

汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇泉基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业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	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	36
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.11 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 盈利投资者数量占比	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	51
§ 9 开放式基金份额变动.....	51
§ 10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	52
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.....	53
10.8 其他重大事件	54
§ 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
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	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	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	汇泉匠心智选一年持有混合	
基金主代码	016091	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 09 月 13 日	
基金管理人	汇泉基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,407,649.95 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	016091	016092
报告期末下属分级基金的份额总额	22,992,200.24 份	2,415,449.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制投资组合风险的前提下，依托基金管理人的研究平台和研究能力，通过对不同资产类别的动态配置和个股精选，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括：1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、股票期权投资策略；8、国债期货投资策略；9、参与融资业务的投资策略
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*65%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*10%+一年期定期存款利率（税后）*25%
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高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇泉基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张强	任航
	联系电话	010-81925261	010-66060069
	电子邮箱	zhangqiang@springsfund.com	tgxxpl@abchina.com

客户服务电话	400-001-5252、010-81925252	95599
传真	010-81925299	010-68121816
注册地址	北京市通州区贡院街 1 号院 1 号楼二层 206-40 室	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100044	100031
法定代表人	孟朝霞	谷澍

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	汇泉基金管理有限公司	北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C
本期已实现收益	7,212,330.52	899,002.74
本期利润	6,785,866.22	789,541.55
加权平均基金份额本期利润	0.2399	0.2092
本期加权平均净值利润率	19.93%	17.81%
本期基金份额净值增长率	22.74%	22.37%
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	9,781,910.12	949,864.78
期末可供分配基金份额利润	0.4254	0.3932
期末基金资产净值	32,774,110.36	3,365,314.49
期末基金份额净值	1.4254	1.3932
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	42.54%	39.32%

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

汇泉匠心智选一年持有混合 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	33.66%	1.92%	7.93%	0.94%	25.73%	0.98%
过去六个月	22.74%	1.66%	5.82%	0.89%	16.92%	0.77%
过去一年	48.63%	1.38%	20.32%	0.79%	28.31%	0.59%
过去三年	46.10%	1.26%	26.01%	0.86%	20.09%	0.40%
自基金合同生 效起至今	42.54%	1.18%	22.18%	0.83%	20.36%	0.35%

汇泉匠心智选一年持有混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	33.46%	1.92%	7.93%	0.94%	25.53%	0.98%
过去六个月	22.37%	1.66%	5.82%	0.89%	16.55%	0.77%
过去一年	47.74%	1.37%	20.32%	0.79%	27.42%	0.58%
过去三年	43.50%	1.26%	26.01%	0.86%	17.49%	0.40%
自基金合同生 效起至今	39.32%	1.18%	22.18%	0.83%	17.14%	0.35%

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

汇泉匠心智选一年持有混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年09月13日-2026年06月30日)



汇泉匠心智选一年持有混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年09月13日-2026年06月30日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇泉基金管理有限公司（以下简称“我公司”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】1028号文批准，于2020年6月15日在北京市注册成立，注册资本10468万元人民币。并于2020年12月21日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。我公司目前股东

及其出资比例为：杨宇先生 52.83%，梁永强先生 29.61%，孟朝霞女士 2.01%，柴功先生 1.51%，北京溪泉企业管理中心（有限合伙）4.68%，上海澹泉企业管理中心（有限合伙）4.68%，上海沛泉企业管理中心（有限合伙）4.68%。

截至本报告期末，我公司共管理 14 只公募基金，具体包括汇泉策略优选混合型证券投资基金、汇泉臻心致远混合型证券投资基金、汇泉兴至未来一年持有期混合型证券投资基金、汇泉安盈回报债券型证券投资基金、汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金、汇泉启元未来混合型发起式证券投资基金、汇泉中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、汇泉安阳纯债债券型证券投资基金、汇泉智享量化选股混合型证券投资基金、汇泉均衡智选混合型证券投资基金、汇泉安瑞回报债券型证券投资基金、汇泉中证 A500 指数量化增强型证券投资基金、汇泉安悦 90 天持有期债券型证券投资基金、汇泉科创创业量化选股混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨宇	本基金的基金经理兼任投资经理、首席量化投资官	2022-09-13	-	27 年	中国国籍，硕士研究生，具有基金从业资格。曾任万家（天同）基金管理有限公司投资管理部总经理，金贝塔网络金融科技（深圳）有限公司联席 CEO，嘉实基金管理有限公司董事总经理、指数及量化首席投资官、基金经理。现任汇泉基金管理有限公司首席量化投资官、基金经理兼任投资经理。
沈鑫	本基金的基金经理、量化投资部总监	2024-08-21	-	10 年	中国国籍，博士研究生，具有基金从业资格。曾任华西证券股份有限公司固定收益研究员、中国国际期货有限公司权益研究员、大家资产管理有限公司量化研究员、汇泉基金管理有限公司量化研究员。现任汇泉基金管理有限公司量化投资部总监、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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
杨宇	公募基金	5	196,695,958.51	2022-09-13
	私募资产管理计划	1	21,865,930.91	2025-08-08
	其他组合	-	-	-
	合计	6	218,561,889.42	-

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和私募资产管理计划等投资组合。

公司于每季度、每年度对旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率进行分析，对连续四个季度期间内不同时间窗下（日内、3日内、5日内、10日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现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，PMI 在荣枯线上下波动；CPI 同比为正， PPI 同比转正；离岸人民币升值 2.64%。海外方面，地区冲突不断，影响能源及贵金属价格。

上半年，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 上涨 20.97%，中证 1000 上涨 15.99%，中证 2000 上涨 9.10%，中盘股优于其他；国证成长上涨 19.18%，国证价值下跌 8.40%，成长股优于价值股。从

行业来看，中信一级行业中，电子、通信、建材、基础化工、机械、电力设备及新能源、煤炭、有色金属、电力及公用事业、计算机表现较好，消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔、商贸零售、传媒、食品饮料、汽车、钢铁、房地产表现较弱。

从上半年偏股基金整体表现来看，中证偏股基金指数上涨 22.19%，优于所有宽基指数。

报告期间，产品一直坚持按照系统化主动投资的思路运作：在行业配置层面，以偏股混合基金行业配置水平为中枢，根据行业配置模型，采取有限偏离，严格控制行业错配风险；在个股选择层面，通过多因子模型进行股票优选；在组合优化层面，根据风险偏好，在控制风险暴露的前提下，寻求超额收益与风险之间的最优化平衡。

本基金管理人将继续坚持系统化主动投资的运作思路，秉持勤勉尽责，力争为投资者获得有长期竞争力的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇泉匠心智选一年持有混合 A 基金份额净值为 1.4254 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 22.74%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%；截至报告期末汇泉匠心智选一年持有混合 C 基金份额净值为 1.3932 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 22.37%，同期业绩比较基准收益率为 5.82%。

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，宏观经济与证券市场或将在多重因素的交织中继续前行，整体呈现出一定的复杂性与动态演变特征。

从宏观经济来看，未来的运行轨迹可能会在多重力量的博弈中寻找新的平衡。一方面，部分领域的积极因素正在逐步积累，有望为整体运行提供一定支撑；另一方面，一些传统领域的调整仍在继续，其影响尚需时间消化。政策层面预计将保持一定的灵活性，根据实际运行情况进行相机抉择，以营造相对平稳的发展环境。总体来看，经济大概率将延续平稳运行的态势，但内部分化的格局可能仍会存在，新旧动能的转换也将是一个渐进的过程。

在证券市场方面，下半年的表现或将更多地体现出结构性特征，而非普涨或普跌的单边行情。市场情绪的波动可能会受到内外多种不确定因素的影响，导致指数在一定区间内反复震荡。从结构上看，资金可能会在不同板块间进行高低切换，寻找阶段性的机会。一些具备长期发展逻辑的方向，其内在价值可能会随着时间推移而逐步显现；同时，在市场波动加大的背景下，部分具备防御属性的资产也可能受到关注。总体而言，市场的定价逻辑或将更加多元，对投资者把握结构性机会的能力提出了更高要求。

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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本基金管理人设有估值委员会，负责对估值政策和程序进行定期评价和适时调整，指导和监督估值流程。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，具备基金估值运作、行业研究、风险管理和法律合规等领域的专业胜任能力。基金经理参与估值委员会会议，但不介入基金日常估值业务。

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金自 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日基金资产净值低于五千万元。按照监管规定，管理人已向中国证监会报告并提出解决方案。

§ 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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金

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	4,247,899.46	2,475,301.25
结算备付金		1,036.12	1,030.50
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	32,152,141.84	46,076,715.61
其中：股票投资		32,150,541.81	46,076,715.61
基金投资		-	-
债券投资		1,600.03	-
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		19,041.92	-
应收申购款		1,368.96	633.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		36,421,488.30	48,553,680.80
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产 款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		193,900.50	376,620.55
应付管理人报酬		33,549.24	51,880.64
应付托管费		5,591.53	8,646.74
应付销售服务费		1,646.50	2,936.22

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	47,375.68	110,000.00
负债合计		282,063.45	550,084.15
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	25,407,649.95	41,432,109.81
未分配利润	6.4.7.8	10,731,774.90	6,571,486.84
净资产合计		36,139,424.85	48,003,596.65
负债和净资产总计		36,421,488.30	48,553,680.80

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 25,407,649.95 份。其中汇泉匠心智选一年持有混合 A 基金份额净值 1.4254 元，基金份额总额 22,992,200.24 份；汇泉匠心智选一年持有混合 C 基金份额净值 1.3932 元，基金份额总额 2,415,449.71 份。

6.2 利润表

会计主体：汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金

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		7,905,487.71	8,226,367.08
1. 利息收入		2,554.45	20,486.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,554.45	20,486.93
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）		8,438,858.75	5,545,237.48
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,250,885.04	4,119,040.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	489.14	-63.09
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	187,484.57	1,426,260.21
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-535,925.49	2,660,642.67

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	-	-
减：二、营业总支出		330,079.94	1,011,600.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	229,747.35	756,860.16
2. 托管费	6.4.10.2.2	38,291.16	126,143.30
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	13,249.85	47,258.91
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.18	48,791.58	81,338.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		7,575,407.77	7,214,766.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,575,407.77	7,214,766.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,575,407.77	7,214,766.41

6.3 净资产变动表

会计主体：汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金

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	41,432,109.81	6,571,486.84	48,003,596.65
二、本期期初净资产	41,432,109.81	6,571,486.84	48,003,596.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,024,459.86	4,160,288.06	-11,864,171.80
（一）、综合收益总额	-	7,575,407.77	7,575,407.77
（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）	-16,024,459.86	-3,415,119.71	-19,439,579.57
其中：1. 基金申购款	835,524.09	225,283.42	1,060,807.51
2. 基金赎回款	-16,859,983.95	-3,640,403.13	-20,500,387.08
（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	25,407,649.95	10,731,774.90	36,139,424.85
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	147,030,549.92	-14,093,640.96	132,936,908.96
二、本期期初净资产	147,030,549.92	-14,093,640.96	132,936,908.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-16,310,540.48	8,469,158.99	-7,841,381.49
（一）、综合收益总额	-	7,214,766.41	7,214,766.41
（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）	-16,310,540.48	1,254,392.58	-15,056,147.90
其中：1. 基金申购款	198,232.25	-19,040.65	179,191.60
2. 基金赎回款	-16,508,772.73	1,273,433.23	-15,235,339.50
（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	130,720,009.44	-5,624,481.97	125,095,527.47

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：

梁永强	陈磊	陈磊
_____	_____	_____
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

汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1169 号《关于准予汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》注册，由汇泉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《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 228,444,852.09 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0760 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 13 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 228,565,471.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 120,619.59 份基金份额。本基金的基金管理人为汇泉基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金对于每份基金份额设定一年(一年按 365 天计算)最短持有期限，投资者认购或申购、转换转入基金份额后，自基金合同生效日或申购、转换转入确认日起一年内不得赎回或转换转出。

根据《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金将基金份额分为不

同的类别。在投资人认购/申购基金时收取认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费，并不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金两类基金份额分别设置代码，分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉匠心智选一年持有期混合型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(含主板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人将在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的 0%-50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率×65%+中证港股通综合指数(人民币)收益率×10%+一年期定期存款利率(税后)×25%。

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》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 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

本基金 2026 年度中期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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部、国家税务总局、证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会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]127 号《财政部、国家税务总局、证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56 号《财政部、税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《财政部、税务总局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、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《财政部 税务总局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。

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，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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 06 月 30 日
活期存款	2,489.52
等于：本金	2,488.86
加：应计利息	0.66
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	4,245,409.94
等于：本金	4,245,265.65
加：应计利息	144.29
减：坏账准备	-
合计	4,247,899.46

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 06 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		27,376,563.77	-	32,150,541.81	4,773,978.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,600.00	0.03	1,600.03	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,600.00	0.03	1,600.03	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		27,378,163.77	0.03	32,152,141.84	4,773,978.04

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

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

无。

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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	47,110.68
其他应付	265.00
合计	47,375.68

6.4.7.7 实收基金

汇泉匠心智选一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,517,715.29	36,517,715.29
本期申购	751,885.15	751,885.15
本期赎回（以“-”号填列）	-14,277,400.20	-14,277,400.20
本期末	22,992,200.24	22,992,200.24

汇泉匠心智选一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,914,394.52	4,914,394.52
本期申购	83,638.94	83,638.94
本期赎回（以“-”号填列）	-2,582,583.75	-2,582,583.75
本期末	2,415,449.71	2,415,449.71

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

汇泉匠心智选一年持有混合 A

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	6,812,860.50	-922,155.36	5,890,705.14
本期期初	6,812,860.50	-922,155.36	5,890,705.14
本期利润	7,212,330.52	-426,464.30	6,785,866.22
本期基金份额交易产生的变动数	-3,694,048.37	799,387.13	-2,894,661.24
其中：基金申购款	221,853.59	-11,584.98	210,268.61
基金赎回款	-3,915,901.96	810,972.11	-3,104,929.85
本期已分配利润	-	-	-

本期末	10,331,142.65	-549,232.53	9,781,910.12
-----	---------------	-------------	--------------

汇泉匠心智选一年持有混合 C

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	801,179.09	-120,397.39	680,781.70
本期期初	801,179.09	-120,397.39	680,781.70
本期利润	899,002.74	-109,461.19	789,541.55
本期基金份额交易产生的变动数	-693,790.22	173,331.75	-520,458.47
其中：基金申购款	21,881.14	-6,866.33	15,014.81
基金赎回款	-715,671.36	180,198.08	-535,473.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,006,391.61	-56,526.83	949,864.78

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	24.17
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,524.66
结算备付金利息收入	5.62
其他	-
合计	2,554.45

注：其他存款利息收入所列金额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金的利息收入。

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	154,578,900.08
减：卖出股票成本总额	146,103,863.90
减：交易费用	224,151.14
买卖股票差价收入	8,250,885.04

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	0.12

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	489.02
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	489.14

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	1,290.40
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	800.00
减：应计利息总额	0.09
减：交易费用	1.29
买卖债券差价收入	489.02

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

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	187,484.57
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	187,484.57

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	-535,925.49

——股票投资	-535,925.49
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-535,925.49

6.4.7.17 其他收入

无。

6.4.7.18 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	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,491.33
证券组合费	179.81
存托服务费	9.76
合计	48,791.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

关联方名称	与本基金的关系
汇泉基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	基金托管人、基金销售机构

杨宇	基金管理人股东
梁永强	基金管理人股东
孟朝霞	基金管理人股东
柴功	基金管理人股东
上海沛泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海澹泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
北京溪泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

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 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管理费	229,747.35	756,860.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	114,760.77	377,592.51
应支付基金管理人的净管理费	114,986.58	379,267.65

注：支付基金管理人汇泉基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费

率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.20%/ 当年天数。

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	38,291.16	126,143.30

注：支付基金托管人农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 × 0.20%/ 当年天数。

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		
	汇泉匠心智选一年持有 混合 A	汇泉匠心智选一年持有 混合 C	合计
汇泉基金管理有限公司	-	4.14	4.14
农业银行	-	10,589.80	10,589.80
合计	-	10,593.94	10,593.94
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		
	汇泉匠心智选一年持有 混合 A	汇泉匠心智选一年持有 混合 C	合计
汇泉基金管理有限公司	-	36.76	36.76
农业银行	-	36,604.71	36,604.71
合计	-	36,641.47	36,641.47

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。

其计算公式为：日销售服务费=前一日 C 类基金份额的基金资产净值×0.60%/ 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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
无。

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
无。

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

汇泉匠心智选一年持有混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基 金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基 金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
杨宇	98.84	0.00%	98.84	0.00%

汇泉匠心智选一年持有混合 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基 金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的基金份 额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
杨宇	-	-	1,000,333.33	20.36%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书的规定费率执行。持有的基金份额占基金总份额的比例四舍五入保留至小数点后 4 位。

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
农业银行	2,489.52	24.17	353,740.88	283.39

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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
无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026 年 06 月 23 日	-	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.02	-
127114	宣化转债	2026 年 06 月 26 日	6 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	6	600.00	600.01	-

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
01755	新城悦服务	2025-04-01	-	2.43	-	-	2,000	12,721.84	4,863.88	-
688072	拓荆	2026-06-29	-	879.53	2026-07-13	890.99	600	289,437.60	527,718.00	-

	科 技									
--	--------	--	--	--	--	--	--	--	--	--

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

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

本基金是混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导合规风控工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人农业银行，其他存款存放于恒泰证券股份有限公司（2025 年 9 月 9 日更名为金融街证券股份有限公司）、国新证券股份有限公司、中信证券股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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	1,600.03	-
未评级	-	-
合计	1,600.03	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于锁定期届满后要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投

资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 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(净资产)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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于本报告期末，本基金持有流动性受限资产的比例符合上述要求。

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

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

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未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金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。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,247,899.46	-	-	-	4,247,899.46
结算备付金	1,036.12	-	-	-	1,036.12
交易性金融资产	-	-	1,600.03	32,150,541.81	32,152,141.84
应收股利	-	-	-	19,041.92	19,041.92
应收申购款	-	-	-	1,368.96	1,368.96
资产总计	4,248,935.58	-	1,600.03	32,170,952.69	36,421,488.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	193,900.50	193,900.50
应付管理人报酬	-	-	-	33,549.24	33,549.24
应付托管费	-	-	-	5,591.53	5,591.53
应付销售服务费	-	-	-	1,646.50	1,646.50
其他负债	-	-	-	47,375.68	47,375.68
负债总计	-	-	-	282,063.45	282,063.45
利率敏感度缺口	4,248,935.58	-	1,600.03	31,888,889.24	36,139,424.85
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	2,475,301.25	-	-	-	2,475,301.25
结算备付金	1,030.50	-	-	-	1,030.50
交易性金融资产	-	-	-	46,076,715.61	46,076,715.61

应收申购款	-	-	-	633.44	633.44
资产总计	2,476,331.75	-	-	46,077,349.05	48,553,680.80
负债					
应付赎回款	-	-	-	376,620.55	376,620.55
应付管理人报酬	-	-	-	51,880.64	51,880.64
应付托管费	-	-	-	8,646.74	8,646.74
应付销售服务费	-	-	-	2,936.22	2,936.22
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	550,084.15	550,084.15
利率敏感度缺口	2,476,331.75	-	-	45,527,264.90	48,003,596.65

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

于 2026 年 6 月 30 日,本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2025 年 12 月 31 日:本本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资),因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025 年 12 月 31 日:同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产,因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	2,721,118.51	-	2,721,118.51
应收股利	-	19,041.92	-	19,041.92
资产合计	-	2,740,160.43	-	2,740,160.43
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	2,740,160.43	-	2,740,160.43
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计

以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	6,871,484.59	-	6,871,484.59
资产合计	-	6,871,484.59	-	6,871,484.59
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	6,871,484.59	-	6,871,484.59

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	-	343,574.23
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-	-343,574.23

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在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的 0%-50%)。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	32,150,541.81	88.96	46,076,715.61	95.99
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	32,150,541.81	88.96	46,076,715.61	95.99

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数收益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 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 中证 800 指数收益率上升 5%	2,273,187.76	2,498,514.48
	2. 中证 800 指数收益率下降 5%	-2,273,187.76	-2,498,514.48

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	31,617,959.93	45,474,758.58
第二层次	534,181.91	601,957.03
第三层次	—	—
合计	32,152,141.84	46,076,715.61

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证券，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证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，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，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

无。

§ 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	32,150,541.81	88.27
	其中：股票	32,150,541.81	88.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,600.03	0.00
	其中：债券	1,600.03	0.00
	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	4,248,935.58	11.67
8	其他各项资产	20,410.88	0.06
9	合计	36,421,488.30	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 2,721,118.51 元，占净值比例

7.53%。

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	-	-
B	采矿业	1,394,873.80	3.86
C	制造业	25,201,740.00	69.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,668.00	0.00
F	批发和零售业	306,632.00	0.85
G	交通运输、仓储和邮政业	351,457.00	0.97
H	住宿和餐饮业	21,884.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,689,333.50	4.67
J	金融业	3,452.00	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	124,865.00	0.35
M	科学研究和技术服务业	280,026.00	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	12,468.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,569.00	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	37,455.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	29,429,423.30	81.43

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	460,861.32	1.28
非日常生活消费品	662,912.10	1.83
能源	88,244.68	0.24
金融	180,536.80	0.50
医疗保健	105,181.41	0.29
信息技术	288,935.32	0.80
通讯业务	929,583.00	2.57
房地产	4,863.88	0.01
合计	2,721,118.51	7.53

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	300308	中际旭创	1,400	1,778,000.00	4.92
2	300502	新易盛	2,520	1,529,640.00	4.23
3	688498	源杰科技	670	1,263,620.00	3.50
4	002384	东山精密	4,500	1,180,575.00	3.27
5	603986	兆易创新	900	733,500.00	2.03
6	300750	宁德时代	1,600	628,816.00	1.74
7	00700	腾讯控股	1,600	597,284.46	1.65
8	601899	紫金矿业	15,700	394,698.00	1.09
8	02899	紫金矿业	8,000	190,386.16	0.53
9	688072	拓荆科技	600	527,718.00	1.46
10	688012	中微公司	1,086	508,791.00	1.41
11	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.32
12	600487	亨通光电	4,200	459,228.00	1.27
13	002916	深南电路	1,000	457,900.00	1.27
14	600183	生益科技	2,400	416,160.00	1.15
15	688120	华海清科	1,200	386,616.00	1.07
16	300604	长川科技	1,100	375,562.00	1.04
17	002463	沪电股份	2,200	336,160.00	0.93
18	301377	鼎泰高科	600	330,540.00	0.91
19	688008	澜起科技	1,000	309,900.00	0.86
20	600522	中天科技	5,100	309,468.00	0.86
21	688525	佰维存储	600	296,838.00	0.82
22	001309	德明利	300	282,870.00	0.78
23	300476	胜宏科技	800	277,144.00	0.77
24	01818	招金矿业	19,000	270,475.16	0.75
25	300475	香农芯创	900	270,000.00	0.75
26	09992	泡泡玛特	2,000	268,729.37	0.74
27	002080	中材科技	2,800	252,000.00	0.70
28	605117	德业股份	2,360	250,584.80	0.69
29	688002	睿创微纳	1,600	247,504.00	0.68
30	688019	安集科技	720	244,411.20	0.68
31	03690	美团-W	4,050	240,957.48	0.67
32	688652	京仪装备	1,200	240,204.00	0.66
33	01024	快手-W	6,300	227,629.58	0.63
34	688372	伟测科技	1,200	223,200.00	0.62
35	002738	中矿资源	3,700	218,263.00	0.60
36	300394	天孚通信	700	211,876.00	0.59
37	301308	江波龙	300	211,140.00	0.58
38	300438	鹏辉能源	2,500	207,125.00	0.57
39	002709	天赐材料	4,000	205,720.00	0.57

40	002484	江海股份	1,900	199,500.00	0.55
41	002273	水晶光电	5,500	195,140.00	0.54
42	000933	神火股份	9,200	195,040.00	0.54
43	601138	工业富联	2,700	194,805.00	0.54
44	603659	璞泰来	6,700	193,831.00	0.54
45	300277	汽轮科技	12,500	188,000.00	0.52
46	688025	杰普特	400	188,000.00	0.52
47	300661	圣邦股份	1,300	186,524.00	0.52
48	600938	中国海油	3,500	95,025.00	0.26
48	00883	中国海洋石油	5,000	88,244.68	0.24
49	301358	湖南裕能	2,400	182,088.00	0.50
50	601231	环旭电子	5,600	181,440.00	0.50
51	600711	盛屯矿业	16,500	181,005.00	0.50
52	03958	东方证券	38,000	180,536.80	0.50
53	688531	日联科技	1,000	177,840.00	0.49
54	002371	北方华创	200	176,912.00	0.49
55	000975	山金国际	10,400	176,800.00	0.49
56	300274	阳光电源	1,100	174,922.00	0.48
57	688234	天岳先进	1,000	173,510.00	0.48
58	688361	中科飞测	400	172,000.00	0.48
59	688388	嘉元科技	3,880	170,720.00	0.47
60	603699	纽威股份	3,300	165,990.00	0.46
61	001267	汇绿生态	3,100	165,850.00	0.46
62	601126	四方股份	2,600	164,320.00	0.45
63	000408	藏格矿业	2,300	159,436.00	0.44
64	688183	生益电子	1,200	158,880.00	0.44
65	300567	精测电子	500	158,800.00	0.44
66	603606	东方电缆	3,800	157,738.00	0.44
67	00981	中芯国际	2,000	155,296.74	0.43
68	09988	阿里巴巴-W	1,900	153,225.25	0.42
69	688041	海光信息	400	148,120.00	0.41
70	002475	立讯精密	2,100	147,840.00	0.41
71	000100	TCL 科技	25,300	147,246.00	0.41
72	600549	厦门钨业	1,700	144,840.00	0.40
73	002353	杰瑞股份	900	137,250.00	0.38
74	603256	宏和科技	500	132,665.00	0.37
75	688205	德科立	600	124,914.00	0.35
76	300757	罗博特科	200	123,800.00	0.34
77	688052	纳芯微	400	115,324.00	0.32
78	000425	徐工机械	13,700	110,833.00	0.31
79	00941	中国移动	1,000	66,140.08	0.18
79	600941	中国移动	500	43,065.00	0.12
80	02269	药明生物	3,500	105,181.41	0.29

81	002028	思源电气	600	103,800.00	0.29
82	002602	世纪华通	6,800	95,880.00	0.27
83	600309	万华化学	1,400	95,774.00	0.27
84	300953	震裕科技	700	93,590.00	0.26
85	688279	峰昭科技	400	89,776.00	0.25
86	688037	芯源微	200	87,810.00	0.24
87	000426	兴业银锡	2,600	85,696.00	0.24
88	02382	舜宇光学科技	1,600	84,770.48	0.23
89	688503	聚和材料	600	79,620.00	0.22
90	000703	恒逸石化	5,700	77,349.00	0.21
91	601872	招商轮船	4,100	72,037.00	0.20
92	000630	铜陵有色	11,200	71,232.00	0.20
93	688486	龙迅股份	1,120	71,209.60	0.20
94	688206	概伦电子	1,600	70,992.00	0.20
95	002379	宏桥控股	4,700	69,419.00	0.19
96	601898	中煤能源	5,600	68,208.00	0.19
97	605060	联德股份	1,200	68,088.00	0.19
98	603799	华友钴业	1,400	67,564.00	0.19
99	688172	燕东微	800	66,928.00	0.19
100	300408	三环集团	400	66,760.00	0.18
101	002444	巨星科技	2,100	65,310.00	0.18
102	688778	厦钨新能	1,200	65,280.00	0.18
103	688257	新锐股份	640	65,216.00	0.18
104	002222	福晶科技	700	64,596.00	0.18
105	600426	华鲁恒升	2,700	64,584.00	0.18
106	301536	星宸科技	500	64,355.00	0.18
107	601208	东材科技	900	63,711.00	0.18
108	603993	洛阳钼业	3,600	63,180.00	0.17
109	002271	东方雨虹	5,300	62,911.00	0.17
110	688678	福立旺	2,600	62,842.00	0.17
111	688472	阿特斯	5,800	62,756.00	0.17
112	300850	新强联	2,300	61,640.00	0.17
113	688158	优刻得	1,600	58,816.00	0.16
114	000682	东方电子	4,600	58,098.00	0.16
115	002487	大金重工	1,000	57,970.00	0.16
116	300772	运达股份	4,700	57,810.00	0.16
117	689009	九号公司	1,500	57,225.00	0.16
118	300012	华测检测	4,100	56,826.00	0.16
119	688210	统联精密	1,400	56,714.00	0.16
120	603893	瑞芯微	300	56,508.00	0.16
121	000811	冰轮环境	1,000	56,220.00	0.16
122	000880	潍柴重机	2,400	55,224.00	0.15
123	002558	巨人网络	2,000	55,120.00	0.15

124	688475	萤石网络	2,000	54,700.00	0.15
125	601869	长飞光纤	100	54,590.00	0.15
126	688190	云路股份	600	54,426.00	0.15
127	600029	南方航空	10,400	53,872.00	0.15
128	301031	中熔电气	444	53,035.80	0.15
129	002468	申通快递	3,600	52,416.00	0.15
130	300866	安克创新	500	52,250.00	0.14
131	600221	海航控股	38,700	52,245.00	0.14
132	603530	神马电力	1,000	50,900.00	0.14
133	600989	宝丰能源	2,500	50,825.00	0.14
134	603626	科森科技	2,700	49,950.00	0.14
135	688220	翱捷科技	400	49,728.00	0.14
136	002466	天齐锂业	800	49,056.00	0.14
137	688300	联瑞新材	200	48,880.00	0.14
138	01810	小米集团-W	2,600	48,868.10	0.14
139	300684	中石科技	800	48,800.00	0.14
140	688258	卓易信息	400	47,416.00	0.13
141	002027	分众传媒	9,500	45,980.00	0.13
142	002922	伊戈尔	1,400	45,920.00	0.13
143	600499	科达制造	3,300	45,540.00	0.13
144	688392	骄成超声	200	45,436.00	0.13
145	603296	华勤技术	600	44,562.00	0.12
146	000807	云铝股份	2,000	44,280.00	0.12
147	300693	盛弘股份	900	43,875.00	0.12
148	603100	川仪股份	2,400	43,320.00	0.12
149	688111	金山办公	200	42,610.00	0.12
150	002250	联化科技	3,100	42,377.00	0.12
151	603268	松发股份	300	41,784.00	0.12
152	300814	中富电路	200	40,900.00	0.11
153	688208	道通科技	1,600	40,304.00	0.11
154	600875	东方电气	1,400	40,278.00	0.11
155	688059	华锐精密	200	39,942.00	0.11
156	688127	蓝特光学	400	39,040.00	0.11
157	001203	大中矿业	1,300	38,935.00	0.11
158	600961	株冶集团	1,200	38,868.00	0.11
159	03888	金山软件	2,000	38,528.88	0.11
160	300389	艾比森	3,000	38,460.00	0.11
161	600563	法拉电子	200	38,160.00	0.11
162	600141	兴发集团	800	37,576.00	0.10
163	002518	科士达	700	37,513.00	0.10
164	600301	华锡有色	600	36,792.00	0.10
165	603444	吉比特	100	35,842.00	0.10
166	688088	虹软科技	1,000	35,550.00	0.10

167	300451	创业慧康	11,100	35,520.00	0.10
168	000301	东方盛虹	3,100	35,495.00	0.10
169	000762	西藏矿业	1,300	34,710.00	0.10
170	300153	科泰电源	1,500	33,930.00	0.09
171	300073	当升科技	700	33,628.00	0.09
172	600801	华新建材	2,100	32,760.00	0.09
173	688155	先惠技术	400	32,356.00	0.09
174	603162	海通发展	3,600	32,292.00	0.09
175	601058	赛轮轮胎	2,800	32,284.00	0.09
176	000932	华菱钢铁	9,200	31,924.00	0.09
177	300373	扬杰科技	200	31,446.00	0.09
178	002324	普利特	2,600	31,382.00	0.09
179	688518	联赢激光	1,000	30,900.00	0.09
180	002415	海康威视	900	30,780.00	0.09
181	601225	陕西煤业	1,500	30,525.00	0.08
182	301606	绿联科技	500	30,510.00	0.08
183	600259	中稀有色	300	30,483.00	0.08
184	002074	国轩高科	1,100	30,261.00	0.08
185	603297	永新光学	200	29,390.00	0.08
186	600389	江山股份	1,500	29,280.00	0.08
187	603663	三祥新材	300	28,890.00	0.08
188	002796	世嘉科技	700	28,546.00	0.08
189	002192	融捷股份	300	26,820.00	0.07
190	002478	常宝股份	4,300	26,574.00	0.07
191	002318	久立特材	1,100	26,290.00	0.07
192	002545	东方铁塔	1,600	25,952.00	0.07
193	601699	潞安环能	1,800	25,704.00	0.07
194	300302	同有科技	500	25,585.00	0.07
195	600019	宝钢股份	4,700	25,521.00	0.07
196	600583	海油工程	5,000	25,150.00	0.07
197	002716	湖南白银	3,100	25,079.00	0.07
198	603871	嘉友国际	2,300	23,483.00	0.06
199	603067	振华股份	500	23,145.00	0.06
200	002396	星网锐捷	1,200	23,004.00	0.06
201	688615	合合信息	200	22,620.00	0.06
202	601877	正泰电器	900	22,563.00	0.06
203	002138	顺络电子	300	21,930.00	0.06
204	000973	佛塑科技	1,500	21,525.00	0.06
205	601888	中国中免	400	21,484.00	0.06
206	600153	建发股份	2,700	21,411.00	0.06
207	688499	利元亨	400	21,020.00	0.06
208	002683	广东宏大	700	20,503.00	0.06
209	688720	艾森股份	200	20,200.00	0.06

210	002345	潮宏基	2,200	20,174.00	0.06
211	300681	英搏尔	700	20,034.00	0.06
212	603999	读者传媒	4,000	20,000.00	0.06
213	003010	若羽臣	800	19,440.00	0.05
214	603920	世运电路	400	19,216.00	0.05
215	002155	湖南黄金	800	19,096.00	0.05
216	688169	石头科技	200	18,994.00	0.05
217	688049	炬芯科技	400	18,764.00	0.05
218	300727	润禾材料	500	18,710.00	0.05
219	300390	天华新能	200	18,702.00	0.05
220	600595	中孚实业	3,300	18,546.00	0.05
221	000988	华工科技	100	18,461.00	0.05
222	605016	百龙创园	700	18,095.00	0.05
223	002064	华峰化学	1,900	18,031.00	0.05
224	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.05
225	603737	三棵树	740	17,834.00	0.05
226	600262	北方股份	900	17,811.00	0.05
227	300731	科创新源	300	17,508.00	0.05
228	603338	浙江鼎力	400	17,000.00	0.05
229	688717	艾罗能源	200	16,514.00	0.05
230	688569	铁科轨道	1,000	16,150.00	0.04
231	600819	耀皮玻璃	2,500	15,950.00	0.04
232	301316	慧博云通	400	15,752.00	0.04
233	601333	广深铁路	5,700	15,675.00	0.04
234	600258	首旅酒店	1,400	15,288.00	0.04
235	000949	新乡化纤	2,400	15,216.00	0.04
236	603379	三美股份	200	15,178.00	0.04
237	600315	上海家化	900	15,138.00	0.04
238	002008	大族激光	100	15,011.00	0.04
239	688337	普源精电	200	14,986.00	0.04
240	603619	中曼石油	800	14,968.00	0.04
241	603298	杭叉集团	600	14,316.00	0.04
242	688599	天合光能	1,000	14,120.00	0.04
243	603991	领先股份	100	14,115.00	0.04
244	688113	联测科技	400	14,040.00	0.04
245	002533	金杯电工	1,300	13,871.00	0.04
246	300852	四会富仕	200	13,848.00	0.04
247	300058	蓝色光标	1,000	13,760.00	0.04
248	000683	博源化工	2,300	13,248.00	0.04
249	600415	小商品城	1,200	12,192.00	0.03
250	688309	恒誉环保	200	12,176.00	0.03
251	301085	亚康股份	200	12,122.00	0.03
252	688295	中复神鹰	200	12,108.00	0.03

253	300316	晶盛机电	200	12,080.00	0.03
254	300490	华自科技	900	11,907.00	0.03
255	001872	招商港口	600	11,658.00	0.03
256	601038	一拖股份	1,100	11,649.00	0.03
257	688209	英集芯	400	11,632.00	0.03
258	300169	天晟新材	2,300	11,477.00	0.03
259	000039	中集集团	1,400	11,354.00	0.03
260	601107	四川成渝	2,300	11,224.00	0.03
261	002204	大连重工	2,100	11,088.00	0.03
262	002801	微光股份	400	11,040.00	0.03
263	001277	速达股份	400	11,036.00	0.03
264	603031	安孚科技	200	10,650.00	0.03
265	300700	岱勒新材	500	10,640.00	0.03
266	300515	三德科技	800	10,440.00	0.03
267	000902	新洋丰	900	10,404.00	0.03
268	301032	新柴股份	1,100	10,230.00	0.03
269	300743	天地数码	700	10,213.00	0.03
270	600150	中国船舶	300	10,137.00	0.03
271	002378	章源钨业	300	10,044.00	0.03
272	600028	中国石化	2,200	9,812.00	0.03
273	301121	紫建电子	300	9,606.00	0.03
274	300503	昊志机电	100	9,230.00	0.03
275	603187	海容冷链	800	9,192.00	0.03
276	688577	浙海德曼	200	9,166.00	0.03
277	300842	帝科股份	100	8,917.00	0.02
278	300098	高新兴	1,900	8,721.00	0.02
279	603855	华荣股份	500	8,665.00	0.02
280	000589	贵州轮胎	2,100	8,526.00	0.02
281	600063	皖维高新	1,100	8,360.00	0.02
282	688568	中科星图	200	8,294.00	0.02
283	002601	龙佰集团	500	8,240.00	0.02
284	300619	金银河	260	8,088.60	0.02
285	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.02
286	603969	银龙股份	1,100	7,997.00	0.02
287	605196	华通线缆	300	7,830.00	0.02
288	300610	晨化股份	800	7,800.00	0.02
289	601811	新华文轩	700	7,658.00	0.02
290	600704	物产中大	1,600	7,552.00	0.02
291	002006	精工科技	500	7,355.00	0.02
292	603337	杰克科技	200	7,246.00	0.02
293	603045	福达合金	100	7,139.00	0.02
294	002648	卫星化学	300	7,047.00	0.02
295	002315	焦点科技	300	6,984.00	0.02

296	688148	芳源股份	800	6,864.00	0.02
297	002033	丽江股份	800	6,608.00	0.02
298	002236	大华股份	400	6,596.00	0.02
299	000828	东莞控股	700	6,552.00	0.02
300	002410	广联达	800	6,528.00	0.02
301	300321	同大股份	100	6,438.00	0.02
302	002587	奥拓电子	800	6,248.00	0.02
303	600096	云天化	200	6,080.00	0.02
304	301026	浩通科技	300	6,066.00	0.02
305	601002	晋亿实业	1,400	6,048.00	0.02
306	000830	鲁西化工	500	6,000.00	0.02
307	688203	海正生材	600	5,988.00	0.02
308	301578	辰奕智能	290	5,913.10	0.02
309	300487	蓝晓科技	100	5,885.00	0.02
310	300413	芒果超媒	400	5,852.00	0.02
311	002895	川恒股份	200	5,840.00	0.02
312	688570	天玛智控	400	5,692.00	0.02
313	301381	赛维时代	300	5,532.00	0.02
314	688152	麒麟信安	200	5,496.00	0.02
315	301073	君亭酒店	300	5,460.00	0.02
316	300278	华昌达	1,400	5,432.00	0.02
317	002170	芭田股份	500	5,430.00	0.02
318	300407	凯发电气	500	5,400.00	0.01
319	000612	焦作万方	500	5,295.00	0.01
320	002195	岩山科技	800	5,232.00	0.01
321	603236	移远通信	100	5,117.00	0.01
322	002652	扬子新材	1,200	5,112.00	0.01
323	603486	科沃斯	100	5,075.00	0.01
324	301608	博实结	100	5,026.00	0.01
325	001266	宏英智能	100	4,910.00	0.01
326	01755	新城悦服务	2,000	4,863.88	0.01
327	603260	合盛硅业	100	4,826.00	0.01
328	600894	广日股份	600	4,572.00	0.01
329	600273	嘉化能源	700	4,564.00	0.01
330	600808	马钢股份	1,800	4,500.00	0.01
331	603966	法兰泰克	550	4,482.50	0.01
332	603790	雅运股份	200	4,268.00	0.01
333	301149	隆华新材	400	4,232.00	0.01
334	601728	中国电信	800	4,152.00	0.01
335	002230	科大讯飞	100	4,084.00	0.01
336	300921	南凌科技	200	4,062.00	0.01
337	300418	昆仑万维	100	4,036.00	0.01
338	300415	伊之密	200	3,982.00	0.01

339	002753	永东股份	700	3,955.00	0.01
340	603072	天和磁材	100	3,920.00	0.01
341	600348	华阳股份	500	3,825.00	0.01
342	300230	永利股份	900	3,780.00	0.01
343	000923	河钢资源	300	3,723.00	0.01
344	603193	润本股份	200	3,710.00	0.01
345	000937	冀中能源	910	3,621.80	0.01
346	000888	峨眉山 A	400	3,576.00	0.01
347	300133	华策影视	500	3,540.00	0.01
348	002841	视源股份	100	3,453.00	0.01
349	601519	大智慧	400	3,452.00	0.01
350	002376	新北洋	600	3,450.00	0.01
351	603111	康尼机电	600	3,396.00	0.01
352	300446	航天智造	200	3,366.00	0.01
353	600787	中储股份	800	3,344.00	0.01
354	601595	上海电影	200	3,320.00	0.01
355	001316	润贝航科	100	3,298.00	0.01
356	603507	振江股份	100	3,289.00	0.01
357	300737	科顺股份	500	3,285.00	0.01
358	000020	深华发 A	300	3,270.00	0.01
359	001391	国货航	800	3,256.00	0.01
360	600623	华谊集团	400	3,228.00	0.01
361	600717	天津港	800	3,112.00	0.01
362	300041	回天新材	200	3,108.00	0.01
363	002206	海利得	600	3,102.00	0.01
364	002115	三维通信	300	3,090.00	0.01
365	002838	道恩股份	100	3,062.00	0.01
366	000089	深圳机场	500	3,015.00	0.01
367	603310	巍华新材	200	2,938.00	0.01
368	603466	风语筑	300	2,937.00	0.01
369	600897	厦门空港	200	2,920.00	0.01
370	603970	中农立华	300	2,889.00	0.01
371	600738	丽尚国潮	800	2,880.00	0.01
372	301516	中远通	200	2,830.00	0.01
373	600397	江钨装备	100	2,723.00	0.01
374	600694	大商股份	200	2,646.00	0.01
375	603708	家家悦	300	2,574.00	0.01
376	600125	铁龙物流	500	2,535.00	0.01
377	000626	远大控股	400	2,532.00	0.01
378	600361	创新新材	700	2,520.00	0.01
379	002591	恒大高新	400	2,448.00	0.01
380	600861	北京人力	200	2,440.00	0.01
381	000717	中南股份	1,200	2,412.00	0.01

382	002627	三峡旅游	400	2,284.00	0.01
383	300228	富瑞特装	300	2,220.00	0.01
384	002043	兔宝宝	200	2,216.00	0.01
385	603602	纵横通信	200	2,204.00	0.01
386	601069	西部黄金	100	2,200.00	0.01
387	600936	北投科技	500	2,150.00	0.01
388	603508	思维列控	100	2,136.00	0.01
389	000599	青岛双星	500	2,110.00	0.01
390	600661	昂立教育	300	2,073.00	0.01
391	300738	奥飞数据	100	2,022.00	0.01
392	688616	西力科技	200	2,020.00	0.01
393	600618	氯碱化工	200	2,010.00	0.01
394	600925	苏能股份	500	2,005.00	0.01
395	300213	佳讯飞鸿	300	1,818.00	0.01
396	300281	金明精机	300	1,809.00	0.01
397	003012	东鹏控股	400	1,744.00	0.00
398	300043	星辉娱乐	400	1,740.00	0.00
399	300986	志特新材	100	1,715.00	0.00
400	603382	海阳科技	100	1,715.00	0.00
401	300662	科锐国际	100	1,698.00	0.00
402	000629	钒钛股份	500	1,670.00	0.00
403	002163	海南发展	200	1,668.00	0.00
404	000990	诚志股份	200	1,636.00	0.00
405	601311	骆驼股份	200	1,558.00	0.00
406	002659	凯文教育	400	1,496.00	0.00
407	300805	电声股份	200	1,450.00	0.00
408	301011	华立科技	100	1,414.00	0.00
409	603227	雪峰科技	200	1,404.00	0.00
410	605599	莱百股份	100	1,370.00	0.00
411	000737	北方铜业	100	1,322.00	0.00
412	600425	青松建化	400	1,308.00	0.00
413	600230	沧州大化	100	1,302.00	0.00
414	000708	中信特钢	100	1,262.00	0.00
415	000420	吉林化纤	300	1,215.00	0.00
416	300008	天海防务	200	1,212.00	0.00
417	605108	同庆楼	100	1,136.00	0.00
418	000554	泰山石油	200	1,122.00	0.00
419	601101	昊华能源	100	1,056.00	0.00
420	600650	锦江在线	100	964.00	0.00
421	002632	道明光学	100	901.00	0.00
422	002416	爱施德	100	896.00	0.00
423	601360	三六零	100	869.00	0.00
424	603167	渤海轮渡	100	857.00	0.00

425	300795	米奥会展	100	856.00	0.00
426	600050	中国联通	200	800.00	0.00
427	002153	石基信息	100	723.00	0.00
428	002292	奥飞娱乐	100	656.00	0.00
429	600725	云维股份	200	618.00	0.00
430	300050	世纪鼎利	100	592.00	0.00
431	002148	北纬科技	100	581.00	0.00
432	002381	双箭股份	100	518.00	0.00
433	000906	浙商中拓	100	504.00	0.00
434	000570	苏常柴 A	100	467.00	0.00
435	600968	海油发展	100	333.00	0.00
436	002523	天桥起重	100	298.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	3,421,055.00	7.13
2	300502	新易盛	2,889,966.00	6.02
3	600120	浙江东方	2,392,399.00	4.98
4	002080	中材科技	1,531,896.00	3.19
5	300750	宁德时代	1,448,188.00	3.02
6	002414	高德红外	1,192,227.00	2.48
7	002311	海大集团	1,066,917.00	2.22
8	688498	源杰科技	1,009,600.00	2.10
9	002318	久立特材	999,970.00	2.08
10	002384	东山精密	965,542.00	2.01
11	600183	生益科技	958,294.00	2.00
12	300498	温氏股份	940,871.00	1.96
13	000932	华菱钢铁	906,257.00	1.89
14	688120	华海清科	900,538.00	1.88
15	002179	中航光电	900,517.00	1.88
16	603986	兆易创新	893,960.00	1.86
17	601601	中国太保	884,179.00	1.84
18	300476	胜宏科技	854,412.00	1.78
19	601336	新华保险	854,313.00	1.78
20	600030	中信证券	846,003.00	1.76

注：本项的“买入金额”按买入成交金额（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	300308	中际旭创	3,401,387.00	7.09
2	300502	新易盛	2,902,622.00	6.05
3	600120	浙江东方	2,428,920.00	5.06
4	300750	宁德时代	2,060,026.00	4.29
5	603986	兆易创新	1,392,881.00	2.90
6	002414	高德红外	1,368,464.00	2.85
7	600183	生益科技	1,360,623.00	2.83
8	002080	中材科技	1,334,077.00	2.78
9	002311	海大集团	1,244,017.00	2.59
10	300476	胜宏科技	1,227,966.00	2.56
11	688256	寒武纪	1,090,274.50	2.27
12	688498	源杰科技	929,461.80	1.94
13	000932	华菱钢铁	929,307.20	1.94
14	300498	温氏股份	924,329.00	1.93
15	603259	药明康德	917,621.00	1.91
16	002463	沪电股份	917,014.00	1.91
17	002318	久立特材	896,557.00	1.87
18	002179	中航光电	881,971.00	1.84
19	300274	阳光电源	862,438.00	1.80
20	600519	贵州茅台	858,541.00	1.79

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（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	132,713,615.59
卖出股票收入（成交）总额	154,578,900.08

注：本项的“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	-	-
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)	1,600.03	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,600.03	0.00

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	118071	华峰转债	10	1,000.02	0.00
2	127114	宜化转债	6	600.01	0.00

注：本基金报告期末仅持有上述 2 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

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

无。

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

无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

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。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

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。

7.11.3 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	19,041.92
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,368.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,410.88

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	527,718.00	1.46	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇泉匠心智选一年持有混合A	1,490	15,431.01	0.00	0%	22,992,200.24	100%
汇泉匠心智选一年持有混合C	272	8,880.33	0.00	0%	2,415,449.71	100%
合计	1,762	14,419.78	0.00	0%	25,407,649.95	100%

注：1、机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对下属分级份额，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用下属分级份额的合计数（即期末基金份额总额）。
2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	99.80%

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	汇泉匠心智选一年持有混合 A	15,173.98	0.07%
	汇泉匠心智选一年持有混合 C	484.30	0.02%
	合计	15,658.28	0.06%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	汇泉匠心智选一年持有混合 A	0~10
	汇泉匠心智选一年持有混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	汇泉匠心智选一年持有混合 A	0~10
	汇泉匠心智选一年持有混合 C	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇泉匠心智选一年持有混合 A	汇泉匠心智选一年持有混合 C
基金合同生效日（2022 年 09 月 13 日）基金份额总额	197,807,741.01	30,757,730.67
本报告期期初基金份额总额	36,517,715.29	4,914,394.52

本报告期基金总申购份额	751,885.15	83,638.94
减：本报告期基金总赎回份额	14,277,400.20	2,582,583.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	22,992,200.24	2,415,449.71

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

1. 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2. 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

无。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略无变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所无变化。

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，本基金管理人没有发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人高级管理人员及相关从业人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

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	
中信证券	2	284,329,364.38	98.97%	125,274.94	98.83%	-
金融街证券	2	2,963,151.29	1.03%	1,481.57	1.17%	-
上海东证期货	2	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》关于交易佣金分仓的规定。

2、 本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商选择标准包括：公司基本面评价（财务情况、资信状况、经营情况）、公司合规风控能力评价、公司券商结算模式服务评价（稳定性、及时性）等方面，如拟使用证券经纪商的研究服务，需对公司研究服务进行评价（研究成果、研究团队）。基金证券经纪商选择程序为：根据前述标准由基金管理人考察后确定选用证券经纪商，并与其签订证券经纪服务协议。

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		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
中信证券	1,290.40	100.00%	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-	-	-
上海东证期货	-	-	-	-	-	-	-	-

国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---	---	---

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	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2025 年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-22
2	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-31
3	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-22
4	汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-26
5	汇泉基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇泉匠心智选一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 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.springsfund.com）查阅。

汇泉基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日