

泰康沪港深价值优选灵活配置混合型
证券投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：泰康基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期为 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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	12
§ 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）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53

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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	56
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点	63
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	泰康沪港深价值优选混合
基金主代码	003580
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 12 月 29 日
基金管理人	泰康基金管理有限公司
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	58,907,175.47 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在内地与香港证券市场中优选具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严控组合风险的基础上力争获取超越业绩比较基准的最大化投资收益。
投资策略	本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动式组合管理获得超过业绩比较基准的收益。 大类资产配置方面，本基金综合分析宏观经济运行情况、宏观政策、股票市场与债券市场及其他替代资产市场的相对投资价值，在股票与债券等资产类别之间动态配置；根据 A 股、H 股溢价率的变化并综合市场行情，适当调整 A 股与港股的配置比例。 股票市场投资方面，本基金主要采取价值型选股策略，综合考虑投资者情绪、认知等决策因素的影响，对股票进行系统化、程序化筛选、排序，在一级、二级市场全面遴选优质估值水平相对合理的国内 A 股及香港股票市场交易互联互通机制下的港股投资标的股票进行重点投资。 债券投资和流动性管理方面，本基金动态地确定并调整优先配置的资产类别和比例，综合平衡基金资产在流动性和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、正回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性。
业绩比较基准	恒生指数收益率*75%+沪深 300 指数收益率*5%+中债综合全价指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金为跨境证券投资的基金，主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。

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		泰康基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈玮光	任航
	联系电话	010-89620366	010-66060069
	电子邮箱	tkfchenwg06@tkfunds.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4001895522	95599
传真		010-89620100	010-68121816
注册地址		北京市西城区复兴门内大街 156 号 3 层 1-10 内 302	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 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		100033	100031
法定代表人		金志刚	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.tkfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人办公地、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	泰康基金管理有限公司	北京市西城区武定侯街 2 号泰康国际大厦 3、5 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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	5,175,739.74
本期利润	11,731,154.99
加权平均基金份额本期利润	0.2237
本期加权平均净值利润率	16.16%
本期基金份额净值增长率	22.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	4,420,702.70
期末可供分配基金份额利润	0.0750
期末基金资产净值	88,260,907.01
期末基金份额净值	1.4983
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	49.83%

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

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

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

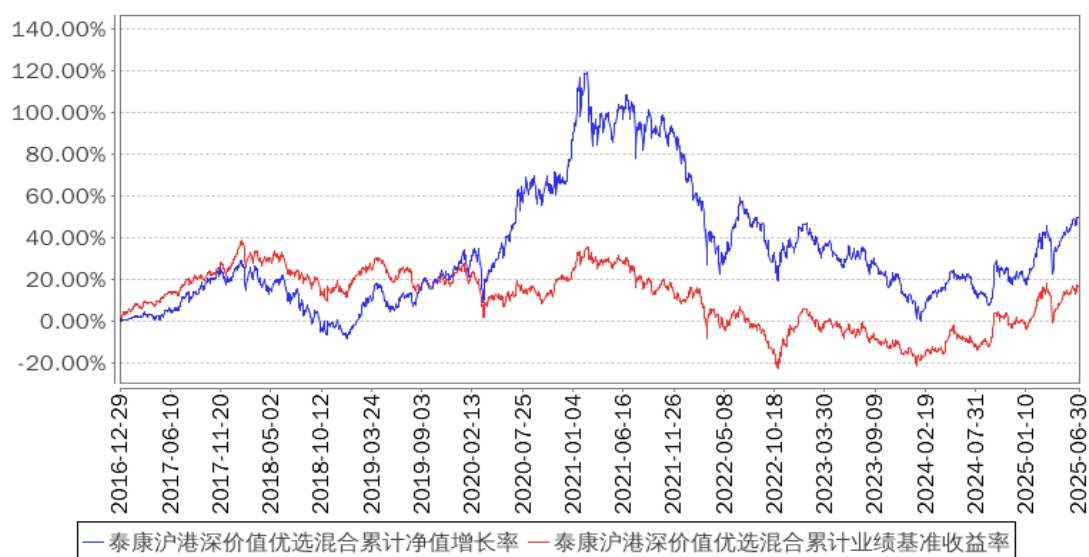
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	4.83%	0.75%	2.72%	0.83%	2.11%	-0.08%
过去三个月	8.60%	1.66%	3.62%	1.62%	4.98%	0.04%
过去六个月	22.32%	1.56%	15.08%	1.45%	7.24%	0.11%
过去一年	23.66%	1.40%	28.06%	1.28%	-4.40%	0.12%
过去三年	-4.62%	1.24%	10.11%	1.23%	-14.73%	0.01%
自基金合同生效起至今	49.83%	1.34%	15.77%	1.09%	34.06%	0.25%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

泰康沪港深价值优选混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2016 年 12 月 29 日生效。

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

无。

§ 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

泰康基金管理有限公司（以下简称“泰康基金”）前身为泰康资产管理有限责任公司（以下简称“泰康资产”）公募事业部，2015 年 4 月，泰康资产公募基金管理业务资格正式获得监管机构批准，成为首家获得该业务资格的保险资产管理公司。2021 年 9 月 1 日，泰康资产获得证监会批准设立子公司泰康基金，2021 年 10 月 12 日，泰康基金完成工商注册。2022 年 11 月 18 日，泰康资产旗下公募基金产品的基金管理人变更为泰康基金。

泰康基金注册地为北京，注册资本为 1.2 亿元人民币。截至 2025 年 6 月 30 日，泰康基金共管理 85 只证券投资基金。产品已形成包括货币、债券、偏债混合、偏股混合、主动权益、沪港深系列、主动量化及被动指数、FOF 及养老目标基金等不同类型、不同风险收益特征的产品系列。泰康基金主动与被动业务双轮发展，旗下基金覆盖沪深 300、中证 500、中证 A500 等重要宽基指数，及半导体、智能电车、碳中和、医疗健康、大消费等细分行业，为投资者提供了丰富多元的投资选择。

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		
黄成扬	本基金基金经理	2017 年 11 月 21 日	-	18 年	黄成扬，硕士研究生。2017 年 7 月加入泰康公募，现任泰康基金股票基金经理。曾任金捷基金研究部研究员，恒星资产研究部研究员，长盛基金国际业务部高级研究员、专户投资经理、基金经理等职务。2017 年 11 月 21 日至今担任泰康沪港深精选灵活配置混合型证券投资基金、泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 12 月 21 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康中证港股通非银行金融主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 1 月 29 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康中证港股通地产指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 3 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康中证港股通 TMT 主题指数型发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 9 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康中证港股通大消费主题指数型

					发起式证券投资基金基金经理。2019 年 4 月 16 日至 2021 年 4 月 12 日担任泰康港股通中证香港银行投资指数型发起式证券投资基金基金经理。2022 年 3 月 2 日至 2024 年 10 月 17 日担任泰康沪港深成长混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：证券从业的含义遵从行业协会的相关规定。表中的任职日期和离任日期均指公司相关公告中披露的日期。

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相关法律法规以及基金合同的约定，本基金运作整体合法合规，没有出现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

本基金管理人公平对待旗下管理的所有基金和组合，建立了公平交易制度和流程，并严格执行。报告期内，本基金管理人严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。在投资管理活动中，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了异常交易的监控与报告制度，对异常交易行为进行事前、事中和事后的监控。报告期内，没有出现本基金所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的情况。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

宏观经济方面，2025 年上半年延续了此前结构分化的特征，但部分领域的韧性好于预期，宏观经济预期有所改善。结构分化体现在，出口和制造业继续支撑经济，但地产在年初的小阳春之后明显降温。消费在以旧换新的支撑下，表现较好。相对于现实层面的数据，预期的改善更为明显，科技领域突破、出口在关税冲击下仍然保持韧性等，增强了宏观信心。

权益市场方面，今年以来市场整体偏震荡，但流动性充裕之下，局部机会较多。从大盘指数整体表现上来看，上半年上证指数上涨 2.76%，沪深 300 上涨 0.03%，创业板指上涨 0.53%，恒生综合指数上涨 20.18%，恒生科技上涨 18.68%。申万一级行业表现来看，有色金属、银行、国防军工、传媒、通信等行业表现相对较好，煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等行业表

现相对落后。

权益投资方面，年初我们重点布局了内需和科技成长方向，对于外需相关的板块，仅保留了少数有全球竞争力的标的；三月份鉴于关税的不确定性，我们将部分持仓切换成贵金属和估值较低的工业金属标的，均取得了较好的效果。在关税战从升级到缓和的过程中，市场主线逐步切向新消费和创新药方向，我们在这个方向主要是自下而上寻找了一些个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4983 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.32%；同期业绩比较基准增长率为 15.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济方面，展望下半年，“反内卷”政策如何推行，成为最大看点。宏观经济或能继续维持平稳运行的特征，出口存在一定的向下压力、但韧性犹存；财政力度或边际退坡，但如果反内卷政策能提振市场预期、有效平衡部分行业的供需格局，则有利于通缩预期的缓解。外部环境处于缓和期，为国内提供了良好的发展环境。

权益市场方面，展望下半年，我们认为世界政治和经贸关系仍处于颠簸之中，但预计全球的货币政策偏宽松，实体经济向下有底，市场仍然积极可为。

权益投资方面，中长期布局来讲，我们立足于估值较低分红较高的红利品种，积极寻找并布局具备中期成长性或者具备颠覆性变化潜力的板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值小组，并制定了相关制度及流程。估值小组设成员若干名，成员由各相关部门选派，包括运营管理部、风险控制部、各投资部门（包括固定收益投资部、权益投资部、量化投资部、FOF 及多资产配置部）、监察稽核部等。估值小组成员具有一定的工作经验及专业胜任能力。

本公司基金经理参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。

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，一切以投资者利益最大化为最高准则。

与估值相关的机构包括上海、深圳、北京证券交易所，中国证券登记结算有限责任公司，中央国债登记结算有限责任公司以及中国基金业协会等。

本基金所采用的估值流程及估值结果均已经过会计师事务所鉴证，并经托管人复核确认。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情况，出现该情况的时间范围为 2024 年 12 月 18 日至 2025 年 2 月 19 日。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——泰康基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，泰康基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，泰康基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	6,429,734.97	3,150,204.38
结算备付金		1,061,986.64	786,292.11
存出保证金		52,569.25	40,148.28
交易性金融资产	6.4.7.2	76,392,131.12	35,712,856.44
其中：股票投资		75,544,224.90	34,900,329.32
基金投资		-	-
债券投资		847,906.22	812,527.12
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	4,000,000.00	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,021,826.78	377,653.75
应收股利		296,510.45	68,915.20
应收申购款		36,835.68	600.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		89,291,594.89	40,136,671.14
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		612,264.03	613,194.99
应付赎回款		120,812.41	72,762.80

应付管理人报酬		85,612.99	73,160.28
应付托管费		14,268.85	12,193.37
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.45	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	197,729.15	287,834.14
负债合计		1,030,687.88	1,059,145.58
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	58,907,175.47	31,902,031.28
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	29,353,731.54	7,175,494.28
净资产合计		88,260,907.01	39,077,525.56
负债和净资产总计		89,291,594.89	40,136,671.14

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4983 元，基金份额总额 58,907,175.47 份。

6.2 利润表

会计主体：泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,278,101.43	7,197,446.30
1. 利息收入		33,871.42	95,139.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	17,920.23	50,445.37
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		15,951.19	44,693.79
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,686,946.91	-3,413,316.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	4,936,093.97	-4,814,919.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,390.36	31,000.78
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-

衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	743,462.58	1,370,602.39
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	6,555,415.25	10,515,405.73
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	1,867.85	217.97
减：二、营业总支出		546,946.44	724,721.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	425,114.96	554,934.14
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	70,852.51	92,489.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		253.84	-
其中：卖出回购金融资产 支出		253.84	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.05	0.51
8. 其他费用	6.4.7.23	50,725.08	77,298.07
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		11,731,154.99	6,472,724.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		11,731,154.99	6,472,724.53
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		11,731,154.99	6,472,724.53

6.3 净资产变动表

会计主体：泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产	31,902,031.28	-	7,175,494.28	39,077,525.56
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	31,902,031.28	-	7,175,494.28	39,077,525.56
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	27,005,144.19	-	22,178,237.26	49,183,381.45
(一)、综合收益总额	-	-	11,731,154.99	11,731,154.99
(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)	27,005,144.19	-	10,447,082.27	37,452,226.46
其中：1. 基金申购款	30,582,790.06	-	11,859,784.78	42,442,574.84
2. 基金赎回款	-3,577,645.87	-	-1,412,702.51	-4,990,348.38
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	58,907,175.47	-	29,353,731.54	88,260,907.01
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	83,177,784.50	-	10,841,534.69	94,019,319.19
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	83,177,784.50	-	10,841,534.69	94,019,319.19

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,503,726.63	-	6,229,818.58	3,726,091.95
(一)、综合收益总额	-	-	6,472,724.53	6,472,724.53
(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)	-2,503,726.63	-	-242,905.95	-2,746,632.58
其中：1. 基金申购款	745,144.16	-	119,345.73	864,489.89
2. 基金赎回款	-3,248,870.79	-	-362,251.68	-3,611,122.47
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	80,674,057.87	-	17,071,353.27	97,745,411.14

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：

<u>金志刚</u>	<u>金志刚</u>	<u>李俊佑</u>
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

泰康沪港深价值优选灵活配置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[2016]2304号《关于准予泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由泰康资产管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪港深价值优选灵活配置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人民币223,046,249.46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(2016)第

1673 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 223,112,505.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,256.42 份基金份额。本基金的基金管理人为泰康基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、通知存款和其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货、国债期货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)。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 0%-95%(其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%,投资于港股通投资标的股票的比例占基金资产的 0-95%);基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:恒生指数收益 x75%+沪深 300 指数收益率 x5%+中债综合全价指数收益率 x20%。

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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日止期间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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 2025 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期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《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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]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]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[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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，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。

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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

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。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。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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	6,429,734.97
等于：本金	6,429,068.47
加：应计利息	666.50

减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	6,429,734.97

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		67,418,645.70	-	75,544,224.90	8,125,579.20
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	838,860.00	8,906.22	847,906.22	140.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	838,860.00	8,906.22	847,906.22	140.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		68,257,505.70	8,906.22	76,392,131.12	8,125,719.20

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

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

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 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	161,454.26
其中：交易所市场	161,454.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	36,274.89
合计	197,729.15

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,902,031.28	31,902,031.28
本期申购	30,582,790.06	30,582,790.06
本期赎回（以“-”号填列）	-3,577,645.87	-3,577,645.87
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	58,907,175.47	58,907,175.47

注：申购包含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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	-926,555.10	8,102,049.38	7,175,494.28
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-926,555.10	8,102,049.38	7,175,494.28
本期利润	5,175,739.74	6,555,415.25	11,731,154.99
本期基金份额交易产生的变动数	171,518.06	10,275,564.21	10,447,082.27
其中：基金申购款	263,525.18	11,596,259.60	11,859,784.78
基金赎回款	-92,007.12	-1,320,695.39	-1,412,702.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,420,702.70	24,933,028.84	29,353,731.54

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,332.09
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	2,478.82
其他	109.32
合计	17,920.23

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,936,093.97
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	4,936,093.97

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	369,215,516.90
减：卖出股票成本总额	363,392,712.04
减：交易费用	886,710.89
买卖股票差价收入	4,936,093.97

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	10,635.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,245.00
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	7,390.36

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	816,000.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	803,245.00
减：应计利息总额	16,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-3,245.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	743,462.58
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	743,462.58

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,555,415.25
股票投资	6,555,790.25
债券投资	-375.00
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	6,555,415.25

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,867.85
合计	1,867.85

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中：申购费补差收取具

体情况，视每次转换时的两只基金的费率差异情况而定。基金转换费用由基金份额持有人承担。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	2,479.70
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	—
银行费用	4,850.19
债券帐户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	50,725.08

6.4.7.24 分部报告

无。

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 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
泰康基金管理有限公司	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
泰康人寿保险有限责任公司（“泰康人寿”）	与基金管理人同受最终控股母公司控制、基金销售机构
泰康保险集团股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
泰康资产管理有限责任公司	基金管理人控股股东
嘉兴昱泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴舜泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴祺泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
嘉兴崇泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

嘉兴宸泰资产管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
--------------------	----------

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 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	425,114.96	554,934.14
其中：应支付销售机构的客户维护费	82,022.06	28,266.36
应支付基金管理人的净管理费	343,092.90	526,667.78

注：支付基金管理人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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	70,852.51	92,489.05

注：支付基金托管人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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% \div \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
农业银行	6,429,734.97	15,332.09	6,700,582.24	30,011.44

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行约定利率计息。

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（2025 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

6.4.12.1.2 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
118056	路维转债	2025 年 6 月 12 日	1-6 个月（含）	新债未上市	100.00	100.01	1,390	139,000.00	139,012.19	-

注：截至本报告期末，本基金未持有因认购新发/增发证券而流通受限的股票。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

本基金为混合型基金，属于中高风险收益的投资品种，其预期风险和预期收益水平高于货币型基金、债券型基金，低于股票型基金。本基金为跨境证券投资的基金，主要投资于中国大陆 A 股市场 and 法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、流动性风险、香港市场风险等港股投资所面临的特别投资风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在内地与香港证券市场中优选具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，在严控组合风险的基础上力争获取超越业绩比较基准的最大化投资收益。

本基金的基金管理人董事会重视建立完善的公司治理结构与内部控制体系，公司董事会对公司建立内部控制系统和维持其有效性承担最终责任。

为加强公募基金管理的内部控制，促进诚信、合法、有效经营的内部控制环境，保障基金持

有人利益，基金管理人遵照国家有关法律法规，遵循合法合规性原则、全面性原则、审慎性原则和适时性原则，制定了系统完善的内部控制制度。内部控制的主要内容包括投资管理业务控制、市场营销与过户登记业务控制、信息披露控制、监察稽核控制等。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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

注：短期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	139,012.19	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	139,012.19	0.00

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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

注：长期信用评级由中国人民银行许可的信用评级机构评级，并由发行人在中国人民银行指定的国内有关媒体上公告。

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随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于 2025 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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

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 15%。于 2025 年 6 月 30 日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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。于 2025 年 6 月 30 日，本基金确认的净赎回申请未超过 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金、结算备付金、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 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	6,429,734.97	-	-	-	6,429,734.97
结算备付金	1,061,986.64	-	-	-	1,061,986.64
存出保证金	52,569.25	-	-	-	52,569.25
交易性金融资产	708,894.03	-	139,012.19	75,544,224.90	76,392,131.12
买入返售金融资产	4,000,000.00	-	-	-	4,000,000.00
应收股利	-	-	-	296,510.45	296,510.45
应收申购款	-	-	-	36,835.68	36,835.68
应收清算款	-	-	-	1,021,826.78	1,021,826.78
资产总计	12,253,184.89	-	139,012.19	76,899,397.81	89,291,594.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	120,812.41	120,812.41
应付管理人报酬	-	-	-	85,612.99	85,612.99
应付托管费	-	-	-	14,268.85	14,268.85
应付清算款	-	-	-	612,264.03	612,264.03
应交税费	-	-	-	0.45	0.45
其他负债	-	-	-	197,729.15	197,729.15
负债总计	-	-	-	1,030,687.88	1,030,687.88
利率敏感度缺口	12,253,184.89	-	139,012.19	75,868,709.93	88,260,907.01
上年度末 2024 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	3,150,204.38	-	-	-	3,150,204.38
结算备付金	786,292.11	-	-	-	786,292.11
存出保证金	40,148.28	-	-	-	40,148.28
交易性金融资产	812,527.12	-	-	34,900,329.32	35,712,856.44
应收股利	-	-	-	68,915.20	68,915.20
应收申购款	-	-	-	600.98	600.98
应收清算款	-	-	-	377,653.75	377,653.75
资产总计	4,789,171.89	-	-	35,347,499.25	40,136,671.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	72,762.80	72,762.80
应付管理人报酬	-	-	-	73,160.28	73,160.28
应付托管费	-	-	-	12,193.37	12,193.37
应付清算款	-	-	-	613,194.99	613,194.99
其他负债	-	-	-	287,834.14	287,834.14
负债总计	-	-	-	1,059,145.58	1,059,145.58
利率敏感度缺口	4,789,171.89	-	-	34,288,353.67	39,077,525.56

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

假设	假设其他变量不变，仅利率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的债券公允价值变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场利率上调 0.25%	-121.20	-924.41
	市场利率下调 0.25%	121.24	926.52

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。

于 2025 年 06 月 30 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 57,079,309.90 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 57,079,309.90 元（于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有以港币计价的资产折合人民币 23,952,991.60 元，无以外币计价的负债，资产负债表外汇风险敞口净额 23,952,991.60 元）。

假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响。若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 570,793.10 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-570,793.10 元（于 2024 年 12 月 31 日，若港币相对人民币升值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为 239,529.92 元；若港币相对人民币贬值 1%，对资产负债表日基金资产净值的影响金额为-239,529.92 元）。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计

	币元			
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	57,079,309.90	-	57,079,309.90
资产合计	-	57,079,309.90	-	57,079,309.90
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	-	57,079,309.90	-	57,079,309.90
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	23,952,991.60	-	23,952,991.60
资产合计	-	23,952,991.60	-	23,952,991.60
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	-	23,952,991.60	-	23,952,991.60

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设其他变量不变，仅外币汇率发生合理、可能的变动，考察为交易而持有的股票公允价值的变动对基金利润总额和净值产生的影响		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	市场汇率上升 1%	570,793.10	239,529.92
	市场汇率下降 1%	-570,793.10	-239,529.92

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。

本基金采用定性分析与定量分析相结合的分析框架，自上而下灵活配置大类资产，自下而上精选投资标的，在控制风险的前提下集中资金进行优质证券的投资管理，同时进行高效的流动性管理，力争利用主动组合管理获得超过业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通投资标的股票的比例占基金资产的 0-95%）；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	75,544,224.90	85.59	34,900,329.32	89.31
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	75,544,224.90	85.59	34,900,329.32	89.31

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准中的权益指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准中的 权益指数上涨 5%	4,100,647.23	2,083,630.56
	业绩比较基准中的 权益指数下跌 5%	-4,100,647.23	-2,083,630.56

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	75,544,224.90	34,900,329.32
第二层次	847,906.22	812,527.12
第三层次	-	-
合计	76,392,131.12	35,712,856.44

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；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券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

本基金本报告期末及上年度末均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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	75,544,224.90	84.60
	其中：股票	75,544,224.90	84.60
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	847,906.22	0.95
	其中：债券	847,906.22	0.95
	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	4,000,000.00	4.48
	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	7,491,721.61	8.39
8	其他各项资产	1,407,742.16	1.58
9	合计	89,291,594.89	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公允价值为 57,079,309.90 元，占期末资产净值比例为 64.67%。

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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,009,640.00	10.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,992,675.00	4.52
J	金融业	3,606,600.00	4.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,856,000.00	2.10
S	综合	-	-
	合计	18,464,915.00	20.92

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）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	11,006,070.00	12.47
B 消费者非必需品	11,681,453.90	13.24
C 消费者常用品	897,360.00	1.02
D 能源	800,800.00	0.91
E 金融	4,610,400.00	5.22
F 医疗保健	7,372,930.00	8.35
G 工业	3,921,140.00	4.44
H 信息技术	7,135,800.00	8.08
I 电信服务	9,653,356.00	10.94
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	57,079,309.90	64.67

注：以上行业分类标准来源于财汇。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	14,400	6,605,424.00	7.48
2	09988	阿里巴巴-W	32,000	3,204,160.00	3.63
3	01818	招金矿业	160,000	2,976,000.00	3.37
4	00981	中芯国际	63,000	2,567,880.00	2.91
5	002602	ST 华通	225,000	2,493,000.00	2.82
6	01378	中国宏桥	150,000	2,460,000.00	2.79
7	02359	药明康德	33,000	2,366,760.00	2.68
8	03618	重庆农村商业银行	388,000	2,347,400.00	2.66
9	00175	吉利汽车	150,000	2,182,500.00	2.47
10	00780	同程旅行	120,000	2,143,200.00	2.43
11	600757	长江传媒	200,000	1,856,000.00	2.10
12	02268	药明合联	48,000	1,821,120.00	2.06
13	02382	舜宇光学科技	28,000	1,770,720.00	2.01
14	00998	中信银行	250,000	1,705,000.00	1.93
15	01787	山东黄金	67,000	1,664,950.00	1.89

16	02899	紫金矿业	88,000	1,608,640.00	1.82
17	688401	路维光电	45,000	1,561,500.00	1.77
18	600000	浦发银行	100,000	1,388,000.00	1.57
19	600926	杭州银行	80,000	1,345,600.00	1.52
20	000933	神火股份	80,000	1,331,200.00	1.51
21	00189	东岳集团	138,000	1,319,280.00	1.49
22	09868	小鹏汽车-W	18,800	1,210,344.00	1.37
23	03888	金山软件	32,000	1,193,600.00	1.35
24	01055	中国南方航空 股份	320,000	1,174,400.00	1.33
25	01801	信达生物	16,000	1,144,000.00	1.30
26	09863	零跑汽车	21,000	1,047,480.00	1.19
27	02208	金风科技	150,000	1,021,500.00	1.16
28	09899	网易云音乐	4,500	989,010.00	1.12
29	01208	五矿资源	280,000	977,200.00	1.11
30	01530	三生制药	45,000	970,650.00	1.10
31	000893	亚钾国际	32,000	964,480.00	1.09
32	600160	巨化股份	32,000	917,760.00	1.04
33	02145	上美股份	12,000	897,360.00	1.02
34	601825	沪农商行	90,000	873,000.00	0.99
35	01330	绿色动力环保	180,000	849,600.00	0.96
36	00857	中国石油股份	130,000	800,800.00	0.91
37	002463	沪电股份	18,000	766,440.00	0.87
38	688150	莱特光电	30,000	741,600.00	0.84
39	00268	金蝶国际	50,000	704,000.00	0.80
40	01896	猫眼娱乐	100,000	665,000.00	0.75
41	01773	天立国际控股	160,000	662,400.00	0.75
42	300888	稳健医疗	16,000	657,600.00	0.75
43	01789	爱康医疗	120,000	655,200.00	0.74
44	01478	丘钛科技	80,000	605,600.00	0.69
45	300738	奥飞数据	27,000	565,110.00	0.64
46	00966	中国太平	40,000	558,000.00	0.63
47	01357	美图公司	64,000	526,720.00	0.60
48	300442	润泽科技	10,500	520,065.00	0.59
49	01519	极兔速递-W	80,000	494,400.00	0.56
50	688008	澜起科技	6,000	492,000.00	0.56
51	01060	大麦娱乐	500,000	440,000.00	0.50
52	09992	泡泡玛特	1,800	437,634.00	0.50
53	300850	新强联	12,000	429,840.00	0.49
54	01024	快手-W	7,400	427,202.00	0.48
55	688408	中信博	9,000	420,120.00	0.48
56	09885	药师帮	48,000	415,200.00	0.47
57	300010	豆神教育	50,000	414,500.00	0.47
58	00999	小菜园	40,000	388,000.00	0.44

59	00325	布鲁可	3,000	386,310.00	0.44
60	00152	深圳国际	54,000	381,240.00	0.43
61	300680	隆盛科技	10,000	379,100.00	0.43
62	603306	华懋科技	8,000	348,000.00	0.39
63	03738	阜博集团	100,000	294,000.00	0.33
64	03690	美团-W	170	19,425.90	0.02

注：对于同时在 A+H 股上市的股票，合并计算公允价值参与排序，并按照不同股票分别披露。

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	09988	阿里巴巴-W	7,912,009.32	20.25
2	02382	舜宇光学科技	6,657,906.64	17.04
3	03690	美团-W	5,284,602.39	13.52
4	00981	中芯国际	4,993,843.47	12.78
5	00700	腾讯控股	4,835,359.73	12.37
6	01024	快手-W	4,686,614.64	11.99
7	02359	药明康德	4,593,614.50	11.76
8	688401	路维光电	4,012,919.96	10.27
9	00175	吉利汽车	3,756,719.85	9.61
10	02018	瑞声科技	3,743,035.39	9.58
11	09899	网易云音乐	3,680,913.06	9.42
12	02268	药明合联	3,651,868.40	9.35
13	09868	小鹏汽车-W	3,492,796.86	8.94
14	03888	金山软件	3,424,420.37	8.76
15	01478	丘钛科技	3,268,558.33	8.36
16	00780	同程旅行	3,242,056.08	8.30
17	02367	巨子生物	3,121,976.57	7.99
18	09992	泡泡玛特	3,118,692.23	7.98
19	01378	中国宏桥	3,078,921.24	7.88
20	09636	九方智投控股	3,069,099.28	7.85
21	832982	锦波生物	3,016,252.55	7.72
22	03968	招商银行	1,913,521.09	4.90
22	600036	招商银行	1,016,900.00	2.60
23	002384	东山精密	2,921,638.00	7.48
24	605319	无锡振华	2,866,321.00	7.33
25	06693	赤峰黄金	2,750,295.44	7.04
26	002371	北方华创	2,747,750.00	7.03
27	002409	雅克科技	2,712,959.00	6.94
28	000933	神火股份	2,691,569.00	6.89
29	01818	招金矿业	2,667,742.08	6.83
30	01675	亚信科技	2,627,732.77	6.72

31	09863	零跑汽车	2,608,457.88	6.68
32	01801	信达生物	2,580,971.86	6.60
33	000887	中鼎股份	2,555,102.00	6.54
34	600757	长江传媒	2,553,863.00	6.54
35	300433	蓝思科技	2,429,055.00	6.22
36	002048	宁波华翔	2,421,026.00	6.20
37	09626	哔哩哔哩-W	2,420,367.53	6.19
38	01385	上海复旦	2,279,221.42	5.83
39	002916	深南电路	2,216,638.00	5.67
40	300888	稳健医疗	2,214,642.00	5.67
41	02015	理想汽车-W	2,211,566.83	5.66
42	600988	赤峰黄金	2,186,404.00	5.60
43	600000	浦发银行	2,168,697.00	5.55
44	002602	ST 华通	2,168,625.00	5.55
45	00992	联想集团	2,147,665.99	5.50
46	00013	和黄医药	2,090,525.07	5.35
47	00285	比亚迪电子	2,061,168.29	5.27
48	01860	汇量科技	2,043,839.69	5.23
49	02556	迈富时	2,025,056.93	5.18
50	02899	紫金矿业	1,737,432.37	4.45
50	601899	紫金矿业	254,560.00	0.65
51	03939	万国黄金集团	1,978,055.27	5.06
52	01347	华虹半导体	1,954,185.17	5.00
53	02145	上美股份	1,942,627.01	4.97
54	002475	立讯精密	1,926,349.00	4.93
55	01787	山东黄金	1,921,803.14	4.92
56	301291	明阳电气	1,913,172.00	4.90
57	601689	拓普集团	1,901,958.00	4.87
58	01686	新意网集团	1,895,378.67	4.85
59	603109	神驰机电	1,872,133.00	4.79
60	600160	巨化股份	1,864,883.00	4.77
61	600718	东软集团	1,829,352.00	4.68
62	01530	三生制药	1,822,168.09	4.66
63	02208	金风科技	1,801,458.42	4.61
64	00998	中信银行	1,791,115.55	4.58
65	301155	海力风电	1,764,633.00	4.52
66	003010	若羽臣	1,749,257.20	4.48
67	300502	新易盛	1,746,324.00	4.47
68	03896	金山云	1,720,448.78	4.40
69	00512	远大医药	1,700,010.56	4.35
70	02228	晶泰控股	1,677,645.58	4.29
71	01773	天立国际控股	1,676,833.00	4.29
72	688018	乐鑫科技	1,676,674.19	4.29

73	02099	中国黄金国际	1,621,748.93	4.15
74	300740	水羊股份	1,593,755.68	4.08
75	01208	五矿资源	1,589,278.31	4.07
76	06618	京东健康	1,567,194.20	4.01
77	688652	京仪装备	1,567,138.30	4.01
78	603102	百合股份	1,564,848.00	4.00
79	00189	东岳集团	1,549,467.11	3.97
80	00762	中国联通	1,542,116.24	3.95
81	01055	中国南方航空 股份	1,540,879.52	3.94
82	605009	豪悦护理	1,540,076.00	3.94
83	002463	沪电股份	1,522,930.00	3.90
84	601825	沪农商行	1,506,974.00	3.86
85	002379	宏创控股	1,488,180.00	3.81
86	06088	FIT HON TENG	1,484,404.20	3.80
87	002335	科华数据	1,482,689.30	3.79
88	603063	禾望电气	1,474,462.00	3.77
89	300783	三只松鼠	1,470,176.00	3.76
90	002128	电投能源	1,466,148.00	3.75
91	00268	金蝶国际	1,465,841.36	3.75
92	688596	正帆科技	1,436,709.67	3.68
93	600079	人福医药	1,410,336.00	3.61
94	605088	冠盛股份	1,409,318.84	3.61
95	600989	宝丰能源	1,408,978.54	3.61
96	00966	中国太平	1,400,986.93	3.59
97	000063	中兴通讯	710,538.00	1.82
97	00763	中兴通讯	677,918.56	1.73
98	06869	长飞光纤光缆	1,383,241.90	3.54
99	01658	邮储银行	1,380,725.52	3.53
100	603809	豪能股份	1,359,625.00	3.48
101	03618	重庆农村商业 银行	1,316,588.86	3.37
102	600926	杭州银行	1,296,526.00	3.32
103	002906	华阳集团	1,286,511.00	3.29
104	02155	森松国际	1,285,796.80	3.29
105	688205	德科立	1,281,103.03	3.28
106	01316	耐世特	1,257,486.24	3.22
107	300130	新国都	1,250,611.00	3.20
108	02318	中国平安	699,224.02	1.79
108	601318	中国平安	542,110.00	1.39
109	002345	潮宏基	1,236,769.00	3.16
110	300533	冰川网络	1,230,274.00	3.15
111	01177	中国生物制药	1,229,908.14	3.15
112	00136	中国儒意	1,210,165.14	3.10

113	002353	杰瑞股份	1,206,604.00	3.09
114	002970	锐明技术	1,204,386.00	3.08
115	600183	生益科技	1,202,475.00	3.08
116	600745	闻泰科技	1,191,086.00	3.05
117	300850	新强联	1,162,722.00	2.98
118	601567	三星医疗	1,159,321.00	2.97
119	00857	中国石油股份	1,138,731.03	2.91
120	600694	大商股份	1,120,520.00	2.87
121	01060	大麦娱乐	1,109,662.26	2.84
122	603606	东方电缆	1,102,377.00	2.82
123	002550	千红制药	1,100,264.00	2.82
124	300680	隆盛科技	1,097,513.00	2.81
125	832978	开特股份	1,096,709.47	2.81
126	02269	药明生物	1,094,566.74	2.80
127	601615	明阳智能	1,086,959.00	2.78
128	00856	伟仕佳杰	1,056,447.35	2.70
129	01558	东阳光长江药业	1,042,876.89	2.67
130	002025	航天电器	1,040,192.00	2.66
131	00354	中国软件国际	1,020,764.20	2.61
132	688041	海光信息	1,018,458.22	2.61
133	01211	比亚迪股份	1,001,451.17	2.56
134	300033	同花顺	1,001,185.00	2.56
135	600114	东睦股份	993,703.00	2.54
136	688019	安集科技	978,701.26	2.50
137	688692	达梦数据	973,862.52	2.49
138	000893	亚钾国际	949,658.00	2.43
139	600487	亨通光电	939,365.00	2.40
140	02333	长城汽车	934,478.46	2.39
141	001301	尚太科技	929,727.00	2.38
142	002049	紫光国微	925,407.00	2.37
143	06078	海吉亚医疗	916,961.98	2.35
144	603129	春风动力	907,091.55	2.32
145	601231	环旭电子	882,430.00	2.26
146	600563	法拉电子	879,201.00	2.25
147	09699	顺丰同城	874,040.23	2.24
148	00388	香港交易所	873,615.17	2.24
149	300972	万辰集团	864,118.00	2.21
150	600419	天润乳业	862,741.00	2.21
151	603197	保隆科技	860,182.00	2.20
152	301382	蜂助手	859,388.00	2.20
153	688787	海天瑞声	831,845.64	2.13
154	02618	京东物流	830,919.19	2.13
155	01209	华润万象生活	830,737.64	2.13

156	00956	新天绿色能源	827,759.55	2.12
157	002517	恺英网络	825,870.00	2.11
158	02943	中国铁塔(旧)	817,927.99	2.09
159	06055	中烟香港	817,281.03	2.09
160	03898	时代电气	809,428.27	2.07
161	06969	思摩尔国际	804,784.29	2.06
162	603920	世运电路	801,294.00	2.05
163	000725	京东方 A	782,000.00	2.00

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	03690	美团-W	6,445,628.58	16.49
2	02382	舜宇光学科技	5,903,939.43	15.11
3	09868	小鹏汽车-W	5,224,592.19	13.37
4	02018	瑞声科技	4,640,656.67	11.88
5	09988	阿里巴巴-W	4,398,570.60	11.26
6	002384	东山精密	4,360,020.00	11.16
7	01024	快手-W	4,243,854.40	10.86
8	02268	药明合联	3,802,219.26	9.73
9	832982	锦波生物	3,669,822.97	9.39
10	00981	中芯国际	3,179,267.99	8.14
11	00762	中国联通	3,162,204.18	8.09
12	605319	无锡振华	3,137,155.00	8.03
13	06693	赤峰黄金	3,130,426.10	8.01
14	02359	药明康德	3,068,992.98	7.85
15	09636	九方智投控股	3,037,168.26	7.77
16	01658	邮储银行	2,977,290.56	7.62
17	09899	网易云音乐	2,901,553.33	7.43
18	09992	泡泡玛特	2,878,590.67	7.37
19	02367	巨子生物	2,853,825.65	7.30
20	03968	招商银行	1,812,499.26	4.64
20	600036	XD 招商银	1,034,500.00	2.65
21	002475	立讯精密	2,835,133.00	7.26
22	00780	同程旅行	2,734,111.56	7.00
23	002371	北方华创	2,733,295.00	6.99
24	002409	雅克科技	2,728,817.00	6.98
25	00285	比亚迪电子	2,728,426.59	6.98
26	000887	中鼎股份	2,693,122.00	6.89
27	01675	亚信科技	2,670,929.92	6.83
28	01478	丘钛科技	2,574,420.99	6.59

29	688401	路维光电	2,530,202.53	6.47
30	301291	明阳电气	2,525,427.00	6.46
31	688019	安集科技	2,510,035.75	6.42
32	002048	宁波华翔	2,465,614.00	6.31
33	00175	吉利汽车	2,457,656.49	6.29
34	09626	哔哩哔哩-W	2,437,772.65	6.24
35	300433	蓝思科技	2,407,659.00	6.16
36	600988	赤峰黄金	2,366,733.00	6.06
37	01385	上海复旦	2,298,609.60	5.88
38	03888	金山软件	2,283,200.13	5.84
39	00700	腾讯控股	2,232,713.02	5.71
40	03939	万国黄金集团	2,139,313.54	5.47
41	02015	理想汽车-W	2,120,431.35	5.43
42	002916	深南电路	2,112,196.00	5.41
43	09863	零跑汽车	2,093,875.80	5.36
44	00013	和黄医药	2,089,516.70	5.35
45	003010	若羽臣	2,083,909.72	5.33
46	00992	联想集团	2,059,435.56	5.27
47	601689	拓普集团	2,044,616.11	5.23
48	01347	华虹半导体	1,996,603.74	5.11
49	01860	汇量科技	1,975,423.04	5.06
50	02556	迈富时	1,960,560.42	5.02
51	01801	信达生物	1,942,057.29	4.97
52	01818	招金矿业	1,878,618.46	4.81
53	300502	新易盛	1,875,169.00	4.80
54	603109	神驰机电	1,839,389.00	4.71
55	01686	新意网集团	1,838,506.38	4.70
56	300740	水羊股份	1,833,295.00	4.69
57	600718	东软集团	1,810,032.00	4.63
58	002602	ST 华通	1,801,010.00	4.61
59	603606	东方电缆	1,787,278.00	4.57
60	301155	海力风电	1,760,459.00	4.51
61	002353	杰瑞股份	1,737,989.00	4.45
62	02228	晶泰控股	1,729,461.03	4.43
63	688018	乐鑫科技	1,702,696.07	4.36
64	00512	远大医药	1,700,982.19	4.35
65	01530	三生制药	1,643,592.81	4.21
66	03896	金山云	1,643,572.79	4.21
67	002463	沪电股份	1,627,368.00	4.16
68	601615	明阳智能	1,618,374.00	4.14
69	02099	中国黄金国际	1,612,777.49	4.13
70	300783	三只松鼠	1,603,045.00	4.10
71	603102	百合股份	1,596,544.00	4.09

72	605009	豪悦护理	1,592,025.00	4.07
73	300888	稳健医疗	1,584,456.00	4.05
74	002379	宏创控股	1,562,905.00	4.00
75	06088	FIT HON TENG	1,559,996.11	3.99
76	06618	京东健康	1,549,403.59	3.96
77	002345	潮宏基	1,548,347.00	3.96
78	002335	科华数据	1,535,881.00	3.93
79	603063	禾望电气	1,531,859.00	3.92
80	688652	京仪装备	1,516,592.44	3.88
81	002128	电投能源	1,459,232.00	3.73
82	605088	冠盛股份	1,434,277.00	3.67
83	688596	正帆科技	1,415,815.29	3.62
84	600079	人福医药	1,387,387.00	3.55
85	002970	锐明技术	1,374,338.00	3.52
86	000063	中兴通讯	716,750.00	1.83
86	00763	中兴通讯	649,395.89	1.66
87	00788	中国铁塔	1,366,072.54	3.50
88	002906	华阳集团	1,338,319.00	3.42
89	603809	豪能股份	1,331,256.00	3.41
90	06869	长飞光纤光缆	1,320,095.31	3.38
91	02155	森松国际	1,318,623.71	3.37
92	01177	中国生物制药	1,318,251.27	3.37
93	688205	德科立	1,297,446.40	3.32
94	300130	新国都	1,292,563.00	3.31
95	600989	宝丰能源	1,276,513.40	3.27
96	000933	神火股份	1,241,098.00	3.18
97	02318	中国平安	698,732.93	1.79
97	601318	中国平安	536,300.00	1.37
98	600745	闻泰科技	1,210,434.00	3.10
99	300533	冰川网络	1,205,557.00	3.09
100	01316	耐世特	1,202,875.58	3.08
101	600183	生益科技	1,200,874.00	3.07
102	02145	上美股份	1,155,916.34	2.96
103	002550	千红制药	1,150,250.00	2.94
104	01378	中国宏桥	1,137,858.63	2.91
105	00856	伟仕佳杰	1,133,443.97	2.90
106	600694	大商股份	1,132,395.00	2.90
107	01208	五矿资源	1,130,551.62	2.89
108	600000	浦发银行	1,123,994.00	2.88
109	601567	三星医疗	1,123,558.00	2.88
110	600160	巨化股份	1,115,789.00	2.86
111	832978	开特股份	1,109,331.24	2.84
112	00136	中国儒意	1,095,184.20	2.80

113	02269	药明生物	1,058,310.34	2.71
114	600522	中天科技	1,054,588.00	2.70
115	002025	航天电器	1,052,099.00	2.69
116	603129	春风动力	1,044,540.00	2.67
117	00354	中国软件国际	1,034,135.94	2.65
118	01558	东阳光长江药业	1,013,077.81	2.59
119	688041	海光信息	997,581.68	2.55
120	600114	东睦股份	993,527.00	2.54
121	300033	同花顺	989,840.00	2.53
122	02208	金风科技	985,686.65	2.52
123	000680	山推股份	978,387.00	2.50
124	01773	天立国际控股	957,394.80	2.45
125	688692	达梦数据	954,481.30	2.44
126	01211	比亚迪股份	949,058.60	2.43
127	09699	顺丰同城	947,388.12	2.42
128	001301	尚太科技	943,197.00	2.41
129	002049	紫光国微	935,286.00	2.39
130	02333	长城汽车	930,227.91	2.38
131	06055	中烟香港	922,295.32	2.36
132	01787	山东黄金	911,537.65	2.33
133	600487	亨通光电	910,187.00	2.33
134	00388	香港交易所	895,397.48	2.29
135	600419	天润乳业	886,390.00	2.27
136	06078	海吉亚医疗	885,340.32	2.27
137	300972	万辰集团	880,372.00	2.25
138	300570	太辰光	874,570.00	2.24
139	00268	金蝶国际	868,150.25	2.22
140	600757	长江传媒	857,575.00	2.19
141	603197	保隆科技	850,941.00	2.18
142	600563	法拉电子	850,128.00	2.18
143	301382	蜂助手	843,401.00	2.16
144	01398	工商银行	834,737.24	2.14
145	03898	时代电气	828,141.80	2.12
146	02618	京东物流	824,442.32	2.11
147	03900	绿城中国	823,277.66	2.11
148	300680	隆盛科技	822,591.00	2.11
149	00966	中国太平	821,388.52	2.10
150	601231	环旭电子	816,030.00	2.09
151	00956	新天绿色能源	815,672.84	2.09
152	01209	华润万象生活	814,686.46	2.08
153	002517	恺英网络	808,851.00	2.07
154	002993	奥海科技	804,999.00	2.06
155	01060	大麦娱乐	800,390.63	2.05

156	688787	海天瑞声	789,526.30	2.02
-----	--------	------	------------	------

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	397,480,817.37
卖出股票收入（成交）总额	369,215,516.90

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	708,894.03	0.80
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）	139,012.19	0.16
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	847,906.22	0.96

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	019749	24 国债 15	7,000	708,894.03	0.80
2	118056	路维转债	1,390	139,012.19	0.16

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

浙江世纪华通集团股份有限公司因特定重大事项披露违规在本报告编制前一年内被中国证券监督管理委员会公开处罚，公开批评，责令改正；因特定重大事项披露违规在本报告编制前一年内被深圳证券交易所公开谴责等。

重庆农村商业银行股份有限公司因公司运作，治理违规在本报告编制前一年内被国家外汇管理局重庆市分局公开处罚，公开批评。

报告期内本基金投资的前十名证券发行主体除上述主体收到监管部门处罚决定书或行政监管措施决定书外，其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

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	52,569.25
2	应收清算款	1,021,826.78
3	应收股利	296,510.45
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,835.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,407,742.16

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。
- 2、报告期内没有需说明的证券投资决策程序。

§ 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 (%)
2,455	23,994.78	28,838,500.36	48.96	30,068,675.11	51.04

8.2 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	623,059.53	1.0577

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 12 月 29 日） 基金份额总额	223, 112, 505. 88
本报告期期初基金份额总额	31, 902, 031. 28
本报告期基金总申购份额	30, 582, 790. 06
减：本报告期基金总赎回份额	3, 577, 645. 87
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58, 907, 175. 47

注：报告期期间基金总申购份额含红利再投、转换入份额；基金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

本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2025 年 5 月 30 日发布公告，自 2025 年 5 月 29 日起，蒋利娟担任公司副总经理，代胜伟担任公司副总经理、财务负责人，金志刚不再兼任公司财务负责人，同时，由金志刚兼任公司首席信息官，朱伟不再担任公司首席信息官。

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

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

本报告期本基金无投资策略的变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自 2025 年 1 月 17 日起，本基金改聘审计服务机构，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为容诚会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已履行相关程序。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
天风证券	2	386,698,195.	50.44	161,896.51	50.61	-

		95				
国泰海通 证券	2	224,027,776. 46	29.22	93,673.28	29.28	-
招商证券	3	155,970,361. 86	20.34	64,313.83	20.11	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

交易单元租用券商选择的首要标准为符合监管机构相关规定，包括但不限于满足以下条件：

（一）合规风控能力较强，经营行为规范，近一年内无重大违规行为及风险事件，未受监管机构重大处罚；

（二）财务状况和经营状况良好；

（三）内部管理规范，具备健全的内控制度，在业内有良好的声誉；

（四）有较强的研究能力，能提供质量较高的市场研究报告，并能根据基金投资需求提供专门的研究报告；

（五）能及时提供准确的信息资讯服务；

（六）满足基金运作的保密要求；

（七）有较强的交易能力；

（八）符合中国证监会规定的其他条件。

本基金管理人依据以上标准，定期或者不定期对候选券商研究实力和服务质量进行评估，确定租用交易单元的券商，基金管理人与被选择的券商签订相关协议并通知托管行

3、本报告期内本基金租用券商交易单元变更情况：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
天风证券	-	-	113,500,000.00	48.13	-	-
国泰海通证券	699,860.00	100.00	19,800,000.00	8.40	-	-
招商证券	-	-	102,500,000.00	43.47	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（1）	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 18 日
2	泰康基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告（2）	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 1 月 18 日
3	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第四季度报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及	2025 年 1 月 21 日

		基金管理人网站	
4	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增泰康人寿保险有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 2 月 11 日
5	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 28 日
6	泰康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	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 3 月 29 日
7	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年“香港耶稣受难节、复活节”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 16 日
8	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增麦高证券有限责任公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 16 日
9	关于泰康基金管理有限公司旗下部分开放式基金新增华西证券股份有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 18 日
10	泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第一季度报告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 4 月 21 日
11	泰康基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 5 月 30 日
12	关于泰康基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年“香港特别行政区成立纪念日”期间不开放申购赎回等交易类业务的提示性公告	《证券时报》；中国证监会基金电子披露网站及基金管理人网站	2025 年 6 月 27 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20250220-20250630	0.00	28,838,500.36	0.00	28,838,500.36	48.96
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当本基金出现单一持有者持有基金份额比例达到或者超过 20%时，基金管理人将审慎确认大额申购与大额赎回，投资者将面对管理人拒绝或暂停申购的风险、暂停赎回或延缓支付赎回款项的风险、巨额赎回的风险，以及当管理人确认大额申购与大额赎回时，可能会对基金份额净值造成一定影响等特有风险。							

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

- （一）中国证监会准予泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金注册的文件；
- （二）《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- （三）《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》；
- （四）《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- （五）《泰康沪港深价值优选灵活配置混合型证券投资基金产品资料概要》。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可通过指定信息披露报纸（《证券时报》）或登录基金管理人网站（<http://www.tkfunds.com.cn>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅。

泰康基金管理有限公司

2025 年 8 月 28 日