金鹰主题优势混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 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 12
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 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 38
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 39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 45
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 46
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 46
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 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46

7.12 投资组合报告附注 46
§8 基金份额持有人信息 47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 47
8.2 盈利投资者数量占比 47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
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的情况 48
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 48
§9 开放式基金份额变动 48
§10 重大事件揭示 48
10.1 基金份额持有人大会决议 48
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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 49
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 49
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 50
10.9 其他重大事件 53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 54
11.1 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 55
12.3 查阅方式 55

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰主题优势混合型证券投资基金
基金简称	金鹰主题优势混合
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 20 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	57,668,840.06 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以追求资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，把握主题投资的脉络，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	本基金坚持“自上而下”为主、“自下而上”为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现“主题优势”这个核心理念，以主题情景分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏，优选并深挖不同阶段热点主题投资机会，优化资产配置，降低市场波动的冲击，扩大投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%＋中证全债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。一般情形下，其风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凡湘平	郭明
	联系电话	020-83936180	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888	95588
传真		020-83282856	010-66105798

注册地址	广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3212房	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510623	100140
法定代表人	姚文强	廖林

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	http://www.gefund.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	-2,204,890.89
本期利润	54,883,351.96
加权平均基金份额本期利润	0.8116
本期加权平均净值利润率	35.63%
本期基金份额净值增长率	41.07%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	91,281,215.97
期末可供分配基金份额利润	1.5829
期末基金资产净值	176,312,609.64
期末基金份额净值	3.057
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	205.70%

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；

2、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，指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（为期末余额，不是当期发生数）；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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
过去三个月	55.73%	1.93%	9.25%	0.94%	46.48%	0.99%
过去六个月	41.07%	1.69%	6.33%	0.85%	34.74%	0.84%
过去一年	58.31%	1.39%	20.06%	0.76%	38.25%	0.63%
过去三年	51.86%	1.45%	26.70%	0.83%	25.16%	0.62%
过去五年	32.28%	1.52%	3.68%	0.83%	28.60%	0.69%
过去七年	132.12%	1.57%	34.68%	0.87%	97.44%	0.70%
过去十年	158.63%	1.53%	61.22%	0.86%	97.41%	0.67%
自基金合同生效起至今	205.70%	1.64%	72.20%	1.00%	133.50%	0.64%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%＋中证全债指数收益率×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**

金鹰主题优势混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010 年 12 月 20 日至 2026 年 6 月 30 日）



注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%＋中证全债指数收益率×25%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。金鹰基金拥有一支经验丰富，风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 75 只。

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		
杨刚	本基金的基金经理，公司首席经济学家，权益研究部总经理	2022-04-26	-	29	杨刚先生，华中理工大学工学硕士。1996 年 7 月至 2001 年 5 月曾任大鹏证券有限责任公司综合研究所高级研究员和部门主管，2001 年 5 月至 2010 年 4 月曾任平安证券有限责任公司综合研究所高级研究员、部门主管和副所长，平安证券资产管理部执行总经理。2010 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，现任首席经济学家、权益研究部总经理、基金经理。
梁梓颖	本基金的基金经理，权益研究部副总经理	2026-03-13	-	10	梁梓颖女士，英国华威大学理学硕士。曾任职于广州越秀集团发展部。2015 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理，现任权益研究部副总经理、基金经理。
李龙杰	本基金的基金经理助理	2023-03-29	-	9	李龙杰先生，西南财经大学经济学硕士。2017 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理，现任权益投资部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，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

报告期内，公司严格执行证监会《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，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。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 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，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股行情在价格修复、外需高韧性的宏观环境下回暖，结构性机会集中于高景气 AI 产业链与高端出口制造，凸显中国制造全球竞争优势。

2026 年上半年中东地缘冲突扰动全球能源供给，催生阶段性滞胀、降低了流动性进一步宽松的可能性，但 AI 产业高景气主线未变，有色、高端制造盈利持续改善。

海外方面，年初美以伊冲突封锁霍尔木兹海峡，油价冲高至 90-120 美元，通胀抬升拖累增长，美联储全年从降息预期转向加息担忧，新任主席沃什偏鹰，全球宽松预期走弱；二季度局势缓和，油价回落至 72 美元，市场风险溢价下行。

国内方面，物价、产销数据整体向好，依靠出口与高端制造景气对冲内需压力，经济总体平稳运行。1-6 月 CPI 温和修复，上半年均值同比增长 1.0%；PPI 年初通缩持续收窄，3 月转正后逐月走高，上半年均值涨 1.5%；美元计价出口上半年累计同比增长 17.6%，AI、新能源拉动外需保持强势；规模以上工业企业利润上半年累计同比增长 18.7%，AI 与高端制造为核心增长动力。另一方面，经济结构分化明显，一季度地产小幅回暖，二季度内需走弱、地产再度筑底。货币政策保持适度宽松、侧重结构性工具，全年 LPR 维持 1 年期 3.0%、5 年期 3.5%不变。

本基金认为全球竞争力具备优势的高端制造业龙头会有更显著的盈利改善，保持高仓位，重点关注 AI 芯片、光通信、半导体设备等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值为 3.057 元，本报告期基金净值增长率为 41.07%，同期业绩比较基准增长率为 6.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国内经济方面，预计价格指标继续改善，工业盈利继续修复，出口和高技术制造维持韧性。国内政策环境总体偏积极。财政仍是稳增长抓手，重点落在“两重”、“六网”、城市更新、能源电网、算力网和民生服务等实物工作量方面。货币政策仍维持适度宽松。房地产行业或将在下半年逐步触底，消费企稳，新质生产力和内需的改善将齐头并进。

国外方面，美以伊战争仍有反复，全球原油价格仍然有波动风险，从而使流动性宽松受到约束。预计美联储政策将在维持利率和加息之间摇摆，降息可能性明显下降，意味着全球风险资产的折现率在美联储偏鹰政策的约束下运行。AI 经济方面，开源大模型的能力明显改善，导致大模型竞争格局更分散，价格和毛利率可能趋于下降，而有利于云、Harness 层和推理层的渗透率提升，从而带动上游硬件的需求增长更加可持续。

估值方面，当前各行业估值分化，高技术产业对应的行业估值处于中高位水平，而其他顺周期行业的估值处于中低水平。随着企业逐步盈利和在经济具备韧性的强现实情况下，权益市场的顺周期行业有望迎来盈利驱动的上涨。

我们认为伴随着长周期经济从底部爬升，实体经济的量、价在 2026-2027 年有改善预期，因此，盈利改善驱动的股价上涨趋势或将更明朗。本基金认为全球竞争力具备优势的高端制造业龙头会有更显著的盈利改善，本基金将会重点关注以下主线：一是 AI 与自主可控，尤其受益于渗透率提升而放量、且有订单与业绩兑现的算力硬件链；二是前期被错杀的有供需缺口的品种，或者对冲美以伊战争反复的品种，有色金属和化工，如铜、铝、钾肥、煤炭、新能源等。

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和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算

负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内无应当说明的预警事项。

§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，本基金托管人在对金鹰主题优势混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全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，金鹰主题优势混合型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰主题优势混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，金鹰主题优势混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰主题优势混合型证券投资基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资　产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,569,066.50	9,046,550.85
结算备付金		806,959.44	8,208.56
存出保证金		66,683.73	12,663.04
交易性金融资产	6.4.7.2	172,198,025.79	153,963,997.18
其中：股票投资		167,856,178.14	153,161,397.95
基金投资		-	-
债券投资		4,341,847.65	802,599.23
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		242,228.09	61,750.60
应收股利		-	-
应收申购款		134,708.41	24,733.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		178,017,671.96	163,117,903.87
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,608.54	-
应付赎回款		960,294.58	493,404.02
应付管理人报酬		158,066.56	165,370.08
应付托管费		26,344.44	27,561.70
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		90.68	54.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	558,657.52	263,535.06
负债合计		1,705,062.32	949,925.07
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	57,668,840.06	74,836,401.50
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	118,643,769.58	87,331,577.30
净资产合计		176,312,609.64	162,167,978.80
负债和净资产总计		178,017,671.96	163,117,903.87

注：截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日，本基金基金份额净值为 3.057 元，基金份额总额为 57,668,840.06 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		56,028,339.94	7,209,709.66
1.利息收入		15,930.40	16,504.20
其中：存款利息收入	6.4.7.9	15,930.40	16,504.20
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）		-1,087,164.39	3,769,327.72
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,465,777.81	1,762,823.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,369.88	7,728.00

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	369,243.54	1,998,775.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	57,088,242.85	3,414,329.52
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,331.08	9,548.22
减：二、营业总支出		1,144,987.98	1,351,349.23
1．管理人报酬		917,547.06	1,088,730.37
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		152,924.49	181,455.03
3．销售服务费		-	-
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7．税金及附加		33.26	-
8．其他费用	6.4.7.19	74,483.17	81,163.83
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**54,883,351.96**	**5,858,360.43**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**54,883,351.96**	**5,858,360.43**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		54,883,351.96	5,858,360.43

6.3 净资产变动表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	74,836,401.50	87,331,577.30	162,167,978.80
二、本期期初净资产	74,836,401.50	87,331,577.30	162,167,978.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-17,167,561.44	31,312,192.28	14,144,630.84

（一）、综合收益总额	-	54,883,351.96	54,883,351.96
（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）	-17,167,561.44	-23,571,159.68	-40,738,721.12
其中：1.基金申购款	3,093,241.19	4,026,892.25	7,120,133.44
2.基金赎回款	-20,260,802.63	-27,598,051.93	-47,858,854.56
（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	57,668,840.06	118,643,769.58	176,312,609.64
项目	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	112,499,563.43	96,331,020.60	208,830,584.03
二、本期期初净资产	112,499,563.43	96,331,020.60	208,830,584.03
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-21,387,488.85	-11,548,407.20	-32,935,896.05
（一）、综合收益总额	-	5,858,360.43	5,858,360.43
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-21,387,488.85	-17,406,767.63	-38,794,256.48
其中：1.基金申购款	2,512,619.54	2,273,429.52	4,786,049.06
2.基金赎回款	-23,900,108.39	-19,680,197.15	-43,580,305.54
（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	91,112,074.58	84,782,613.40	175,894,687.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰主题优势混合型证券投资基金（原名：金鹰主题优势股票型证券投资基金）（以下简称"本基金"）经中国证监会证监许可【2010】1480 号文核准《关于核准金鹰主题优势股票型证券投资基金募集的批复》批准募集，于 2010 年 12 月 20 日正式成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，设立募集规模为 2,051,271,200.80 份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司 。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰主题优势混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票（含存托凭证）、债券、权证，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。股票资产占基金总资产的比例为 60%～95%，其中，不低于 80%的股票资产将配置于投资主题驱动下的行业与上市公司，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金总资产的 5%～40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%～3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况、本报告期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其他会计政策、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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

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[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《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[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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《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[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《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》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施

条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其 他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

（1）对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

（2）自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金管理人运营本基金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%的规定征收率计算缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对 金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（3）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

（4）对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

（5）证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（6）对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

（7）对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,569,066.50
等于：本金	4,568,562.27
加：应计利息	504.23
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,569,066.50

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	128,659,062.04	-	167,856,178.14	39,197,116.10

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,303,077.85	38,317.65	4,341,847.65	452.15
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,303,077.85	38,317.65	4,341,847.65	452.15
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		132,962,139.89	38,317.65	172,198,025.79	39,197,568.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	840.11
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	385,417.41
其中：交易所市场	385,417.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	12,892.63

预提费用-信息披露费	159,507.37
合计	558,657.52

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	74,836,401.50	74,836,401.50
本期申购	3,093,241.19	3,093,241.19
本期赎回（以“-”号填列）	-20,260,802.63	-20,260,802.63
本期末	57,668,840.06	57,668,840.06

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	118,164,148.34	-30,832,571.04	87,331,577.30
本期期初	118,164,148.34	-30,832,571.04	87,331,577.30
本期利润	-2,204,890.89	57,088,242.85	54,883,351.96
本期基金份额交易产生的变动数	-24,678,041.48	1,106,881.80	-23,571,159.68
其中：基金申购款	4,558,074.59	-531,182.34	4,026,892.25
基金赎回款	-29,236,116.07	1,638,064.14	-27,598,051.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	91,281,215.97	27,362,553.61	118,643,769.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	15,200.75
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	669.33
其他	60.32
合计	15,930.40

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	563,814,223.05
减：卖出股票成本总额	564,433,764.45

减：交易费用	846,236.41
买卖股票差价收入	-1,465,777.81

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	9,242.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	127.63
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	9,369.88

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	201,058.90
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	200,084.37
减：应计利息总额	846.90
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	127.63

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	369,243.54
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	369,243.54

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1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	57,088,242.85
——股票投资	57,088,072.48
——债券投资	170.37
——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	57,088,242.85

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	10,973.64
转换费收入	357.44
合计	11,331.08

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	12,892.63
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

汇划手续费	2,083.17
合计	74,483.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	917,547.06	1,088,730.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	423,214.19	457,868.37
应支付基金管理人的净管理费	494,332.87	630,862.00

注：本基金基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费＝前一日基金资产净值 ×1.20%/ 当年天数

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。

管理费计算方法如下：

H＝E ×1.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	152,924.49	181,455.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%年费率计提。

托管费的计算方法如下：

H ＝E ×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
报告期初持有的基金份额	-	729,261.41
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	729,261.41
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.80%

注：本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	4,569,066.50	15,200.75	9,115,170.22	16,272.78

注：本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；本基金本报告期末清算备付金余额为 806,959.44 元，清算备付金利息收入为 669.33 元；上年度可比期间清算备付金期末余额为 107,662.85 元，清算备付金利息收入为 186.41 元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	创业板打新限售	46.08	463.33	201.00	9,262.08	93,129.33	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	33.00	2,702.04	52,282.89	-
001248	华润新能	2026-06-24	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	4,749.00	48,012.39	48,012.39	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	科创板打新限售	9.47	70.14	485.00	4,592.95	34,017.90	-
688797	臻宝科技	2026-06-16	6 个月	科创板打新限售	44.56	468.67	58.00	2,584.48	27,182.86	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6 个月	科创板打新限售	19.68	141.49	192.00	3,778.56	27,166.08	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	科创板打新限售	17.52	35.92	642.00	11,247.84	23,060.64	-

688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	科创板打新限售	40.98	308.19	67.00	2,745.66	20,648.73	-
001248	华润新能	2026-06-24	6 个交易日	新股未上市	10.11	10.11	2,035.00	20,573.85	20,573.85	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6 个月	创业板打新限售	69.66	160.06	127.00	8,846.82	20,327.62	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	科创板打新限售	92.18	463.15	39.00	3,595.02	18,062.85	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6 个月	新股锁定	7.82	20.74	600.00	4,692.00	12,444.00	-
301687	新广益	2025-12-24	6 个月	创业板打新限售	21.93	77.78	127.00	2,785.11	9,878.06	-
301669	高特电子	2026-06-02	6 个月	创业板打新限售	7.08	28.40	313.00	2,216.04	8,889.20	-
603459	红板科技	2026-03-31	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	89.00	1,575.30	7,504.48	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6 个月	创业板打新限售	24.68	86.80	85.00	2,097.80	7,378.00	-
301680	固德电材	2026-02-27	6 个月	创业板打新限售	58.00	112.16	48.00	2,784.00	5,383.68	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	创业板打新限售	26.66	50.96	87.00	2,319.42	4,433.52	-
688816	易思维	2026-02-04	6 个月	科创板打新限售	55.95	57.10	63.00	3,524.85	3,597.30	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6 个月	创业板打	78.38	121.77	29.00	2,273.02	3,531.33	-

				新限售						
001237	惠康科技	2026-05-15	6 个月	新股锁定	53.26	58.74	57.00	3,035.82	3,348.18	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	61.00	961.36	2,849.31	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股锁定	11.18	17.59	147.00	1,643.46	2,585.73	-
603352	至信股份	2026-01-08	6 个月	新股锁定	21.88	25.52	56.00	1,225.28	1,429.12	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	39.00	1,092.00	1,083.42	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	31.00	1,174.28	1,080.97	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	24.00	803.76	814.32	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

1、风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

3、监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，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控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

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、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,569,066.50	-	-	-	4,569,066.50
结算备付金	806,959.44	-	-	-	806,959.44
存出保证金	66,683.73	-	-	-	66,683.73
交易性金融资产	4,341,847.65	-	-	167,856,178.14	172,198,025.79
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	242,228.09	242,228.09
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	134,708.41	134,708.41
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,784,557.32	-	-	168,233,114.64	178,017,671.96
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	1,608.54	1,608.54
应付赎回款	-	-	-	960,294.58	960,294.58
应付管理人报酬	-	-	-	158,066.56	158,066.56
应付托管费	-	-	-	26,344.44	26,344.44
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	90.68	90.68
应付利润	-	-	-	-	-

其他负债	-	-	-	558,657.52	558,657.52
负债总计	-	-	-	1,705,062.32	1,705,062.32
利率敏感度缺口	9,784,557.32	-	-	166,528,052.32	176,312,609.64
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	9,046,550.85	-	-	-	9,046,550.85
结算备付金	8,208.56	-	-	-	8,208.56
存出保证金	12,663.04	-	-	-	12,663.04
交易性金融资产	802,599.23	-	-	153,161,397.95	153,963,997.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	61,750.60	61,750.60
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	24,733.64	24,733.64
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	9,870,021.68	-	-	153,247,882.19	163,117,903.87
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	493,404.02	493,404.02
应付管理人报酬	-	-	-	165,370.08	165,370.08
应付托管费	-	-	-	27,561.70	27,561.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	54.21	54.21
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	263,535.06	263,535.06
负债总计	-	-	-	949,925.07	949,925.07
利率敏感度缺口	9,870,021.68	-	-	152,297,957.12	162,167,978.8

					0

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-3,730.64	-1,560.56
	利率下降 25 个基点	3,744.64	1,572.79

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	167,856,178.14	95.20	153,161,397.95	94.45
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	167,856,178.14	95.20	153,161,397.95	94.45

注：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，主要涉及股票、可转债、可交换债、权证等交易性金

融资产。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	12,172,872.99	12,253,598.50
	业绩比较基准变动-5%	-12,172,872.99	-12,253,598.50

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层次可分为：

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	167,395,482.38	152,077,992.07
第二层次	4,410,433.89	1,480,365.23
第三层次	392,109.52	405,639.88
合计	172,198,025.79	153,963,997.18

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

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、或属于非公开发行等情况，本基金分别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二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

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，本基金无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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	167,856,178.14	94.29
	其中：股票	167,856,178.14	94.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,341,847.65	2.44
	其中：债券	4,341,847.65	2.44
	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	5,376,025.94	3.02
8	其他各项资产	443,620.23	0.25
9	合计	178,017,671.96	100.00

注：其他各项资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。

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	12,444.00	0.01
C	制造业	149,451,028.73	84.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,586.24	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	3,776,197.62	2.14
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,058,107.87	6.84
J	金融业	2,482,300.00	1.41
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	7,513.68	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	167,856,178.14	95.20

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	688200	华峰测控	17,300	9,084,230.00	5.15
2	688233	神工股份	41,141	8,821,453.22	5.00
3	688630	芯碁微装	15,971	8,774,307.69	4.98
4	688702	盛科通信	20,613	8,038,863.87	4.56
5	603061	金海通	13,985	7,023,546.70	3.98

6	688146	中船特气	19,517	6,830,754.83	3.87
7	300502	新易盛	10,220	6,203,540.00	3.52
8	603306	华懋科技	57,900	6,003,651.00	3.41
9	300236	上海新阳	42,800	5,628,200.00	3.19
10	301629	矽电股份	11,800	5,078,720.00	2.88
11	300408	三环集团	30,100	5,023,690.00	2.85
12	000811	冰轮环境	88,900	4,997,958.00	2.83
13	600378	昊华科技	66,300	4,997,694.00	2.83
14	002536	飞龙股份	104,800	4,944,464.00	2.80
15	688002	睿创微纳	29,590	4,577,277.10	2.60
16	000657	中钨高新	44,200	4,230,824.00	2.40
17	300806	斯迪克	37,000	4,144,000.00	2.35
18	688231	隆达股份	109,490	4,021,567.70	2.28
19	688141	杰华特	26,184	4,019,244.00	2.28
20	603678	火炬电子	46,700	3,876,100.00	2.20
21	002859	洁美科技	35,100	3,843,801.00	2.18
22	603162	海通发展	420,860	3,775,114.20	2.14
23	002484	江海股份	34,700	3,643,500.00	2.07
24	002353	杰瑞股份	22,300	3,400,750.00	1.93
25	600176	中国巨石	39,800	2,900,624.00	1.65
26	603308	应流股份	47,800	2,887,120.00	1.64
27	688549	中巨芯	74,781	2,752,688.61	1.56
28	300033	同花顺	10,300	2,482,300.00	1.41
29	300857	协创数据	6,700	2,277,330.00	1.29
30	002138	顺络电子	27,600	2,017,560.00	1.14
31	300776	帝尔激光	9,200	1,977,632.00	1.12
32	603757	大元泵业	24,700	1,871,272.00	1.06
33	300308	中际旭创	1,400	1,778,000.00	1.01
34	688126	沪硅产业	44,490	1,774,706.10	1.01
35	002957	科瑞技术	30,300	1,661,652.00	0.94
36	002837	英维克	19,700	1,567,332.00	0.89
37	603663	三祥新材	15,800	1,521,540.00	0.86
38	605376	博迁新材	5,000	1,356,500.00	0.77
39	688503	聚和材料	9,834	1,304,971.80	0.74
40	301338	凯格精机	7,300	1,189,097.00	0.67
41	688808	联讯仪器	324	728,080.92	0.41
42	603078	江化微	14,500	716,590.00	0.41
43	688783	西安奕材	10,970	679,262.40	0.39
44	300672	国科微	2,200	649,000.00	0.37
45	002636	金安国纪	3,400	407,898.00	0.23
46	688797	臻宝科技	571	381,209.29	0.22
47	300024	机器人	18,400	355,672.00	0.20
48	000636	风华高科	4,500	325,080.00	0.18
49	688598	金博股份	6,560	324,392.00	0.18

50	688635	长进光子	665	292,439.73	0.17
51	301669	高特电子	3,124	124,505.63	0.07
52	603005	晶方科技	1,800	96,966.00	0.05
53	301666	大普微	201	93,129.33	0.05
54	001248	华润新能源	6,784	68,586.24	0.04
55	688818	电科蓝天	485	34,017.90	0.02
56	688809	强一股份	46	28,658.00	0.02
57	688820	盛合晶微	192	27,166.08	0.02
58	688807	优迅股份	67	26,962.81	0.02
59	688712	北芯生命	642	23,060.64	0.01
60	301682	宏明电子	127	20,327.62	0.01
61	688785	恒运昌	39	18,062.85	0.01
62	001257	盛龙股份	600	12,444.00	0.01
63	688795	摩尔线程	17	12,180.33	0.01
64	301687	新广益	127	9,878.06	0.01
65	688802	沐曦股份	11	9,111.30	0.01
66	301667	纳百川	120	8,678.40	0.00
67	688805	健信超导	183	8,595.51	0.00
68	603459	红板科技	89	7,504.48	0.00
69	301696	三瑞智能	85	7,378.00	0.00
70	301680	固德电材	48	5,383.68	0.00
71	301449	天溯计量	131	5,069.70	0.00
72	301513	尚水智能	87	4,433.52	0.00
73	688816	易思维	63	3,597.30	0.00
74	301683	慧谷新材	29	3,531.33	0.00
75	001369	双欣环保	252	3,407.04	0.00
76	001237	惠康科技	57	3,348.18	0.00
77	603248	锡华科技	146	3,079.14	0.00
78	603435	嘉德利	61	2,849.31	0.00
79	603376	大明电子	111	2,750.58	0.00
80	601112	振石股份	147	2,585.73	0.00
81	688790	昂瑞微	19	2,542.77	0.00
82	688765	禾元生物	48	2,448.00	0.00
83	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
84	603418	友升股份	47	2,075.99	0.00
85	001285	瑞立科密	44	1,809.72	0.00
86	603352	至信股份	56	1,429.12	0.00
87	001220	世盟股份	39	1,083.42	0.00
88	603284	林平发展	31	1,080.97	0.00
89	603293	埃泰克	24	814.32	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	688702	盛科通信	15,430,217.57	9.51
2	688630	芯碁微装	12,373,706.49	7.63
3	601288	农业银行	10,670,481.00	6.58
4	688531	日联科技	9,821,824.56	6.06
5	600988	赤峰黄金	9,516,781.00	5.87
6	688260	昀冢科技	8,934,284.41	5.51
7	600188	兖矿能源	8,611,278.60	5.31
8	688200	华峰测控	8,397,475.24	5.18
9	300835	龙磁科技	8,342,285.00	5.14
10	601328	交通银行	7,833,119.00	4.83
11	002979	雷赛智能	7,831,342.00	4.83
12	300747	锐科激光	7,435,026.00	4.58
13	300811	铂科新材	7,405,497.00	4.57
14	603067	振华股份	7,344,270.83	4.53
15	688390	固德威	7,175,358.79	4.42
16	001203	大中矿业	7,139,366.01	4.40
17	002957	科瑞技术	6,785,617.00	4.18
18	603061	金海通	6,678,877.05	4.12
19	002281	光迅科技	6,629,643.00	4.09
20	600487	亨通光电	6,233,137.00	3.84
21	688106	金宏气体	6,140,237.33	3.79
22	603306	华懋科技	6,001,994.00	3.70
23	688231	隆达股份	5,886,402.66	3.63
24	000688	国城矿业	5,808,142.00	3.58
25	300438	鹏辉能源	5,662,170.00	3.49
26	300502	新易盛	5,537,869.00	3.41
27	301629	矽电股份	5,534,450.13	3.41
28	000657	中钨高新	5,487,778.00	3.38
29	603162	海通发展	5,403,497.00	3.33
30	688221	前沿生物	5,360,137.43	3.31
31	600345	长江通信	5,224,933.00	3.22
32	601939	建设银行	4,727,766.00	2.92
33	601988	中国银行	4,694,384.00	2.89
34	688233	神工股份	4,647,558.18	2.87
35	688146	中船特气	4,594,187.79	2.83

36	603618	杭电股份	4,558,792.00	2.81
37	688700	东威科技	4,525,565.20	2.79
38	300236	上海新阳	4,345,755.00	2.68
39	002536	飞龙股份	4,339,342.00	2.68
40	002384	东山精密	4,334,464.00	2.67
41	600498	烽火通信	4,215,879.00	2.60
42	300408	三环集团	4,197,439.00	2.59
43	688409	富创精密	4,175,316.83	2.57
44	600773	西藏城投	4,091,995.00	2.52
45	688361	中科飞测	4,075,779.42	2.51
46	301338	凯格精机	4,052,719.40	2.50
47	300390	天华新能	4,030,263.00	2.49
48	000811	冰轮环境	3,984,387.00	2.46
49	603678	火炬电子	3,901,799.24	2.41
50	001389	广合科技	3,841,437.00	2.37
51	300308	中际旭创	3,759,504.00	2.32
52	688625	呈和科技	3,726,207.18	2.30
53	000962	东方钽业	3,682,838.00	2.27
54	002484	江海股份	3,624,984.00	2.24
55	688002	睿创微纳	3,621,999.34	2.23
56	600378	昊华科技	3,558,079.00	2.19
57	300443	金雷股份	3,467,334.00	2.14
58	688521	芯原股份	3,465,458.82	2.14
59	300666	江丰电子	3,423,236.00	2.11
60	300806	斯迪克	3,323,589.00	2.05

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688531	日联科技	13,103,593.74	8.08
2	688702	盛科通信	11,135,614.66	6.87
3	601288	农业银行	10,976,089.00	6.77
4	600276	恒瑞医药	10,635,436.00	6.56
5	600988	赤峰黄金	9,958,726.00	6.14
6	688260	昀冢科技	9,714,186.81	5.99
7	300750	宁德时代	9,239,764.00	5.70
8	300747	锐科激光	9,171,465.10	5.66
9	300835	龙磁科技	9,115,881.00	5.62
10	000768	中航西飞	8,813,650.16	5.43
11	002281	光迅科技	8,636,742.51	5.33

12	601328	交通银行	8,294,367.00	5.11
13	601318	中国平安	8,083,787.00	4.98
14	601888	中国中免	7,942,750.00	4.90
15	002979	雷赛智能	7,818,476.00	4.82
16	688066	航天宏图	7,806,500.41	4.81
17	300811	铂科新材	7,775,257.69	4.79
18	601633	长城汽车	7,663,096.00	4.73
19	600487	亨通光电	7,550,345.00	4.66
20	688390	固德威	7,488,028.93	4.62
21	603067	振华股份	7,430,345.80	4.58
22	300498	温氏股份	7,336,841.00	4.52
23	600519	贵州茅台	7,312,239.00	4.51
24	600188	兖矿能源	7,281,369.20	4.49
25	600132	重庆啤酒	7,085,688.00	4.37
26	002957	科瑞技术	6,910,050.00	4.26
27	600345	长江通信	6,836,482.00	4.22
28	300059	东方财富	6,809,184.28	4.20
29	001203	大中矿业	6,759,610.00	4.17
30	002739	万达电影	6,704,932.50	4.13
31	688106	金宏气体	6,569,323.30	4.05
32	688630	芯碁微装	6,485,626.47	4.00
33	300438	鹏辉能源	6,175,487.72	3.81
34	000688	国城矿业	5,916,298.00	3.65
35	688409	富创精密	5,685,945.89	3.51
36	002384	东山精密	5,558,211.00	3.43
37	603618	杭电股份	5,075,253.00	3.13
38	688361	中科飞测	5,068,719.75	3.13
39	688221	前沿生物	5,066,404.83	3.12
40	601988	中国银行	4,990,504.00	3.08
41	300308	中际旭创	4,945,623.00	3.05
42	601939	建设银行	4,869,085.00	3.00
43	688200	华峰测控	4,750,441.89	2.93
44	000962	东方钽业	4,503,015.00	2.78
45	688700	东威科技	4,385,276.33	2.70
46	300390	天华新能	4,321,832.00	2.67
47	002008	大族激光	4,179,068.00	2.58
48	600498	烽火通信	4,151,462.00	2.56
49	688625	呈和科技	4,145,553.35	2.56
50	001389	广合科技	4,078,037.68	2.51
51	300124	汇川技术	3,932,533.00	2.42
52	300666	江丰电子	3,764,063.00	2.32
53	301150	中一科技	3,567,972.00	2.20
54	688521	芯原股份	3,533,181.05	2.18
55	603061	金海通	3,522,110.00	2.17

56	300033	同花顺	3,351,213.00	2.07
57	603078	江化微	3,296,860.00	2.03
58	002756	永兴材料	3,281,718.00	2.02

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	522,040,472.16
卖出股票收入（成交）总额	563,814,223.05

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,341,847.65	2.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,341,847.65	2.46

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019792	25 国债 19	34,000.00	3,436,013.92	1.95
2	019827	26 国债 01	9,000.00	905,833.73	0.51

注：本基金本报告期末仅持有 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

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

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	66,683.73
2	应收清算款	242,228.09

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	134,708.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	443,620.23

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不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
21,450	2,688.52	1,040.99	-	57,667,799.07	100.00%

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	97.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	142,835.58	0.25%

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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 12 月 20 日）基金份额总额	2,051,271,200.80
本报告期期初基金份额总额	74,836,401.50
本报告期基金总申购份额	3,093,241.19
减：本报告期基金总赎回份额	20,260,802.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	57,668,840.06

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

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、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期，管理人未受到调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，管理人高级管理人员及相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	88,888,696.90	8.19%	40,524.50	8.19%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	51,318,476.23	4.73%	23,397.76	4.73%	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	30,336,094.68	2.80%	13,830.41	2.80%	-
华福证券	1	333,344,883.85	30.72%	151,973.86	30.72%	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	8,455,086.08	0.78%	3,855.48	0.78%	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	12,833,590.77	1.18%	5,850.46	1.18%	-
西部证券	1	89,859,413.93	8.28%	40,966.95	8.28%	-
兴业证券	1	27,563,494.93	2.54%	12,566.38	2.54%	-
粤开证券（联讯）	1	132,513,948.16	12.21%	60,413.92	12.21%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	1	231,678,031.35	21.35%	105,618.94	21.35%	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券（安信）	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	15,778,150.64	1.45%	7,193.13	1.45%	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	29,769,721.22	2.74%	13,572.19	2.74%	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	4	32,897,462.75	3.03%	14,997.81	3.03%	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的专用交易单元。本基金专用交易单元的选择标准如下：

（1）财务状况良好；

（2）经营行为规范，最近一年相关业务未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；

（3）具备较强的合规风控能力，包括具有较完备的内控制度、内部管理流程体系及信息系统建设等；

（4）具备较强的交易能力或者研究服务能力，包括配备充足人员、交易系统稳定或能够提供具有针对性的较高质量研究成果等。

本基金专用交易单元的选择程序如下：

（1）本基金管理人根据上述标准考察后初步确定选用交易单元的证券公司；

（2）由研究部门统筹安排与提供证券交易服务的证券公司签订相关服务协议并发起相关流程；

（3）经研究部门分管领导、合规风控部人员、督察长及总经理审批后予以执行。

本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	901,069.00	23.08%	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	100,087.00	2.56%	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券（联讯）	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	1,000,606.00	25.63%	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

国投证券（安信）	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	1,901,654.00	48.72%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-01-13
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-01-16
3	金鹰主题优势混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会规定媒介	2026-01-22
4	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-01-22
5	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京汇成基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2026-01-29
6	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2026-02-12
7	金鹰主题优势混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定媒介	2026-03-13
8	金鹰主题优势混合型证券投资基金更新的招募说明书	证监会规定媒介	2026-03-18
9	金鹰主题优势混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-03-18
10	金鹰主题优势混合型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会规定媒介	2026-03-31
11	金鹰基金管理有限公司旗下公募基金通过证	证监会规定媒介	2026-03-31

	券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)		
12	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-03-31
13	金鹰基金管理有限公司关于网上交易、微信理财宝系统暂停服务的公告	证监会规定媒介	2026-04-02
14	金鹰主题优势混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会规定媒介	2026-04-22
15	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-04-22
16	金鹰基金管理有限公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露	证监会规定媒介	2026-04-30
17	金鹰主题优势混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
18	金鹰基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2026-05-29
19	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-06-24
20	金鹰主题优势混合型证券投资基金基金合同更新	证监会规定媒介	2026-06-26
21	金鹰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	证监会规定媒介	2026-06-26

注：相关信息披露文件请通过本基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站及规定报刊查询。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2026 年 7 月 27 日起调整基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订，详见本基金管理人于 2026 年 6 月 26 日发布的《金鹰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》及其后续相关公告。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1.中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
2.《金鹰主题优势混合型证券投资基金基金合同》。
3.《金鹰主题优势混合型证券投资基金托管协议》。
4.金鹰基金管理有限公司批准成立批件和营业执照。

5.基金托管人业务资格批件和营业执照。

6.本报告期内在规定媒介公开披露的公告。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：http://www.gefund.com.cn。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日