

易方达新利灵活配置混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 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 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
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	13
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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
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	46
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	46
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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47

7.12 投资组合报告附注	47
§ 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	50
§ 9 开放式基金份额变动	51
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
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	52
10.8 其他重大事件	53
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
§ 12 备查文件目录	54
12.1 备查文件目录	54
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达新利灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	易方达新利混合
基金主代码	001249
交易代码	001249
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 4 月 30 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,062,636,844.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券等资产类别的配置比例。股票投资策略方面，本基金将通过分析行业景气度和行业竞争格局，对各行业的投资价值进行综合评估，从而确定并动态调整行业配置比例。在行业配置的基础上，本基金将重点投资于满足基金管理人以下分析标准的公司：公司经营稳健，盈利能力较强或具有较好的盈利预期；财务状况运行良好，资产负债结构相对合理，财务风险较小；公司治理结构合理、管理团队相对稳定、管理规范、具有清晰的长期愿景与企业文化、信息透明。本基金可选择投资价值高的存托凭证进行投资。债券投资策略方面，本基金将主要通过类属配置与券种选择两个层次进行投资管理。
业绩比较基准	中债-优选投资级信用债财富指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

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		易方达基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	张立学
	联系电话	020-85102688	010-68858126
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95580
传真		020-38798812	010-86353609
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道	北京市西城区金融大街3号

	188号6层	
办公地址	广东省广州市天河区珠江西路21号52层；广东省广州市天河区珠江东路30号42层；广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码	510627；510623；519031	100808
法定代表人	吴欣荣	郑国雨

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.efunds.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江西路 21 号 52 层；广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层；广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	19,009,373.44
本期利润	31,730,060.70
加权平均基金份额本期利润	0.0751
本期加权平均净值利润率	3.95%
本期基金份额净值增长率	4.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	985,387,073.23
期末可供分配基金份额利润	0.9273
期末基金资产净值	2,048,023,917.94
期末基金份额净值	1.9273
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	100.46%

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

2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.期末可供分配利润，为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

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	3.05%	0.19%	3.18%	0.26%	-0.13%	-0.07%
过去六个月	4.33%	0.21%	3.25%	0.23%	1.08%	-0.02%
过去一年	7.71%	0.19%	7.09%	0.20%	0.62%	-0.01%
过去三年	20.91%	0.19%	14.65%	0.14%	6.26%	0.05%
过去五年	27.76%	0.17%	22.37%	0.11%	5.39%	0.06%
过去七年	60.88%	0.19%	30.10%	0.09%	30.78%	0.10%
过去十年	95.57%	0.23%	41.68%	0.08%	53.89%	0.15%
自基金合同生效起至今	100.46%	0.22%	46.48%	0.07%	53.98%	0.15%

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

易方达新利灵活配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015 年 4 月 30 日至 2026 年 6 月 30 日)



注：自 2025 年 1 月 7 日起，本基金业绩比较基准由“一年期人民币定期存款利率(税后)+2%”调整为“中债-优选投资级信用债财富指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%”。基金业绩比较基准

收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§ 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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII 等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
杨康	本基金的基金经理，易方达鑫转增利混合、易方达裕富债券、易方达新鑫混合、易方达瑞景混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达瑞锦混合、易方达悦恒稳健债券的基金经理，易方达安盈回报混合（自 2019 年 06 月 10 日至 2026 年 06 月 28 日）、易方达安心回报债券（自 2019 年 06 月 19 日至 2026 年 06 月 28 日）、易方达宁易一年持有混合、易方达稳泰一年持有混合的基金经理助理，多资产公募投资部总经理助理	2022-08-06	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部研究员、投资经理助理，易方达基金管理有限公司投资经理，易方达鑫转招利混合、易方达瑞川混合发起式、易方达瑞锦混合发起式、易方达瑞安混合发起式、易方达瑞康混合、易方达新益混合、易方达新享混合、易方达瑞信混合、易方达瑞选混合、易方达瑞和混合、易方达瑞富混合、易方达瑞祺混合、易方达瑞祥混合、易方达丰惠混合、易方达裕鑫债券、易方达瑞通混合、易方达瑞弘混合、易方达鑫转添利混合、易方达瑞川混合的基金经理。
张璐涵	本基金的基金经理，易方达瑞富混合、易方达瑞祥混合、易方达磐泰一年持有混合、易方达悦和稳健债券、易方达悦丰稳健债券、易方达悦享一年持有混合、易方达悦盈一年持有混合、易方达悦弘一年持有混合、易方达悦浦一年持有混合、易方达丰华债券、易方达安心回馈混合、易方达悦信一年持有混合、	2026-03-13	-	6 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任大家资产管理有限责任公司研究员。

	易方达悦夏一年持有混合、易方达悦丰一年持有混合、易方达悦融一年持有混合、易方达悦稳一年持有混合、易方达悦鑫一年持有混合、易方达裕如混合、易方达悦通一年持有混合、易方达悦恒稳健债券的基金经理助理				
周琼	本基金的基金经理助理，易方达悦兴一年持有混合的基金经理，易方达鑫转添利混合、易方达裕丰回报债券、易方达新收益混合、易方达瑞信混合、易方达瑞和混合、易方达安盈回报混合、易方达安心回报债券、易方达新鑫混合、易方达新享混合、易方达瑞景混合、易方达瑞智混合、易方达瑞兴混合、易方达丰惠混合、易方达瑞锦混合、易方达悦兴一年持有混合（自 2020 年 12 月 01 日至 2026 年 06 月 12 日）、易方达瑞通混合、易方达全球配置混合（QDII）、易方达丰和债券的基金经理助理	2019-10-30	2026-03-14	12 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任凯仁投资咨询（上海）有限公司客户经理，易方达基金管理有限公司投资支持专员、研究员。

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/基金经理助理，“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行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间

优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 64 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，面对外部环境不稳定因素增多、地缘冲突及大宗商品价格波动等扰动，我国经济运行总体平稳、稳中有进，高质量发展向新向优，但结构分化持续加深，整体呈现生产强于需求、外需景气强于内需、新动能强于旧动能的特征。分阶段看，一季度出口、高技术制造以及财政资金和专项债靠前落地共同支撑增长，工业生产提速，投资同比增速由负转正，消费温和修复；二季度出口和工业生产仍具韧性，高技术制造延续较高景气，但消费、固定资产投资和房地产进一步走弱，经济内生修复斜率有所放缓。分结构看，AI 产业链、先进制造和出口链是上半年的主要亮点，地产仍有较大拖累，传统制造业投资和商品消费的改善相对有限。价格方面，一季度 CPI 同比明显回升至正增长、PPI 同比降幅收窄；二季度 PPI 同比在外部油价、AI 链涨价和部分行业“反内卷”等因素带动下明显修复，CPI 同比保持温和，反映价格回升更多集中在上游，并不意味着总需求全面走强。宏观政策坚持稳中求进、提质增效，实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，加大逆周期和跨周期调节力度，政策资源更多向扩大内需、科技创新、民生保障和重点风险化解等领域倾斜，为经济平稳运行和结构转型提供支撑。

债券市场方面，上半年收益率曲线整体呈现下行且陡峭化特征，市场驱动在基本面、资金面、政府债供给、通胀预期和权益风险偏好之间反复切换。一季度初，权益市场走强带来一定资金分流，长端利率一度上行；随后稳定的资金面和风险偏好降温推动各期限利率回落；春节后中东地缘冲突与油价上涨推升通胀担忧，短端利率在流动性支持下保持强势，长端和超长端承压，利率曲线进一步陡峭化。二季度初，超长期特别国债发行计划落地引发供给担忧，利率高位震荡；此后地缘冲突缓和、资金面宽松以及经济金融数据走弱共同推动利率快速下行，期间虽受央行净回笼和供给预期影响出现短暂调整，但整体仍维持偏强格局。总体看，中短久期品种表现相对占优，长久期、超长久期品种受供给与通胀预期扰动更大；信用债则在配置需求支撑下同步走强，信用利差进一步压缩。

股票市场上半年总体震荡上行，但波动较大、结构分化均显著，市场宽度在二季度后半段明显

下降。1 月市场普涨、情绪高涨，资源与科技板块共同驱动；2 月小盘、红利和周期板块相对占优，国产 AI、人形机器人等题材较为活跃；3 月中东地缘冲突和油价上行引发全球滞胀担忧，风险偏好快速回落，高弹性科技和前期涨幅较大的周期板块集中调整，能源与红利资产表现相对稳健。进入二季度，地缘扰动缓和推动市场快速修复，成长风格重新占优；随后市场对 AI 产业资本开支、国产替代、半导体设备和材料链景气的预期持续抬升，叠加财报进一步验证行业间盈利分化，硬科技成为市场主线。6 月创业板和科创板指数依靠少数科技龙头权重支撑维持强势运行，但绝大多数个股走势弱于权重标的，指数表现与个股体感的差异显著扩大。整体来看，上半年 A 股由年初较为广泛的估值修复逐步转向业绩和产业景气驱动，市场主线更加集中，传统内需、地产链和消费方向相对承压。

转债市场上半年呈现“M 形”震荡，估值波动较大，并由年初的整体稀缺逐步转向结构性、局部稀缺。1-2 月，中小盘正股走强叠加新增转债供给有限，转债市场表现异常强势，估值快速抬升；3 月正股调整、风险偏好回落与高价券强赎预期共振，转债市场出现平价和估值双重调整，高价高溢价品种回撤尤其明显。二季度初，转债随权益市场修复一度反弹，但随着行情向 AI 算力、半导体等少数硬科技龙头集中，转债正股中 TMT 板块占比偏低且缺乏主流科技标的，整体跟涨能力明显下降；5 月中下旬以后，转债指数回落，回吐了前期较多涨幅；供给受限、到期与赎回退出较多的格局仍对估值形成支撑，但高估值、剩余期限缩短、强赎与信用风险并存，使转债收益更加依赖正股选择、估值约束和条款博弈。

报告期内，本基金规模大幅上升。债券方面，上半年经济走势前高后低，资金利率维持稳定宽松，国内经济“K 型”分化加剧，政策发力较为克制给债券市场带来各品种轮动做多机会。一季度组合积极布局票息信用底仓，构建子弹型杠杆套息组合，较好跟住了信用债市场上涨和利差压缩的机会；二季度中短端信用债过于拥挤且极低利率水平下赔率有限，组合新增资金重点增配了兼具票息和利差保护的 20 年地方债品种，将结构逐步从子弹型调整成哑铃型，在保持中性略高久期水平的同时大幅提升了组合的流动性水平，整体跟住了市场上涨的趋势，且在季末资金收紧的市场环境下合理控制了债券部分的回撤。组合股票部分仓位大幅下降，结构上电子、通信等景气度较高的行业占比有所提升，减仓了银行、公用事业等稳定类板块。转债仓位较低且持续下降，主要减仓高估值、高溢价品种与赎回个券。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 1.9273 元，本报告期份额净值增长率为 4.33%，同期业绩比较基准收益率为 3.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国内经济有望延续总体平稳、结构分化的运行格局，企业盈利修复的节奏和结构将成为影响资产定价的重要线索。内需修复仍需观察就业、居民收入预期和消费倾向以及地产边际变化，新质生产力的表现值得期待。外需与海外 AI 资本开支预计仍具韧性，但需关注全球地缘局势、能源价格、海外利率及货币政策变化。总体看，经济复苏基础有望进一步巩固，但结构转换和内外部扰动仍可能带来阶段性波动，我们将持续跟踪政策落地、信用扩张和企业盈利的边际变化。

具体到资产，从债券的配置视角来看，当前宏观环境处于“货币稳中有松、财政发力温和”的格局，债市尚不具备系统性逆转的基础，整体风险可控。因此，即使在低收益率环境下，组合无意通过压降久期来防守，而是立足于结构优化来贡献超额收益。鉴于当前信用债票息保护不足、风险收益特征明显劣化，组合将延续哑铃型配置，重点向超长期利率债倾斜，以捕捉收益率曲线平坦化过程中的交易性机会。随着前期布局品种的资本利得逐步释放，后续将择机进行逆势再平衡，同时密切跟踪政策边际变化、基本面预期差及市场情绪拐点，力求在票息保护边际弱化的背景下为组合创造更具弹性的收益回报。权益市场方面，盈利改善有利于市场保持韧性，结构层面下半年市场的广度有望提升；AI 与先进制造的产业趋势仍具中期支撑，可以在产业链上进一步寻找估值与业绩增速匹配较好的方向去参与；由于前期持续的分化，一些低估值的板块已经出现了一些股息较高同时叠加一定业绩增速的个股，可以从这类股票中寻找机会。考虑到偏低的广谱利率水平和充裕的流动性，我们仍将积极地参与权益市场的机会。转债市场方面，估值已经到了很高的水位，但考虑到紧张的供需格局和良好的权益预期，预计维持高估值、高波动的状态，组合将在仓位和个券层面灵活应对、积极操作、控制风险，更多抓取具备较好不对称性的结构性机会。组合将继续力争以长期稳健的业绩回报基金持有人。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引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。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值程序和技术，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达新利灵活配置混合型证券投资基金（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，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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地复核，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。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

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、投资组合报告等数据真实、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：易方达新利灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,098,366.21	1,355,298.99
结算备付金		1,573,060.81	3,005,561.87
存出保证金		45,581.86	50,899.69
交易性金融资产	6.4.7.2	2,509,442,428.33	572,485,246.14
其中：股票投资		200,320,954.62	101,602,158.27
基金投资		-	-
债券投资		2,309,121,473.71	461,003,745.34
资产支持证券投资		-	9,879,342.53
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		96,715,786.97	6,053,333.42
应收股利		-	-
应收申购款		1,694,792.08	123,388.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,610,570,016.26	583,073,728.50
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		559,918,298.41	103,594,648.96
应付清算款		-	6,404,645.89
应付赎回款		1,335,102.35	81,410.22
应付管理人报酬		810,084.81	240,288.55
应付托管费		270,028.27	80,096.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		38,680.89	20,396.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	173,903.59	67,784.24
负债合计		562,546,098.32	110,489,271.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,062,636,844.71	255,825,680.92

未分配利润	6.4.7.8	985,387,073.23	216,758,776.54
净资产合计		2,048,023,917.94	472,584,457.46
负债和净资产总计		2,610,570,016.26	583,073,728.50

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.9273 元，基金份额总额 1,062,636,844.71 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达新利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		35,603,940.35	8,188,612.30
1.利息收入		387,881.32	22,023.42
其中：存款利息收入	6.4.7.9	91,546.57	20,196.67
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		296,334.75	1,826.75
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		22,308,380.34	25,100,122.70
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,426,648.13	6,516,808.17
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	10,068,701.02	16,424,056.59
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	135,454.12	137,427.12
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	1,677,577.07	2,021,830.82
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	12,720,687.26	-17,012,674.18
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	186,991.43	79,140.36
减：二、营业总支出		3,873,879.65	4,626,390.39
1. 管理人报酬		2,366,045.90	1,871,402.25
2. 托管费		788,681.95	623,800.71
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		605,148.44	2,012,215.88
其中：卖出回购金融资产支出		605,148.44	2,012,215.88
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		14,720.80	17,408.39

8. 其他费用	6.4.7.18	99,282.56	101,563.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,730,060.70	3,562,221.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,730,060.70	3,562,221.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		31,730,060.70	3,562,221.91

6.3 净资产变动表

会计主体：易方达新利灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	255,825,680.92	216,758,776.54	472,584,457.46
二、本期期初净资产	255,825,680.92	216,758,776.54	472,584,457.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	806,811,163.79	768,628,296.69	1,575,439,460.48
（一）、综合收益总额	-	31,730,060.70	31,730,060.70
（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）	806,811,163.79	736,898,235.99	1,543,709,399.78
其中：1.基金申购款	861,463,288.72	785,301,596.12	1,646,764,884.84
2.基金赎回款	-54,652,124.93	-48,403,360.13	-103,055,485.06
（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	1,062,636,844.71	985,387,073.23	2,048,023,917.94
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	410,174,621.96	318,258,613.19	728,433,235.15
二、本期期初净资产	410,174,621.96	318,258,613.19	728,433,235.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-71,173,765.20	-50,684,705.54	-121,858,470.74
（一）、综合收益总额	-	3,562,221.91	3,562,221.91
（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）	-71,173,765.20	-54,246,927.45	-125,420,692.65
其中：1.基金申购款	36,340,137.90	28,050,969.36	64,391,107.26
2.基金赎回款	-107,513,903.10	-82,297,896.81	-189,811,799.91
（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	339,000,856.76	267,573,907.65	606,574,764.41

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：

基金管理人负责人：吴欣荣，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达新利灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]633 号《关于准予易方达新利灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2015 年 4 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,295,830,140.54 份基金份额，其中认购资金利息折合 231,700.20 份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为

中国邮政储蓄银行股份有限公司。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金合同和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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[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]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《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《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部 税务总局公告 2021 年第 33 号《关于北京证券交易所税收政策适用问题的公告》和财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优

惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 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 6 月 30 日
活期存款	1,098,366.21
等于：本金	1,097,358.65
加：应计利息	1,007.56
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	1,098,366.21

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		182,736,369.59	-	200,320,954.62	17,584,585.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	226,501,492.36	622,265.64	227,625,287.14	501,529.14
	银行间市场	2,059,120,754.56	18,014,686.57	2,081,496,186.57	4,360,745.44
	合计	2,285,622,246.92	18,636,952.21	2,309,121,473.71	4,862,274.58
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,468,358,616.51	18,636,952.21	2,509,442,428.33	22,446,859.61

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

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。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,845.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	90,375.75
其中：交易所市场	53,030.52
银行间市场	37,345.23
应付利息	-
预提费用	80,682.56
合计	173,903.59

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,825,680.92	255,825,680.92
本期申购	861,463,288.72	861,463,288.72
本期赎回（以“-”号填列）	-54,652,124.93	-54,652,124.93
本期末	1,062,636,844.71	1,062,636,844.71

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	239,136,482.97	-22,377,706.43	216,758,776.54
本期期初	239,136,482.97	-22,377,706.43	216,758,776.54
本期利润	19,009,373.44	12,720,687.26	31,730,060.70
本期基金份额交易产生的	788,241,593.05	-51,343,357.06	736,898,235.99

变动数			
其中：基金申购款	840,359,959.51	-55,058,363.39	785,301,596.12
基金赎回款	-52,118,366.46	3,715,006.33	-48,403,360.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,046,387,449.46	-61,000,376.23	985,387,073.23

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	37,478.58
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	6,976.75
其他	47,091.24
合计	91,546.57

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	10,426,648.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	10,426,648.13

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	33,201,905.33
减：卖出股票成本总额	22,688,181.90
减：交易费用	87,075.30
买卖股票差价收入	10,426,648.13

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——利息收入	6,690,534.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,378,166.92
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	10,068,701.02

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	658,674,201.84
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	648,871,534.84
减：应计利息总额	6,394,376.88
减：交易费用	30,123.20
买卖债券差价收入	3,378,166.92

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	75,546.88
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	59,907.24
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	135,454.12

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	9,947,069.15
减：卖出资产支持证券成本总额	9,818,964.08

减：应计利息总额	68,197.83
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	59,907.24

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,677,577.07
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	1,677,577.07

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	12,720,687.26
——股票投资	9,224,271.20
——债券投资	3,552,451.98
——资产支持证券投资	-56,035.92
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	12,720,687.26

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	186,991.43
合计	186,991.43

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	21,175.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	99,282.56

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内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
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

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发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

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发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

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发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

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1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,366,045.90	1,871,402.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	297,837.74	55,860.14
应支付基金管理人的净管理费	2,068,208.16	1,815,542.11

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.60\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	788,681.95	623,800.71

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E\times 0.20\%\div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人在次月初 3 个工作日内出具资金划拨指令，基金托管人复核无误后于 2 个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期

2026年1月1日至2026年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国邮政储 蓄银行	-	-	-	-	58,000,000.00	3,562.15
上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

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		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行-活期存款	1,098,366.21	37,478.58	1,250,389.76	9,533.73

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司保管，按银行同业利

率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	603435	嘉德利	新股发行	1,031	16,248.56
上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301662	宏工科技	新股发行	1,429	38,011.40

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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-24	1 个月以内	新股流通受限	10.11	10.11	17,274	174,640.14	174,640.14	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	40,309	407,523.99	407,523.99	-
001399	惠科股份	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	590	6,596.20	10,378.10	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688759	必贝特	2025-10-21	9 个月	新股流通受限	17.78	30.65	12,552	223,174.56	384,718.80	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9 个月	新股流通受限	8.62	57.42	22,719	195,837.78	1,304,524.98	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025-11-26	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	2,362	269,929.36	1,598,932.28	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	新股流通	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-

				受限						
688811	有研新材	2026-04-01	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,124	22,120.32	159,034.76	-
920136	永励精密	2026-06-25	1 个月以内	新股流通受限	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 459,918,298.41 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
102483222	24 兴湘投资 MTN002	2026-07-07	103.31	100,000	10,330,945.21
102483530	24 中兴通讯 MTN001(科创票据)	2026-07-07	103.45	200,000	20,690,630.14
102484714	24 河南建投 MTN001	2026-07-07	104.48	400,000	41,790,603.84
102582859	25 深圳地铁 MTN001B	2026-07-07	102.86	53,000	5,451,830.91
102584417	25 日照港股	2026-07-07	102.34	100,000	10,233,712.33

	MTN001				
102680585	26 金财投资 MTN001(科创 债)	2026-07-07	100.55	300,000	30,164,442.74
102681550	26 华远陆港 MTN002	2026-07-07	100.37	300,000	30,111,673.97
102681873	26 榆林能源 MTN001	2026-07-07	100.15	300,000	30,046,027.40
232580001	25 工行二级 资本债 01BC	2026-07-07	101.83	100,000	10,182,917.81
232580008	25 工行二级 资本债 02BC	2026-07-07	101.22	200,000	20,243,812.60
232580024	25 农行二级 资本债 02A(BC)	2026-07-07	102.41	200,000	20,481,842.19
232580026	25 建行二级 资本债 02A(BC)	2026-07-07	102.50	300,000	30,749,985.21
242400019	24 江苏银行 永续债 02	2026-07-07	103.51	100,000	10,351,415.34
242580007	25 兴业银行 永续债 01BC	2026-07-07	101.46	200,000	20,292,299.18
242580019	25 浦发银行 永续债 01	2026-07-07	100.94	100,000	10,094,453.70
242680010	26 宁波银行 永续债 01	2026-07-07	100.34	500,000	50,168,402.74
312400001	24 工行 TLAC 非资本债 01A	2026-07-07	100.94	500,000	50,470,958.90
312410008	24 交行 TLAC 非资本债 01(BC)	2026-07-07	102.04	400,000	40,815,570.41
312510012	25 中行 TLAC 非资本债 02(BC)	2026-07-07	102.30	300,000	30,689,016.99
312610003	26 农行 TLAC 非资本债 01C(BC)	2026-07-07	101.75	100,000	10,174,812.60
312610006	26 农行 TLAC 非资本债 02A(BC)	2026-07-07	100.40	100,000	10,040,493.15
合计				4,853,000	493,575,847.36

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,000,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、地方政府债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 83.09%(2025 年 12 月 31 日：86.10%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
--------	-------------------	---------------------

A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	518,708,759.39	24,670,797.75
合计	518,708,759.39	24,670,797.75

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	1,189,186,648.84	234,588,675.82
AAA 以下	10,861,344.54	10,738,677.36
未评级	590,364,720.94	191,005,594.41
合计	1,790,412,714.32	436,332,947.59

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	9,879,342.53
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	9,879,342.53

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2026 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》《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，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VaR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,098,366.21	-	-	-	1,098,366.21
结算备付金	1,573,060.81	-	-	-	1,573,060.81
存出保证金	45,581.86	-	-	-	45,581.86
交易性金融资产	522,645,930.20	852,612,497.20	933,863,046.31	200,320,954.62	2,509,442,428.33
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	96,715,786.97	96,715,786.97
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,694,792.08	1,694,792.08
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	525,362,939.08	852,612,497.20	933,863,046.31	298,731,533.67	2,610,570,016.26
负债					

短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	559,918,298.41	-	-	-	559,918,298.41
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,335,102.35	1,335,102.35
应付管理人报酬	-	-	-	810,084.81	810,084.81
应付托管费	-	-	-	270,028.27	270,028.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	38,680.89	38,680.89
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	173,903.59	173,903.59
负债总计	559,918,298.41	-	-	2,627,799.91	562,546,098.32
利率敏感度缺口	-34,555,359.33	852,612,497.20	933,863,046.31	296,103,733.76	2,048,023,917.94
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	1,355,298.99	-	-	-	1,355,298.99
结算备付金	3,005,561.87	-	-	-	3,005,561.87
存出保证金	50,899.69	-	-	-	50,899.69
交易性金融资产	31,637,399.98	358,740,296.51	80,505,391.38	101,602,158.27	572,485,246.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	6,053,333.42	6,053,333.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	123,388.39	123,388.39
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,049,160.53	358,740,296.51	80,505,391.38	107,778,880.08	583,073,728.50

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	103,594,648.96	-	-	-	103,594,648.96
应付清算款	-	-	-	6,404,645.89	6,404,645.89
应付赎回款	-	-	-	81,410.22	81,410.22
应付管理人报酬	-	-	-	240,288.55	240,288.55
应付托管费	-	-	-	80,096.19	80,096.19
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	20,396.99	20,396.99
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	67,784.24	67,784.24
负债总计	103,594,648.96	-	-	6,894,622.08	110,489,271.04
利率敏感度缺口	-67,545,488.43	358,740,296.51	80,505,391.38	100,884,258.00	472,584,457.46

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	21,544,169.63	3,098,091.20
	2.市场利率上升 25 个基点	-20,854,041.61	-3,059,293.65

6.4.13.4.2 外汇风险

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准

差、跟踪误差、beta 值、VaR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	200,320,954.62	9.78	101,602,158.27	21.50
交易性金融资产—债券投资	16,227,569.33	0.79	-	-
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	216,548,523.95	10.57	101,602,158.27	21.50

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 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	38,144,464.11	19,863,089.02
	2.业绩比较基准下降 5%	-38,144,464.11	-19,863,089.02

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	211,232,343.92
第二层次	2,293,572,666.23
第三层次	4,637,418.18
合计	2,509,442,428.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

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	200,320,954.62	7.67
	其中：股票	200,320,954.62	7.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,309,121,473.71	88.45
	其中：债券	2,309,121,473.71	88.45

	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	2,671,427.02	0.10
8	其他各项资产	98,456,160.91	3.77
9	合计	2,610,570,016.26	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

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	1,375,345.00	0.07
B	采矿业	10,088,737.50	0.49
C	制造业	127,986,701.01	6.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,398,273.73	0.56
E	建筑业	1,209,558.00	0.06
F	批发和零售业	357,802.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	8,505,436.00	0.42
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,520,304.02	0.17
J	金融业	29,249,845.60	1.43
K	房地产业	1,177,164.00	0.06
L	租赁和商务服务业	1,098,680.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	348,628.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	2,824,133.60	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	827,756.16	0.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	352,590.00	0.02

	合计	200,320,954.62	9.78
--	----	----------------	------

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	占基金资产净值 比例（%）
1	688548	广钢气体	211,532	11,020,817.20	0.54
2	002371	北方华创	10,400	9,199,424.00	0.45
3	002142	宁波银行	289,440	8,593,473.60	0.42
4	601318	中国平安	177,500	8,473,850.00	0.41
5	002283	天润工业	712,600	6,876,590.00	0.34
6	600900	长江电力	252,400	6,681,028.00	0.33
7	600028	中国石化	1,427,500	6,366,650.00	0.31
8	002475	立讯精密	88,300	6,216,320.00	0.30
9	600563	法拉电子	27,500	5,247,000.00	0.26
10	600660	福耀玻璃	101,200	5,104,528.00	0.25
11	300274	阳光电源	29,700	4,722,894.00	0.23
12	300308	中际旭创	3,700	4,699,000.00	0.23
13	601211	国泰海通	232,800	4,236,960.00	0.21
14	002352	顺丰控股	123,200	3,851,232.00	0.19
15	601816	京沪高铁	790,200	3,579,606.00	0.17
16	300750	宁德时代	8,940	3,513,509.40	0.17
17	300408	三环集团	20,500	3,421,450.00	0.17
18	603766	隆鑫通用	279,700	3,336,821.00	0.16
19	002311	海大集团	68,900	3,073,629.00	0.15
20	300502	新易盛	4,520	2,743,640.00	0.13
21	688059	华锐精密	13,385	2,673,118.35	0.13
22	000333	美的集团	34,700	2,620,891.00	0.13
23	600236	桂冠电力	295,220	2,592,031.60	0.13
24	002415	海康威视	75,300	2,575,260.00	0.13
25	600522	中天科技	40,600	2,463,608.00	0.12
26	600323	瀚蓝环境	89,000	2,443,940.00	0.12
27	601988	中国银行	401,700	2,297,724.00	0.11
28	002444	巨星科技	71,800	2,232,980.00	0.11
29	000338	潍柴动力	72,100	1,964,725.00	0.10
30	600519	贵州茅台	1,600	1,896,784.00	0.09
31	002353	杰瑞股份	12,300	1,875,750.00	0.09
32	601939	建设银行	193,900	1,867,257.00	0.09
33	601058	赛轮轮胎	150,500	1,735,265.00	0.08
34	688795	摩尔线程	2,362	1,598,932.28	0.08
35	002318	久立特材	65,500	1,565,450.00	0.08
36	000423	东阿阿胶	33,000	1,496,880.00	0.07

37	688521	芯原股份	3,844	1,426,662.16	0.07
38	002396	星网锐捷	73,700	1,412,829.00	0.07
39	600585	海螺水泥	82,000	1,389,900.00	0.07
40	688797	臻宝科技	2,070	1,382,689.62	0.07
41	688187	时代电气	19,907	1,366,814.62	0.07
42	688783	西安奕材	22,719	1,304,524.98	0.06
43	688008	澜起科技	4,208	1,304,059.20	0.06
44	002463	沪电股份	8,200	1,252,960.00	0.06
45	601899	紫金矿业	49,500	1,244,430.00	0.06
46	002384	东山精密	4,700	1,233,045.00	0.06
47	601668	中国建筑	278,700	1,209,558.00	0.06
48	601225	陕西煤业	59,300	1,206,755.00	0.06
49	002714	牧原股份	32,300	1,130,177.00	0.06
50	002027	分众传媒	227,000	1,098,680.00	0.05
51	000157	中联重科	152,000	1,059,440.00	0.05
52	688279	峰岬科技	4,396	986,638.24	0.05
53	603067	振华股份	20,100	930,429.00	0.05
54	000538	云南白药	19,180	908,556.60	0.04
55	601688	华泰证券	43,300	892,846.00	0.04
56	000063	中兴通讯	24,600	890,274.00	0.04
57	601872	招商轮船	50,400	885,528.00	0.04
58	002597	金禾实业	42,900	840,840.00	0.04
59	600763	通策医疗	24,432	827,756.16	0.04
60	003816	中国广核	202,500	791,775.00	0.04
61	601818	光大银行	263,700	762,093.00	0.04
62	600905	三峡能源	202,500	751,275.00	0.04
63	601601	中国太保	25,900	738,668.00	0.04
64	600048	保利发展	156,200	723,206.00	0.04
65	603606	东方电缆	17,040	707,330.40	0.03
66	600583	海油工程	140,500	706,715.00	0.03
67	002078	太阳纸业	55,300	690,697.00	0.03
68	600887	伊利股份	28,500	682,860.00	0.03
69	688041	海光信息	1,784	660,615.20	0.03
70	601233	桐昆股份	30,000	649,500.00	0.03
71	688652	京仪装备	3,130	626,532.10	0.03
72	600036	招商银行	17,600	624,800.00	0.03
73	600426	华鲁恒升	25,600	612,352.00	0.03
74	002648	卫星化学	25,000	587,250.00	0.03
75	601398	工商银行	82,800	585,396.00	0.03
76	688188	柏楚电子	5,482	584,929.40	0.03
77	001248	华润新能源	57,583	582,164.13	0.03
78	600600	青岛啤酒	11,100	579,753.00	0.03
79	600348	华阳股份	73,750	564,187.50	0.03
80	688498	源杰科技	295	556,370.00	0.03

81	001399	惠科股份	16,218	551,403.64	0.03
82	688239	航宇科技	9,136	546,606.88	0.03
83	002507	涪陵榨菜	49,920	539,136.00	0.03
84	603345	安井食品	6,500	521,235.00	0.03
85	001979	招商蛇口	70,600	453,958.00	0.02
86	688147	微导纳米	2,587	418,783.56	0.02
87	688120	华海清科	1,278	411,746.04	0.02
88	000425	徐工机械	50,600	409,354.00	0.02
89	300693	盛弘股份	8,300	404,625.00	0.02
90	300661	圣邦股份	2,800	401,744.00	0.02
91	000651	格力电器	10,300	386,250.00	0.02
92	600276	恒瑞医药	7,400	385,096.00	0.02
93	688759	必贝特	12,552	384,718.80	0.02
94	920072	科莱瑞迪	10,144	383,950.40	0.02
95	603568	伟明环保	24,720	380,193.60	0.02
96	603939	益丰药房	19,900	357,802.00	0.02
97	300450	先导智能	8,700	354,264.00	0.02
98	600673	东阳光	10,500	352,590.00	0.02
99	603259	药明康德	2,800	348,628.00	0.02
100	000039	中集集团	39,500	320,345.00	0.02
101	002493	荣盛石化	26,800	288,100.00	0.01
102	688486	龙迅股份	4,509	286,682.22	0.01
103	603612	索通发展	15,700	284,641.00	0.01
104	300433	蓝思科技	5,100	273,666.00	0.01
105	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
106	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
107	300498	温氏股份	19,900	245,168.00	0.01
108	601311	骆驼股份	31,000	241,490.00	0.01
109	002222	福晶科技	2,600	239,928.00	0.01
110	600699	均胜电子	10,700	231,227.00	0.01
111	000568	泸州老窖	2,900	224,808.00	0.01
112	603228	景旺电子	3,100	224,471.00	0.01
113	688123	聚辰股份	1,055	224,293.00	0.01
114	688068	热景生物	2,386	206,627.60	0.01
115	300136	信维通信	1,700	202,725.00	0.01
116	000581	威孚高科	11,800	200,836.00	0.01
117	600016	民生银行	54,900	176,778.00	0.01
118	600160	巨化股份	3,300	174,933.00	0.01
119	600487	亨通光电	1,500	164,010.00	0.01
120	300014	亿纬锂能	2,500	162,575.00	0.01
121	688820	盛合晶微	1,124	159,034.76	0.01
122	002930	宏川智慧	17,000	156,400.00	0.01
123	601689	拓普集团	2,400	135,408.00	0.01
124	603225	新凤鸣	6,603	129,748.95	0.01

125	002602	世纪华通	9,200	129,720.00	0.01
126	002472	双环传动	3,100	128,681.00	0.01
127	603950	长源东谷	1,500	126,645.00	0.01
128	000703	恒逸石化	9,200	124,844.00	0.01
129	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
130	600298	安琪酵母	3,100	112,220.00	0.01
131	000680	山推股份	11,000	110,550.00	0.01
132	600761	安徽合力	6,700	109,612.00	0.01
133	002430	杭氧股份	3,500	108,360.00	0.01
134	002237	恒邦股份	7,200	105,768.00	0.01
135	002555	三七互娱	5,600	105,672.00	0.01
136	601012	隆基绿能	7,400	97,088.00	0.00
137	688388	嘉元科技	1,888	83,072.00	0.00
138	603268	松发股份	500	69,640.00	0.00
139	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.00
140	600346	恒力石化	3,500	61,985.00	0.00
141	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
142	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
143	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
144	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
145	300207	欣旺达	2,000	37,980.00	0.00
146	601111	中国国航	5,400	32,670.00	0.00
147	000999	华润三九	1,300	29,237.00	0.00
148	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
149	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
150	601112	振石股份	590	10,378.10	0.00
151	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
152	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
153	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
154	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
155	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
156	603284	林平发展	46	1,604.02	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	002142	宁波银行	7,646,137.00	1.62
2	002283	天润工业	7,539,057.00	1.60
3	002371	北方华创	6,870,352.00	1.45
4	601318	中国平安	6,375,267.00	1.35
5	688548	广钢气体	5,746,620.68	1.22

6	600028	中国石化	4,714,237.00	1.00
7	300274	阳光电源	4,615,658.00	0.98
8	601211	国泰海通	4,187,428.00	0.89
9	002352	顺丰控股	4,105,172.00	0.87
10	600563	法拉电子	3,875,476.00	0.82
11	002475	立讯精密	3,761,099.00	0.80
12	002318	久立特材	3,700,750.00	0.78
13	603766	隆鑫通用	3,610,888.00	0.76
14	300308	中际旭创	3,504,470.00	0.74
15	000423	东阿阿胶	3,116,664.00	0.66
16	600900	长江电力	2,951,768.00	0.62
17	002444	巨星科技	2,433,018.00	0.51
18	002353	杰瑞股份	1,802,799.00	0.38
19	601899	紫金矿业	1,664,406.00	0.35
20	300502	新易盛	1,641,351.00	0.35

注：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	920186	中科仪	6,197,313.68	1.31
2	600522	中天科技	3,694,045.00	0.78
3	002318	久立特材	3,435,818.00	0.73
4	688036	传音控股	2,085,848.32	0.44
5	300014	亿纬锂能	1,631,720.00	0.35
6	000423	东阿阿胶	1,209,054.00	0.26
7	002493	荣盛石化	1,185,465.00	0.25
8	688808	联讯仪器	1,174,164.10	0.25
9	600930	华电新能	1,096,680.00	0.23
10	300394	天孚通信	1,063,015.80	0.22
11	688818	电科蓝天	970,196.79	0.21
12	688820	盛合晶微	844,444.86	0.18
13	688635	长进光子	741,871.55	0.16
14	601233	桐昆股份	655,299.00	0.14
15	600900	长江电力	655,020.00	0.14
16	002237	恒邦股份	596,295.00	0.13
17	601872	招商轮船	507,896.00	0.11
18	603225	新凤鸣	505,366.00	0.11
19	688785	恒运昌	461,359.93	0.10
20	300750	宁德时代	408,450.00	0.09

注：卖出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。

7.4.3 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	112,182,707.05
卖出股票收入（成交）总额	33,201,905.33

注：“买入股票成本”或“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	16,505,388.90	0.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,185,433,224.87	57.88
	其中：政策性金融债	196,224,258.01	9.58
4	企业债券	120,627,090.96	5.89
5	企业短期融资券	292,223,614.80	14.27
6	中期票据	355,876,458.64	17.38
7	可转债（可交换债）	16,227,569.33	0.79
8	同业存单	-	-
9	其他	322,228,126.21	15.73
10	合计	2,309,121,473.71	112.75

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值 比例(%)
1	2128025	21 建设银行二级 01	1,200,000	123,945,041.10	6.05
2	2228014	22 交通银行二级 01	1,000,000	102,452,767.12	5.00
3	012582404	25 广州产投 SCP005	1,000,000	101,261,095.89	4.94
4	242775	25 国券 G1	800,000	80,751,859.73	3.94
5	012680913	26 楚天智能 SCP003	800,000	80,249,293.15	3.92

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	45,581.86
2	应收清算款	96,715,786.97

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,694,792.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	98,456,160.91

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113056	重银转债	835,850.91	0.04
2	113052	兴业转债	767,634.58	0.04
3	113051	节能转债	729,320.30	0.04
4	127056	中特转债	661,765.47	0.03
5	113062	常银转债	606,120.37	0.03
6	118034	晶能转债	588,667.30	0.03
7	113667	春 23 转债	584,645.37	0.03
8	118050	航宇转债	568,015.28	0.03
9	113042	上银转债	557,992.70	0.03
10	127027	能化转债	551,181.82	0.03
11	113049	长汽转债	550,607.36	0.03
12	118031	天 23 转债	538,721.62	0.03
13	127089	晶澳转债	533,217.10	0.03
14	123091	长海转债	341,854.57	0.02
15	118058	微导转债	338,249.82	0.02
16	113691	和邦转债	302,139.62	0.01
17	127108	太能转债	299,071.89	0.01
18	127040	国泰转债	276,186.30	0.01
19	113046	金田转债	260,096.34	0.01
20	127103	东南转债	259,312.19	0.01
21	113048	晶科转债	255,353.18	0.01
22	113661	福 22 转债	254,593.57	0.01
23	118022	锂科转债	245,584.73	0.01
24	113633	科沃转债	233,304.05	0.01
25	123187	超达转债	232,649.25	0.01
26	127067	恒逸转 2	226,950.17	0.01
27	113059	福莱转债	226,357.83	0.01

28	123149	通裕转债	217,797.57	0.01
29	118024	冠宇转债	216,952.90	0.01
30	111009	盛泰转债	207,875.31	0.01
31	113650	博 22 转债	197,020.50	0.01
32	113671	武进转债	191,694.12	0.01
33	110076	华海转债	188,669.69	0.01
34	128142	新乳转债	181,031.67	0.01
35	123253	永贵转债	162,576.20	0.01
36	123183	海顺转债	161,838.53	0.01
37	118005	天奈转债	146,978.69	0.01
38	113658	密卫转债	143,551.59	0.01
39	127044	蒙娜转债	142,143.74	0.01
40	123194	百洋转债	139,740.08	0.01
41	123113	仙乐转债	134,422.40	0.01
42	110087	天业转债	128,759.29	0.01
43	118010	洁特转债	127,183.51	0.01
44	113656	嘉诚转债	125,167.86	0.01
45	123158	宙邦转债	125,157.47	0.01
46	127069	小熊转债	124,296.06	0.01
47	123195	蓝晓转 02	113,734.42	0.01
48	113640	苏利转债	111,409.57	0.01
49	123122	富瀚转债	110,109.62	0.01
50	118032	建龙转债	106,677.73	0.01
51	110093	神马转债	105,751.28	0.01
52	123133	佩蒂转债	97,057.52	0.00
53	128138	侨银转债	95,827.06	0.00
54	118044	赛特转债	95,784.50	0.00
55	123189	晓鸣转债	93,404.47	0.00
56	123092	天壕转债	90,813.72	0.00
57	118040	宏微转债	89,157.99	0.00
58	123175	百畅转债	58,824.94	0.00
59	127061	美锦转债	51,399.33	0.00
60	127082	亚科转债	46,556.93	0.00
61	127078	优彩转债	41,716.53	0.00
62	113677	华懋转债	31,042.85	0.00

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

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
4,173	254,645.78	927,371,369.75	87.27%	135,265,474.96	12.73%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	79.31%

注：盈利投资者数量占比=盈利投资者数量/投资者总数

其中，投资者指指标计算期间持有过基金份额的投资者，盈利投资者指投资者区间净收益不小于零的投资者。

投资者区间净收益=投资者区间收益-基金交易手续费（认申购费、赎回费、转换费等）。其中，区间收益=持有期末市值-持有期初市值+（赎回+转出+非交易过户出）-（认购+申购+定投+转入+非交易过户入）+现金分红

该指标计算时剔除持有期限不满 7 日的交易。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	225,760.18	0.0212%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 4 月 30 日）基金份额总额	7,295,830,140.54
本报告期期初基金份额总额	255,825,680.92
本报告期基金总申购份额	861,463,288.72
减：本报告期基金总赎回份额	54,652,124.93
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,062,636,844.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 1 月 5 日发布公告，自 2026 年 1 月 3 日起高松凡先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，基金管理人未受到调查或处罚。

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，基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

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未受到调查或处罚。

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	
东吴证券	1	6,370,579.68	4.52%	2,325.29	3.81%	-
国泰海通	2	8,097,225.41	5.75%	3,530.38	5.79%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	14,713,830.73	10.44%	6,415.25	10.52%	-
银河证券	2	18,386,239.52	13.05%	8,016.42	13.14%	-
招商证券	1	73,712,386.30	52.31%	32,138.26	52.69%	-
中信证券	2	19,641,866.26	13.94%	8,563.85	14.04%	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。本报告期内基金证券经营机构的选择标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；
- 5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	18,446,884.77	5.51%	2,122,300,000.00	63.03%	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	104,357,105.90	31.15%	823,600,000.00	24.46%	-	-
银河证券	147,089,546.37	43.90%	140,100,000.00	4.16%	-	-
招商证券	54,206,141.17	16.18%	166,217,000.00	4.94%	-	-
中信证券	10,936,313.98	3.26%	114,900,000.00	3.41%	-	-

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	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-05
2	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销与基金投顾业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-01-08
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-01-22
4	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-02-24
5	易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-13
6	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-23
7	易方达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）	基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	上海证券报	2026-03-31
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2026-04-22
10	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-04-23
11	2025 年度易方达基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站	2026-04-30
12	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联	上海证券报、基金管理人	2026-05-16

	交易事项的公告	网站及中国证监会基金 电子披露网站	
13	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-05-23
14	易方达基金管理有限公司及易方达财富管理基金销售（广州）有限公司关于零售直销业务迁移安排的联合提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2026-06-23

§ 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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达新利灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达新利灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日