	4,412,712.57	6.47
9	000686	东北证券	4,289,655.00	6.29
10	002687	乔治白	4,229,197.00	6.20
11	605266	健之佳	4,047,539.00	5.94
12	688600	皖仪科技	4,041,091.41	5.93
13	688677	海泰新光	4,004,769.24	5.88
14	301031	中熔电气	3,969,047.00	5.82
15	688633	星球石墨	3,822,905.39	5.61
16	001283	豪鹏科技	3,639,273.00	5.34
17	688550	瑞联新材	3,492,753.52	5.12
18	300363	博腾股份	3,490,110.00	5.12
19	603700	宁水集团	3,397,010.00	4.98
20	301160	翔楼新材	3,310,658.95	4.86
21	600037	歌华有线	3,310,403.00	4.86
22	688484	南芯科技	3,290,130.16	4.83
23	688551	科威尔	3,286,054.09	4.82
24	600573	惠泉啤酒	3,215,069.00	4.72
25	603236	移远通信	3,211,152.00	4.71
26	688668	鼎通科技	3,203,676.59	4.70
27	301080	百普赛斯	3,002,841.00	4.41
28	688345	博力威	2,928,726.70	4.30
29	600262	北方股份	2,885,773.00	4.23
30	688401	路维光电	2,858,231.96	4.19
31	603073	彩蝶实业	2,793,518.00	4.10
32	688219	会通股份	2,731,827.89	4.01

33	688536	思瑞浦	2,689,115.83	3.95
34	688557	兰剑智能	2,666,348.68	3.91
35	300535	达威股份	2,647,686.24	3.88
36	688358	祥生医疗	2,643,671.01	3.88
37	688045	必易微	2,632,518.79	3.86
38	001218	丽臣实业	2,591,700.00	3.80
39	300772	运达股份	2,590,318.00	3.80
40	688357	建龙微纳	2,588,485.54	3.80
41	301606	绿联科技	2,587,923.00	3.80
42	603323	苏农银行	2,558,870.00	3.75
43	002206	海利得	2,558,389.00	3.75
44	300756	金马游乐	2,520,190.00	3.70
45	300592	华凯易佰	2,498,499.00	3.67
46	688049	炬芯科技	2,481,775.88	3.64
47	605577	龙版传媒	2,413,123.00	3.54
48	688279	峰岬科技	2,377,749.91	3.49
49	688095	福昕软件	2,333,574.38	3.42
50	688356	键凯科技	2,223,106.38	3.26
51	688029	南微医学	2,200,150.66	3.23
52	688103	国力电子	2,175,718.20	3.19
53	603300	海南华铁	2,157,028.00	3.16
54	688087	英科再生	2,142,699.88	3.14
55	688123	聚辰股份	2,137,860.03	3.14
56	301086	鸿富瀚	2,130,213.60	3.13
57	603267	鸿远电子	2,078,233.00	3.05
58	301103	何氏眼科	2,037,178.80	2.99
59	688131	皓元医药	2,027,661.19	2.97
60	600057	厦门象屿	2,007,660.00	2.95
61	688162	巨一科技	1,949,843.76	2.86
62	000603	盛达资源	1,926,781.00	2.83
63	688686	奥普特	1,887,559.19	2.77

64	300922	天秦装备	1,877,069.28	2.75
65	002155	湖南黄金	1,841,581.00	2.70
66	002293	罗莱生活	1,834,999.00	2.69
67	688708	佳驰科技	1,831,014.03	2.69
68	300845	捷安高科	1,815,362.00	2.66
69	603351	威尔药业	1,805,636.00	2.65
70	688198	佰仁医疗	1,775,211.94	2.60
71	688269	凯立新材	1,768,051.36	2.59
72	688200	华峰测控	1,758,895.07	2.58
73	301163	宏德股份	1,747,055.00	2.56
74	688046	药康生物	1,733,267.40	2.54
75	000935	四川双马	1,721,707.00	2.53
76	688612	威迈斯	1,670,357.23	2.45
77	300532	今天国际	1,666,892.00	2.45
78	300292	吴通控股	1,654,813.00	2.43
79	688163	赛伦生物	1,633,482.53	2.40
80	688080	映翰通	1,629,483.24	2.39
81	603102	百合股份	1,627,182.00	2.39
82	603320	迪贝电气	1,618,827.24	2.38
83	688255	凯尔达	1,577,966.82	2.32
84	688286	敏芯股份	1,553,402.64	2.28
85	688073	毕得医药	1,516,819.84	2.23
86	605098	行动教育	1,512,666.00	2.22
87	603297	永新光学	1,510,278.00	2.22
88	603214	爱婴室	1,507,932.00	2.21
89	688657	浩辰软件	1,507,900.73	2.21
90	600507	方大特钢	1,499,753.00	2.20
91	301607	富特科技	1,499,323.00	2.20
92	688690	纳微科技	1,492,106.05	2.19
93	688025	杰普特	1,473,980.73	2.16
94	688293	奥浦迈	1,458,873.78	2.14

95	688309	恒誉环保	1,455,100.78	2.13
96	300257	开山股份	1,454,282.00	2.13
97	603901	永创智能	1,444,634.00	2.12
98	688056	莱伯泰科	1,424,370.76	2.09
99	603856	东宏股份	1,421,531.00	2.09
100	688155	先惠技术	1,400,395.37	2.05
101	002609	捷顺科技	1,385,566.00	2.03
102	688113	联测科技	1,377,582.22	2.02
103	688267	中触媒	1,370,466.76	2.01

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	514,107,998.75
卖出股票收入（成交）总额	395,685,004.43

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票。

2、"买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	10,973,967.18	5.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,973,967.18	5.78

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019835	26国债09	42,000	4,206,912.16	2.21
2	019792	25国债19	21,000	2,122,033.89	1.12
3	102317	国债2519	20,000	2,020,984.66	1.06
4	102326	国债2601	9,000	905,833.73	0.48
5	019755	24国债19	5,000	505,509.59	0.27

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

7.12.2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

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	78,395.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,395.60

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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	持有份额	占总份

	(户)			额比例		额比例
东兴宸泰量化选股混合发起A	1,353	57,833.77	10,226,765.10	13.07%	68,022,331.25	86.93%
东兴宸泰量化选股混合发起C	777	47,844.11	9,133,172.82	24.57%	28,041,697.45	75.43%
合计	2,130	54,189.66	19,359,937.92	16.77%	96,064,028.70	83.23%

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	47.89%

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	东兴宸泰量化选股混合发起A	17,176.41	0.02%
	东兴宸泰量化选股混合发起C	-	-
	合计	17,176.41	0.01%

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	东兴宸泰量化选股混合发起A	0~10
	东兴宸泰量化选股混合发起C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	东兴宸泰量化选股混合发起A	0
	东兴宸泰量化选股混合发起C	0
	合计	0

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	10,600,384.25	9.18%	10,000,000.00	8.66%	不低于三年
基金管理人高级管理人员	16,299.61	0.01%	0.00	0.00%	-

基金经理等人员	0.00	0.00%	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	10,616,683.86	9.20%	10,000,000.00	8.66%	—

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴宸泰量化选股混合 发起A	东兴宸泰量化选股混合 发起C
基金合同生效日(2024年09月26日)基金份额总额	65,136,974.04	119,661,652.66
本报告期期初基金份额总额	18,166,040.23	28,080,587.51
本报告期基金总申购份额	85,908,523.03	56,955,700.55
减：本报告期基金总赎回份额	25,825,466.91	47,861,417.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	78,249,096.35	37,174,870.27

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人高级管理人员、相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
金融街证券股份有限公司	2	559,853,147.67	61.54%	278,238.59	61.75%	-
联储证券股份有限公司	2	349,939,855.51	38.46%	172,314.40	38.25%	-

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务实力较强的证券公司参与证券交易。其中财务状况良好、经营行为规范指最近一年证券公司分类评级在C类或C类以上；合规风控能力是指证券公司近三年无重大违法违规行为、无正在接受立案调查，或受到监管机构严重处罚，责令改正逾期未改，影响正常经营等情形；交易、研究实力较强以公司交易部门、投资部门、研究部及投研分管领导的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定。在满足证券公司选择标准的前提下，公司应当与提供证券交易服务的证券公司签订委托协议，

约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。证券公司的选择由研究部发起，由合规法律部对选择标准、选择程序是否符合法规及本制度规定进行初步合规审查后，报督察长进行合规性审查和总经理审批，公司与其建立合作关系并签署委托协议。

3、本基金本报告期内未新增租用交易单元。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
金融街证券股份有限公司	9,298,537.00	68.88%	-	-	-	-	-	-
联储证券股份有限公司	4,200,965.00	31.12%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金2025年第4季度报告	指定网站	2026-01-22
2	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年第四季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-01-22
3	东兴基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-03-11
4	东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金基金产品资料概要更新	指定网站	2026-03-31
5	东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026年1号）	指定网站	2026-03-31
6	东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金2025年年度报告	指定网站	2026-03-31
7	东兴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）	指定网站	2026-03-31
8	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年年度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-03-31
9	东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	指定网站	2026-04-22

10	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2026年第一季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-04-22
11	2025年度东兴基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	指定网站	2026-04-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2026年1月1日- 2026年1月25日， 2026年3月24日- 2026年5月20日	10,000,000.00	600,384.25	-	10,600,384.25	9.18%
	2	2026年3月3日- 2026年3月3日， 2026年3月9日- 2026年3月16日， 2026年5月14日- 2026年5月20日	-	17,135,722.31	9,000,000.00	8,135,722.31	7.05%
	3	2026年3月9日- 2026年3月9日， 2026年3月17日- 2026年3月23日	6,771,397.62	6,279,040.56	13,050,438.18	-	0.00%
产品特有风险							
1、本基金为混合型基金，本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%，因此股票市场的变化将影响到基金业绩表现，基金净值表现因此可能受到影响。基金管理人将发挥专业研究优势，加强对市场、上市公司基本面和固定收益类产品的深入研究，持续优化组合配置，以控制特定风险。 2、本基金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，且不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续基金合同期限，法律法规或监管部门另有规定的，从其规定。因此，本基金存在基金合同提前终止的风险。 3、投资股指期货的风险 本基金可投资于股指期货，股指期货作为一种金融衍生品，其价值取决于一种或多种基础资产或指数，其评价主要源自于对挂钩资产的价格与价格波动的预期。投资股指期货所面临的风险主要是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险，具体为： （1）市场风险是指由于股指期货价格变动而给投资者带来的风险。市场风险是股指期货投资最主要的风险。 （2）流动性风险是指由于股指期货合约无法及时变现所带来的风险。 （3）基差风险是指股指期货合约价格和指数价格之间的价格差的波动所造成的风险，以及不同股指期货合约价格之间价格差的波动所造成的的期现价差风险。 （4）保证金风险是指由于无法及时筹措资金满足建立或者维持股指期货合约头寸所要求的保证金而带来的风险。 （5）信用风险是指期货经纪公司违约而产生的风险。 （6）操作风险是指由于内部流程的不完善，业务人员出现差错或者疏漏，或者系统出现故障等原因造成损失的风险。 此外，由于衍生品通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，并且其定价相当复杂，不适当的估值也有可能使基金资产面临损失风险。 4、投资国债期货的风险 本基金可以投资国债期货，可能面临市场风险、基差风险和流动性风险等风险。市场风险是因为期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。 5、投资股票期权的风险 股票期权价格主要受到标的资产价格水平、标的资产价格波动率、期权到期时间、市场利率							

水平等因素的影响。因此，投资股票期权主要存在Delta风险、Gamma风险、Vega风险、Theta风险以及Rho风险。同时，进行股票期权投资还面临流动性风险、信用风险、操作风险等。

6、投资资产支持证券的风险 本基金可投资于资产支持证券。资产支持证券是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券。资产支持证券存在信用风险、利率风险、提前偿付风险、操作风险和法律风险等。

7、投资存托凭证的风险 本基金可投资存托凭证，存托凭证是指由存托人签发、以境外证券为基础在中国境内发行、代表境外基础证券权益的证券。如本基金投资存托凭证，除与其他仅投资于沪深市场股票的基金所面临的共同风险外，本基金还将面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

8、流动性风险评估

(1) 投资市场、行业及资产的流动性风险评估 本基金的投资标的均在相关法律法规及中国证监会规定的合法范围之内，且具备良好的可投资性和流动性。本基金的投资范围的设定合理、明确，操作性较强。本基金投资组合中股票及存托凭证投资比例为基金资产的60%-95%。实际投资过程中，本基金在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，通过合理的资产配置，追求资产的长期增值，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。根据《流动性风险管理规定》的相关要求，本基金会审慎评估所投资资产的流动性，并针对性制定流动性风险管理措施，因此本基金流动性风险也可以得到有效控制。

(2) 巨额赎回情形下的流动性风险管理措施 若本基金单个开放日内的基金份额净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过前一开放日的基金总份额的10%，即认为是发生了巨额赎回。当基金出现巨额赎回时，基金管理人可以根据基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。

1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。

2) 部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。若进行上述延期办理，对于单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%以上的部分，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请量占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日某一类别的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

3) 暂停赎回：连续2个开放日以上(含本数)发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受基金的赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并应当在规定媒介上进行公告。当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真、公告或通过销售机构告知等其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并在2日内在规定媒介上刊登公告。

(3) 实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响 本基金运作过程中，将使用延期办理赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项、收取短期赎回费、暂停基金估值、摆动定价、实施侧袋机制及中国证监会认定的其他措施控制流动性风险，具体使用情形及程序详见基金合同第六部分基金份额的申购与赎回、第十四部分基金资产估值。

1) 延期办理赎回申请、暂停接受赎回申请、延缓支付赎回款项能够避免在巨额赎回时，因变现需求过大，市场交易量不足，导致证券不能低成本地转变为现金，进而对基金资产净值造成较大波动的情形，对基金份额持有人来说，存在不能及时赎回基金份额或延迟取得赎回款项的风险。

2) 收取短期赎回费能够控制资金短期频繁的申购赎回，避免净值大幅的波动，维护净值稳定。

3) 当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的, 采取暂停基金估值, 通过延缓支付赎回款项或暂停接受基金申购赎回申请等措施可避免基金份额净值虚高或虚低给申购、赎回客户或存量客户造成损失, 对基金份额持有人来说, 存在不能及时赎回基金份额或延迟取得赎回款项的风险。

4) 通过摆动定价将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者, 从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响, 确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待, 当日参与申购和赎回交易的投资者存在承担申购或者赎回产生的交易及其他成本的风险。5) 实施侧袋机制 投资人具体请参见招募说明书“侧袋机制”部分, 详细了解本基金实施侧袋机制的情形及程序。

9、实施侧袋机制对投资者的影响 侧袋机制是一种流动性风险管理工具, 是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算, 并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付, 目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后, 侧袋账户份额将停止披露基金份额净值, 并不得办理申购、赎回和转换, 仅主袋账户份额正常开放赎回, 因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额, 侧袋账户份额不能赎回, 其对应特定资产的变现时间具有不确定性, 最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值, 基金份额持有人可能因此面临损失。实施侧袋机制期间, 因本基金不披露侧袋账户份额的净值, 即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的, 也不作为特定资产最终变现价格的承诺, 因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格, 基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策, 因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。启用侧袋机制后, 基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产, 并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的基金净资产减少按投资损失处理, 因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无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、中国证监会核准东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

12.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅, 在支付工本费后, 可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件, 投资者还可在本基金管理人网站(www.dxamc.cn)查阅。

东兴基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日