嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:嘉合基金管理有限公司

基金托管人:渤海银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
§5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见 14
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 17
6.4 报表附注 19
§7 投资组合报告 48
7.1 期末基金资产组合情况 48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 48
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 49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 60
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 60
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 60
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 60
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 60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 61
7.12 投资组合报告附注 61
§8 基金份额持有人信息 62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 62

8.2 盈利投资者数量占比 62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 63
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 63
§9 开放式基金份额变动 64
§10 重大事件揭示 64
10.1 基金份额持有人大会决议 64
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 64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 64
10.4 基金投资策略的改变 64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 65
10.8 其他重大事件 66
§11 影响投资者决策的其他重要信息 67
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 67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 67
§12 备查文件目录 67
12.1 备查文件目录 67
12.2 存放地点 68
12.3 查阅方式 68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金	
基金简称	嘉合睿金混合	
基金主代码	005090	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年03月13日	
基金管理人	嘉合基金管理有限公司	
基金托管人	渤海银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	84,002,043.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
下属分级基金的交易代码	005090	005091
报告期末下属分级基金的份额总额	45,337,240.91份	38,664,802.17份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险的前提下，谋求基金资产的长期、稳定增值。
投资策略	本基金将秉持战略和战术资产配置理念，通过稳健管理的多策略投资系统，在控制市场风险、尽量降低净值波动风险并满足流动性的前提下，动态投资于股票、债券、现金及现金等价物等资产品种并运用股指期货等各种金融工具提高收益率。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		嘉合基金管理有限公司	渤海银行股份有限公司
信息披	姓名	崔为中	丁晓光

露负责人	联系电话	021-60168288	022-58314940
	电子邮箱	cuiweizhong@haoamc.com	xg.ding@cbhb.com.cn
客户服务电话		400-0603-299	95541
传真		021-65015077	022-58314791
注册地址		上海市虹口区广纪路738号1幢329室	天津市河东区海河东路218号
办公地址		上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼	天津市河东区海河东路218号
邮政编码		200082	300012
法定代表人		魏超	王锦虹

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.haoamc.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	嘉合基金管理有限公司	上海市杨浦区秦皇岛路32号A楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026年01月01日-2026年06月30日)	
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
本期已实现收益	24,581,782.03	24,331,413.09
本期利润	41,552,460.15	32,001,750.68

加权平均基金份额本期利润	1.4233	1.3447
本期加权平均净值利润率	67.38%	62.32%
本期基金份额净值增长率	87.20%	86.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	87,059,978.70	67,381,791.27
期末可供分配基金份额利润	1.9203	1.7427
期末基金资产净值	141,149,876.23	113,202,804.20
期末基金份额净值	3.1133	2.9278
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	297.14%	274.10%

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、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、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（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉合睿金混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	89.85%	3.29%	7.39%	0.76%	82.46%	2.53%
过去六个月	87.20%	3.18%	4.89%	0.68%	82.31%	2.50%
过去一年	177.50%	3.09%	15.68%	0.61%	161.82%	2.48%
过去三年	107.66%	2.78%	19.80%	0.66%	87.86%	2.12%
过去五年	76.31%	2.35%	0.58%	0.66%	75.73%	1.69%

过去七年	285.10%	2.14%	22.21%	0.69%	262.89%	1.45%
自基金合同生效起至今	297.14%	2.10%	23.59%	0.70%	273.55%	1.40%

嘉合睿金混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	89.48%	3.29%	7.39%	0.76%	82.09%	2.53%
过去六个月	86.46%	3.18%	4.89%	0.68%	81.57%	2.50%
过去一年	175.27%	3.09%	15.68%	0.61%	159.59%	2.48%
过去三年	102.73%	2.78%	19.80%	0.66%	82.93%	2.12%
过去五年	69.37%	2.35%	0.58%	0.66%	68.79%	1.69%
过去七年	263.65%	2.14%	22.21%	0.69%	241.44%	1.45%
自基金合同生效起至今	274.10%	2.10%	23.59%	0.70%	250.51%	1.40%

3.2.2 自基金转型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



注：1、本基金于2019年3月13日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来。
2、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。



注：1、本基金于2019年3月13日由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"转型而来。
2、截至本报告期末，本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

嘉合基金管理有限公司（以下简称"嘉合基金"或"公司"）是经中国证监会[2014]621号文许可，依法设立的全国性基金管理公司。2014年08月08日，嘉合基金正式公告成立于上海，经营范围包括基金募集、基金销售、资产管理、特定客户资产管理和中国证监会许可的其他业务。

嘉合基金股东为中航信托股份有限公司、上海慧弘实业集团有限公司、福建圣农控股集团有限公司、广东万和集团有限公司、山东通汇资本投资集团有限公司及北京智勇仁信投资咨询有限公司。主要股东为中航信托股份有限公司和上海慧弘实业集团有限公司，持股比例均为27.27%。

嘉合基金投研团队汇聚众多行业精英，团队成员不仅具有良好的教育背景，而且具备多年金融行业从业经历，积累了丰富的投资管理经验，从而以战略性的思维和国际化的眼光，敏锐把握市场变化。截至2026年06月30日，公司注册资本金为人民币3亿元。

截至2026年06月30日，嘉合基金旗下共管理24只公募基金，包括嘉合货币市场基金、嘉合磐石混合型证券投资基金、嘉合磐通债券型证券投资基金、嘉合睿金混合型发起式证券投资基金、嘉合磐稳纯债债券型证券投资基金、嘉合锦程价值精选混合型证券投资基金、嘉合锦创优势精选混合型证券投资基金、嘉合磐泰短债债券型证券投资基金、嘉合磐昇纯债债券型证券投资基金、嘉合锦鹏添利混合型证券投资基金、嘉合同顺智选股票型证券投资基金、嘉合慧康63个月定期开放债券型证券投资基金、嘉合稳健增长灵活配置混合型证券投资基金、嘉合锦元回报混合型证券投资基金、嘉合锦明混合型证券投资基金、嘉合磐固一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐立一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合锦鑫混合型证券投资基金、嘉合磐弘一年定期开放纯债债券型发起式证券投资基金、嘉合磐恒债券型证券投资基金、嘉合磐益纯债债券型证券投资基金、嘉合胶东经济圈中高等级信用债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、嘉合锦荣混合型证券投资基金及嘉合磐辉纯债债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陶棣溦	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金的基金经理。	2023-07-07	-	8年	美国马里兰大学帕克分校公共政策硕士，2018年10月加入嘉合基金管理有限公司。

注：1、陶棣溦的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从中国证监会《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《证券法》、《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效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，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规和公司内部公平交易制度的规定，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，确保旗下管理的所有投资组合得到公平对待。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

本报告期内，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未超过该证券当日成交量的5%。

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

回顾2026年上半年，A股市场整体呈现出“一季度宽幅震荡蓄势、二季度迎来业绩驱动型主升浪”的鲜明演进特征：

一季度（预期博弈与震荡筑底）：1月市场延续跨年热度，成交量一度放量突破4万亿后温和回落，热点快速轮动；2月受春节长假与两会前瞻预期影响，市场转入震荡整固；3月受外围地缘局势突变与避险情绪升温影响，市场经历了阶段性的流动性冲击与二次探底，但政策托底信号明确，市场底部支撑坚实。

二季度（基本面兑现与主线爆发）：随着财报季展开，市场全面由前期的“炒预期”转向“看业绩”。在以Agentic AI（智能体）为代表的技术加速落地与全球算力Capex持续超预期的催化下，科技硬核心板块走出凌厉的“业绩驱动型”主升浪。5月上旬TMT板块量价触及阶段极值后进入良性回踩，6月在中报业绩预告前夕展开了充分的震荡整固与结构去伪存真。

本基金始终坚守“管理概率而非预测市场”的投资哲学，以“流动性与市场情绪决定PE（估值），基本面与产业趋势决定EPS（业绩）”为底层投研逻辑，核心目标是追求在严格控制回撤的前提下做好成长股投资，为持有人实现可持续的成长型复利。在2026年上半年的实际运作中，主要执行了以下投资策略：深度卡位AI全产业链“四力”基建：紧扣产业发展的主要矛盾切换，坚决在产业由“概念向落地转移”的40-60分位数黄金阶段重仓配置。重点加仓了订单能见度高、进入商业闭环的传力（1.6T高速光模块/CPO）、算力（国产芯片）、存力（先进存储/HBM）以及电力（AI离网供电/电网设备）等核心硬件龙头。战略配置自主可控与新质生产力：面对外围技术封锁与供应链重塑，组合系统性加配了订单饱满、技术壁垒高的半导体先进制程设备与关键材料龙头，并前瞻性布局了具备全球竞争优势的商业航天及人形机器人核心零部件标的。

仓位动态调整与“去伪存真”：一季度面对外围冲击与市场波动，基金维持高仓位坚守核心硬科技底仓；二季度在充分享受主升浪带来的净值大幅增长后，基金于6月末采取逢高锁定部分利润、防范高位分化的主动策略，将仓位适度优化调整；坚决剔除缺乏业绩兑现能力的纯概念品种，并配置部分现金流稳健、高分红的科技央国企蓝筹作为“防守压舱石”，实现了组合进攻与防御的动态平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末嘉合睿金混合A基金份额净值为3.1133元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为87.20%，同期业绩比较基准收益率为4.89%；截至报告期末嘉合睿金混合C基金份额净值为2.9278元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为86.46%，同期业绩比较基准收益率为4.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年下半年，我们认为宏观经济与资本市场环境整体偏向积极与温和：宏观政策与流动性方面,国内财政与货币政策协同发力，对资本市场平稳发展的呵护态度明确，流动性环境整体维持合理充裕，全市场日均成交中枢处于活跃区间。市场风格特征方面,下半年市场审美品味将完成由“情绪博弈”向“业绩驱动”的切换。年中中报大考之后，缺乏真实业绩支撑的板块将面临持续的估值整固，而拥有真实订单倒逼、产能供不应求、EPS持续超预期的高景气科技龙头将进一步凸显阿尔法溢价。

2026年下半年，本基金将继续坚持“成长为先、风控为本、业绩至上”的原则，重点围绕以下三条主线：核心主线：AI基础设施业绩兑现与应用扩散（AI+ 全产业链）硬件基础设施：死守业绩兑现度最高的算力、传力、存力与电力“四力”全产业链，重点聚焦1.6T光通信、高密度PCB、先进制程芯片及AI电力解决方案龙头；软件与端侧应用：密切跟踪Agentic AI在B端工作流与C端软硬件（AI PC、智能手机、智能驾驶）的渗透拐点，捕捉产业价值向应用侧转移的超额收益。

战略方向：先进制程自主可控与高端制造持续深挖半导体产业链“卡脖子”环节，关注受益于国内晶圆厂扩产周期、订单排期长且业绩高增长的半导体设备及高端材料领军企业；跟踪商业航天密集发射窗口期催化以及人形机器人量产进程，优选具备全球技术壁垒和成本优势的优质零部件供应商。价值底仓：低估值稳健科技蓝筹严格筛选现金流充沛、受益于市值管理政策、分红意愿持续提升的高质量科技蓝筹与核心资源品等，以平滑潜在的宏观扰动与季度流动性波动。

投资是一场管理概率与认知的长期长跑。2026年上半年的运作再次印证了坚守产业趋势与扎实基本面的力量。面对下半年的市场机遇与挑战，我们将时刻保持对市场的敬畏与敏锐，严格执行投资纪律，通过证据网络持续去伪存真，希望在控制组合下行风险的前提下，全力以赴为持有人挖掘并分享中国科技升级时代的长期复合增长红利！

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设立估值委员会，估值委员会成员具有丰富的基金及相关行业工作经验、专业技术技能，并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、修订本基金管理人管理的基金的估值政策、程序和技术，确保基金估值的公允与合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定，本基金的收益分配原则为：投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资，若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无需要说明的相关情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，渤海银行股份有限公司（以下称“本基金托管人”）在对嘉合睿金混合型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在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，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本基金托管人对本报告中财务指标、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，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	49,971,703.70	5,271,897.30
结算备付金		-	-
存出保证金		15,119,365.93	3,341,699.61
交易性金融资产	6.4.7.2	174,774,772.38	42,098,942.33
其中：股票投资		174,774,772.38	42,098,942.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		23,046,210.66	701,685.08

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	658.55	658.55
资产总计		262,912,711.22	51,414,882.87
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		8,225,644.91	1,563,898.94
应付管理人报酬		207,606.71	49,828.21
应付托管费		17,300.56	4,152.35
应付销售服务费		68,599.37	18,657.59
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	40,879.24	120,208.47
负债合计		8,560,030.79	1,756,745.56
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	84,002,043.08	30,729,461.07
未分配利润	6.4.7.8	170,350,637.35	18,928,676.24
净资产合计		254,352,680.43	49,658,137.31
负债和净资产总计		262,912,711.22	51,414,882.87

注：报告截止日2026年6月30日，嘉合睿金混合A份额净值3.1133元，基金份额总额45,337,240.91份，嘉合睿金混合C份额净值2.9278元，基金份额总额38,664,802.17份，总份额合计84,002,043.08份。

6.2 利润表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		74,502,479.76	-4,105,227.36
1.利息收入		18,550.08	15,809.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	18,550.08	15,809.79
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）		46,382,868.11	-7,298,399.27
其中：股票投资收益	6.4.7.10	46,281,655.46	-7,488,141.04
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	2,583.04	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	98,629.61	189,741.77
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	24,641,015.71	2,749,684.80
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	3,460,045.86	427,677.32

减：二、营业总支出		948,268.93	721,773.37
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	656,276.53	437,184.98
2.托管费	6.4.10.2.2	54,689.66	36,432.10
3.销售服务费	6.4.10.2.3	197,629.67	193,608.32
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	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		1.49	-
8.其他费用	6.4.7.20	39,671.58	54,547.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		73,554,210.83	-4,827,000.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		73,554,210.83	-4,827,000.73
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		73,554,210.83	-4,827,000.73

6.3 净资产变动表

会计主体：嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	30,729,461.07	18,928,676.24	49,658,137.31
二、本期期初净资产	30,729,461.07	18,928,676.24	49,658,137.31
三、本期增减变动	53,272,582.01	151,421,961.11	204,694,543.12

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	73,554,210.83	73,554,210.83
（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）	53,272,582.01	77,867,750.28	131,140,332.29
其中：1.基金申购款	306,185,871.80	395,530,476.04	701,716,347.84
2.基金赎回款	-252,913,289.79	-317,662,725.76	-570,576,015.55
（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	84,002,043.08	170,350,637.35	254,352,680.43
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	51,288,999.13	5,547,337.86	56,836,336.99
二、本期期初净资产	51,288,999.13	5,547,337.86	56,836,336.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,746,188.19	628,526.87	23,374,715.06
（一）、综合收益总额	-	-4,827,000.73	-4,827,000.73
（二）、本期基金份额交易产生的净	22,746,188.19	5,455,527.60	28,201,715.79

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	114,451,021.96	17,758,202.74	132,209,224.70
2.基金赎回款	-91,704,833.77	-12,302,675.14	-104,007,508.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	74,035,187.32	6,175,864.73	80,211,052.05

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:

魏超	沈珂	蔡文婷
————————	————————	————————
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

嘉合睿金混合型发起式证券投资基金 (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") 《关于准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]2544号)批准，由嘉合基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等法律法规以及《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2018年3月21日生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集资金总额人民币200,134,019.23元。上述募集资金已由会计师事务所验证，并出具了验资报告。根据《关于嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自2019年3月13日，本基金正式实施基金转型，基金名称由"嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金"变更为"嘉合睿金混合型发起式证券投资基金"，运作方式由"契约型开放式，以定期开放方式运作，即采用封闭运作和开放运作交替循环的方式"变更为"契约型开放式"，嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金份额变更为嘉合睿金混合型发起式证券投资基金份额。2019年3月13日，《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金

基金合同》生效，基金规模为10,961,277.90份基金份额。本基金的基金管理人为嘉合基金管理有限公司，基金托管人为渤海银行股份有限公司(以下简称"渤海银行") 。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》和《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书》（更新）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交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债等）、债券回购、同业存单、股指期货、资产支持证券、权证、货币市场工具、银行存款以及现金，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的相关规定）。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为50%-95%，持有全部权证的市值不得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需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较标准为沪深300指数收益率×60% + 中债综合全价指数收益率×40%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号--年度报告和中期报告》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年6月30日的财务状况、2026年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资和买入返售金融资产等。

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

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

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

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

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

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

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来12个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后12个月内（若金融工具的预计存续期少于12个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金

分红。基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56号《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》、《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：

a) 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。

本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。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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，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。对本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。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d) 本基金卖出股票按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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	49,971,703.70
等于：本金	49,970,203.99
加：应计利息	1,499.71
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	49,971,703.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		144,289,629.30	-	174,774,772.38	30,485,143.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		144,289,629.30	-	174,774,772.38	30,485,143.08

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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余额。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日

应收利息	-
其他应收款	658.55
待摊费用	-
合计	658.55

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,207.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	39,671.58
合计	40,879.24

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 嘉合睿金混合A

金额单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,135,874.65	15,135,874.65
本期申购	173,881,772.10	173,881,772.10
本期赎回（以“-”号填列）	-143,680,405.84	-143,680,405.84
本期末	45,337,240.91	45,337,240.91

6.4.7.7.2 嘉合睿金混合C

金额单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,593,586.42	15,593,586.42
本期申购	132,304,099.70	132,304,099.70
本期赎回（以“-”号填列）	-109,232,883.95	-109,232,883.95
本期末	38,664,802.17	38,664,802.17

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

6.4.7.8.1 嘉合睿金混合A

单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,404,282.83	-367,613.19	10,036,669.64
本期期初	10,404,282.83	-367,613.19	10,036,669.64
本期利润	24,581,782.03	16,970,678.12	41,552,460.15
本期基金份额交易产生的变动数	52,073,913.84	-7,850,408.31	44,223,505.53
其中：基金申购款	220,710,346.74	2,936,463.85	223,646,810.59
基金赎回款	-168,636,432.90	-10,786,872.16	-179,423,305.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,059,978.70	8,752,656.62	95,812,635.32

6.4.7.8.2 嘉合睿金混合C

单位：人民币元

项目 (嘉合睿金混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	9,193,654.81	-301,648.21	8,892,006.60
本期期初	9,193,654.81	-301,648.21	8,892,006.60
本期利润	24,331,413.09	7,670,337.59	32,001,750.68
本期基金份额交易产	33,856,723.37	-212,478.62	33,644,244.75

生的变动数			
其中：基金申购款	163,132,267.46	8,751,397.99	171,883,665.45
基金赎回款	-129,275,544.09	-8,963,876.61	-138,239,420.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	67,381,791.27	7,156,210.76	74,538,002.03

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	15,949.89
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	-
其他	2,600.19
合计	18,550.08

注：其他为券商保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	1,397,889,692.02
减：卖出股票成本总额	1,349,452,565.84
减：交易费用	2,155,470.72
买卖股票差价收入	46,281,655.46

6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	776.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,806.83
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	2,583.04

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,185,568.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	15,105,999.01
减：应计利息总额	77,747.91
减：交易费用	15.17
买卖债券差价收入	1,806.83

6.4.7.12.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	98,629.61
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	98,629.61

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	24,641,015.71
——股票投资	24,641,015.71
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-

2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	24,641,015.71

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	3,458,659.69
转换费收入	1,386.17
合计	3,460,045.86

注：1、赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，并按持有期间的增加而递减计入基金财产。

2、本基金的转换费由申购补差费和赎回费两部分构成，其中赎回费部分按持有期间的增加而递减计入基金财产。

6.4.7.19 信用减值损失

本基金在本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	14,876.39
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
合计	39,671.58

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本基金本报告不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。

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
嘉合基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
渤海银行股份有限公司	基金托管人
中航信托股份有限公司	基金管理人的股东
广东万和集团有限公司	基金管理人的股东
上海慧弘实业集团有限公司	基金管理人的股东
福建圣农控股集团有限公司	基金管理人的股东
北京智勇仁信投资咨询有限公司	基金管理人的股东
山东通汇资本投资集团有限公司	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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	656,276.53	437,184.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	291,401.02	145,766.53
应支付基金管理人的净管理费	364,875.51	291,418.45

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.20%年费率计提。

计算方法如下：

H=E×年费率/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	54,689.66	36,432.10

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年费率/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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	11.25	11.25
合计	0.00	11.25	11.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C	合计
嘉合基金管理有限公司	0.00	72,526.67	72,526.67
合计	0.00	72,526.67	72,526.67

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：
H=E×年费率/当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类基金份额前一日的基金资产净值
基金销售服务费每日计提，按月支付。

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均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末未有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
渤海银行股份有限公司	49,971,703.70	15,949.89	4,528,365.62	14,204.42

注：本基金通过“渤海银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2026年6月30日的相关余额为人民币0.00元。（2025年6月30日：人民币0.00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均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年6月30日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年6月30日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了四层次的内部控制与风控体系，主要包括：（1）员工自律；（2）部门主管的检查监督；（3）督察长领导下的监察稽核部和风险管理部的检查、监督；（4）董事会领导下的风险管理委员会及总办会领导下的风险控制委员会的控制和指导。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等；在管理层层面设立风险控制委员会，实施董事会风险管理与财务和内控委员会制定的各项风险管理和内部控制政策；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部及风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部及风险管理部向督察长负责，并向其汇报日常行政事务。

本基金管理人建立了以风险管理委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行渤海银行股份有限公司，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金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；本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并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金管理人对流通受限证券的投资交易进行限制和控制，对缺乏流动性的证券投资比率事先确定最高上限，控制基金的流动性结构；加强对投资组合变现周期和冲击成本的定量分析，定期揭示基金的流动性风险；通过分散投资降低基金财产的非系统性风险，保持基金组合良好的流动性。本基金所持证券均可在证券交易所或银行间同业市场交易，除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人根据申购赎回变动情况，制定现金头寸预测表，及时采取措施满足流动性需要；分析基金持有人结构，加强与主要持有机构的沟通，及时揭示可能的赎回需求；按照有关法律法规规定应对固定赎回，并进行适当报告和披露；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，以保障基金持有人利益。

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、存托凭证、权证等权益类工具，以及交易所及银行间交易的债券等固定收益类工具。

本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，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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不超过该证券的10%。本基金与由本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超过该上市公司可流通股票的15%(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该比例限制)，本基金与由本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，不超过该上市公司可流通股票的30%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过基金资产净值的15%。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2026年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	49,971,703.70	-	-	-	-	-	49,971,703.70
存出保证金	15,119,365.93	-	-	-	-	-	15,119,365.93
交易性金融资	-	-	-	-	-	174,774,772.38	174,774,772.38

产							
应收申购款	-	-	-	-	-	23,046,210.66	23,046,210.66
其他资产	-	-	-	-	-	658.55	658.55
资产总计	65,091,069.63	-	-	-	-	197,821,641.59	262,912,711.22
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	8,225,644.91	8,225,644.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	207,606.71	207,606.71
应付托管费	-	-	-	-	-	17,300.56	17,300.56
应付销售服务费	-	-	-	-	-	68,599.37	68,599.37
其他负债	-	-	-	-	-	40,879.24	40,879.24
负债总计	-	-	-	-	-	8,560,030.79	8,560,030.79
利率敏感度缺口	65,091,069.63	-	-	-	-	189,261,610.80	254,352,680.43
上年度末2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	5,271,897.30	-	-	-	-	-	5,271,897.30
存出保证金	3,341,699.61	-	-	-	-	-	3,341,699.61
交易性金融资产	-	-	-	-	-	42,098,942.33	42,098,942.33
应收申购款	-	-	-	-	-	701,685.08	701,685.08
其他资产	-	-	-	-	-	658.55	658.55

资产总计	8,613,596.91	-	-	-	-	42,801,285.96	51,414,882.87
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,563,898.94	1,563,898.94
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	49,828.21	49,828.21
应付托管费	-	-	-	-	-	4,152.35	4,152.35
应付销售服务费	-	-	-	-	-	18,657.59	18,657.59
其他负债	-	-	-	-	-	120,208.47	120,208.47
负债总计	-	-	-	-	-	1,756,745.56	1,756,745.56
利率敏感度缺口	8,613,596.91	-	-	-	-	41,044,540.40	49,658,137.31

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金未持有对利率敏感的金融资产与金融负债。因此，市场利率的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金承受的其他价格风险，主要是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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金持有一定比例的证券交易所上市的股票，因此存在相应的其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	174,774,772.38	68.71	42,098,942.33	84.78
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	174,774,772.38	68.71	42,098,942.33	84.78

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	19,769,783.17	3,629,174.59
	业绩比较基准下降5%	-19,769,783.17	-3,629,174.59

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：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：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	174,774,772.38	42,098,942.33
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	174,774,772.38	42,098,942.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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(2025年12月31日：无)。

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	174,774,772.38	66.48
	其中：股票	174,774,772.38	66.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	49,971,703.70	19.01
8	其他各项资产	38,166,235.14	14.52
9	合计	262,912,711.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	163,614,772.38	64.33
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	11,160,000.00	4.39
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	174,774,772.38	68.71

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港股通投资股票。

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688167	炬光科技	66,068	23,401,946.28	9.20
2	300502	新易盛	38,300	23,248,100.00	9.14
3	300308	中际旭创	17,600	22,352,000.00	8.79
4	002384	东山精密	56,200	14,744,070.00	5.80
5	603986	兆易创新	17,700	14,425,500.00	5.67
6	002428	云南锗业	116,500	14,000,970.00	5.50
7	600105	永鼎股份	173,900	11,734,772.00	4.61
8	300475	香农芯创	37,200	11,160,000.00	4.39
9	688008	澜起科技	35,885	11,120,761.50	4.37

10	300489	光智科技	27,100	8,453,845.00	3.32
11	688347	华虹公司	24,852	8,357,727.60	3.29
12	002281	光迅科技	23,000	5,909,620.00	2.32
13	688498	源杰科技	3,110	5,865,460.00	2.31

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	300502	新易盛	66,545,691.78	134.01
2	300308	中际旭创	52,984,784.00	106.70
3	002428	云南锗业	51,536,343.93	103.78
4	600105	永鼎股份	48,736,855.16	98.14
5	688008	澜起科技	40,799,830.55	82.16
6	688498	源杰科技	40,727,346.34	82.02
7	002384	东山精密	37,174,770.00	74.86
8	300394	天孚通信	36,891,251.80	74.29
9	688167	炬光科技	35,689,326.72	71.87
10	688125	安达智能	34,902,074.10	70.28
11	300757	罗博特科	33,331,763.00	67.12
12	300489	光智科技	31,518,593.00	63.47
13	603083	剑桥科技	31,369,855.96	63.17
14	688313	仕佳光子	30,948,719.11	62.32
15	300620	光库科技	27,140,517.35	54.65
16	603986	兆易创新	26,797,921.00	53.96
17	300395	菲利华	26,224,889.98	52.81
18	688766	普冉股份	24,692,411.93	49.72
19	688388	嘉元科技	23,926,835.64	48.18
20	300658	延江股份	22,332,833.60	44.97

21	300476	胜宏科技	22,277,207.00	44.86
22	300475	香农芯创	22,255,279.52	44.82
23	301308	江波龙	21,840,264.00	43.98
24	688525	佰维存储	20,185,992.55	40.65
25	002222	福晶科技	18,803,565.06	37.87
26	688048	长光华芯	18,581,468.57	37.42
27	300570	太辰光	18,497,716.00	37.25
28	688143	长盈通	18,296,965.17	36.85
29	600183	生益科技	18,114,122.10	36.48
30	688347	华虹公司	18,004,353.64	36.26
31	688409	富创精密	15,435,641.28	31.08
32	605358	立昂微	14,848,780.00	29.90
33	002463	沪电股份	14,607,720.16	29.42
34	600487	亨通光电	14,531,911.00	29.26
35	001267	汇绿生态	12,887,045.00	25.95
36	688195	腾景科技	12,574,873.74	25.32
37	688205	德科立	12,170,499.28	24.51
38	600330	天通股份	12,166,656.00	24.50
39	300223	北京君正	10,620,820.00	21.39
40	688603	天承科技	10,463,071.28	21.07
41	301486	致尚科技	10,218,306.69	20.58
42	688416	恒烁股份	9,949,148.52	20.04
43	001309	德明利	9,645,045.00	19.42
44	688308	欧科亿	9,486,031.81	19.10
45	002008	大族激光	9,200,418.00	18.53
46	300418	昆仑万维	8,886,193.68	17.89
47	301396	宏景科技	8,463,006.00	17.04
48	688702	盛科通信	8,023,531.13	16.16
49	300788	中信出版	7,715,081.00	15.54
50	300548	长芯博创	7,638,325.00	15.38
51	002943	宇晶股份	7,560,249.00	15.22

52	002281	光迅科技	7,473,073.00	15.05
53	688041	海光信息	7,407,323.33	14.92
54	601231	环旭电子	7,387,316.00	14.88
55	300911	亿田智能	7,245,868.00	14.59
56	301338	凯格精机	6,935,451.00	13.97
57	688025	杰普特	6,826,658.89	13.75
58	301196	唯科科技	6,800,630.00	13.69
59	688082	盛美上海	6,046,969.00	12.18
60	688726	拉普拉斯	6,031,366.49	12.15
61	000066	中国长城	5,947,159.00	11.98
62	300750	宁德时代	5,748,765.00	11.58
63	300724	捷佳伟创	5,444,586.00	10.96
64	300975	商络电子	5,325,629.00	10.72
65	688127	蓝特光学	5,301,406.11	10.68
66	600481	双良节能	5,291,066.00	10.65
67	002796	世嘉科技	5,284,605.00	10.64
68	600498	烽火通信	4,928,046.00	9.92
69	688256	寒武纪	4,789,473.03	9.64
70	688047	龙芯中科	4,760,311.62	9.59
71	688813	泰金新能	4,686,587.81	9.44
72	301217	铜冠铜箔	4,684,095.00	9.43
73	688502	茂莱光学	4,679,193.97	9.42
74	603618	杭电股份	4,653,303.00	9.37
75	301095	广立微	4,622,234.00	9.31
76	300857	协创数据	4,535,731.00	9.13
77	688234	天岳先进	4,533,389.52	9.13
78	301511	德福科技	4,326,249.00	8.71
79	300720	海川智能	4,321,170.00	8.70
80	000021	深科技	4,060,978.00	8.18
81	688503	聚和材料	3,834,001.37	7.72
82	688800	瑞可达	3,696,737.04	7.44

83	300083	创世纪	3,679,889.00	7.41
84	688625	呈和科技	3,609,016.35	7.27
85	601138	工业富联	3,519,224.00	7.09
86	688809	强一股份	3,511,365.09	7.07
87	300131	英唐智控	3,223,189.00	6.49
88	688516	奥特维	3,219,855.12	6.48
89	002475	立讯精密	3,180,968.00	6.41
90	300033	同花顺	3,109,268.00	6.26
91	688123	聚辰股份	3,085,345.92	6.21
92	002865	钧达股份	3,030,884.00	6.10
93	002980	华盛昌	3,023,108.00	6.09
94	300987	川网传媒	2,993,058.40	6.03
95	000657	中钨高新	2,921,308.00	5.88
96	300624	万兴科技	2,905,094.00	5.85
97	688808	联讯仪器	2,834,617.70	5.71
98	300153	科泰电源	2,766,993.00	5.57
99	002623	亚玛顿	2,671,616.00	5.38
100	605060	联德股份	2,617,763.00	5.27
101	301200	大族数控	2,603,901.00	5.24
102	300438	鹏辉能源	2,597,191.00	5.23
103	301171	易点天下	2,580,147.00	5.20
104	688162	巨一科技	2,519,104.90	5.07
105	688072	拓荆科技	2,446,743.60	4.93
106	688012	中微公司	2,446,412.90	4.93
107	002371	北方华创	2,420,178.00	4.87
108	300672	国科微	2,317,466.00	4.67
109	688035	德邦科技	2,303,255.08	4.64
110	600821	金开新能	2,294,777.00	4.62
111	301479	弘景光电	2,269,345.59	4.57
112	300004	南风股份	2,260,098.00	4.55
113	002929	润建股份	2,218,275.00	4.47

114	300017	网宿科技	2,214,923.71	4.46
115	603000	人民网	2,189,039.00	4.41
116	600522	中天科技	2,012,696.00	4.05
117	688727	恒坤新材	1,997,012.98	4.02
118	300772	运达股份	1,995,858.00	4.02
119	300679	电连技术	1,979,052.00	3.99
120	002916	深南电路	1,930,582.00	3.89
121	002025	航天电器	1,878,552.00	3.78
122	600633	浙数文化	1,856,369.00	3.74
123	601958	金钼股份	1,800,852.00	3.63
124	300456	赛微电子	1,792,820.00	3.61
125	301231	荣信文化	1,757,731.00	3.54
126	003031	中瓷电子	1,703,942.00	3.43
127	300058	蓝色光标	1,678,732.83	3.38
128	301556	托普云农	1,637,094.00	3.30
129	688615	合合信息	1,621,028.48	3.26
130	000681	视觉中国	1,614,002.00	3.25
131	603005	晶方科技	1,584,223.00	3.19
132	603888	新华网	1,575,835.00	3.17
133	603738	泰晶科技	1,538,748.00	3.10
134	603228	景旺电子	1,506,135.00	3.03
135	002491	通鼎互联	1,416,174.00	2.85
136	300785	值得买	1,402,453.81	2.82
137	300454	深信服	1,399,646.00	2.82
138	601869	长飞光纤	1,353,452.00	2.73
139	002902	铭普光磁	1,352,200.00	2.72
140	002364	中恒电气	1,271,097.00	2.56
141	688361	中科飞测	1,264,172.02	2.55
142	605123	派克新材	1,257,898.00	2.53
143	688519	南亚新材	1,202,412.97	2.42
144	688372	伟测科技	1,168,493.00	2.35

145	688223	晶科能源	1,166,015.42	2.35
146	603496	恒为科技	1,079,334.00	2.17
147	300803	指南针	1,040,208.00	2.09

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

2、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计买入金额"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	300502	新易盛	55,833,613.00	112.44
2	600105	永鼎股份	45,059,104.11	90.74
3	300394	天孚通信	45,018,978.00	90.66
4	002428	云南锗业	44,567,285.00	89.75
5	300308	中际旭创	43,157,248.49	86.91
6	688498	源杰科技	39,822,413.68	80.19
7	603083	剑桥科技	35,163,633.00	70.81
8	002384	东山精密	32,821,081.00	66.09
9	300757	罗博特科	32,754,799.76	65.96
10	688125	安达智能	31,489,877.04	63.41
11	688008	澜起科技	31,211,346.80	62.85
12	688313	仕佳光子	30,850,786.95	62.13
13	300489	光智科技	30,496,087.00	61.41
14	300620	光库科技	28,788,379.00	57.97
15	688167	炬光科技	27,564,190.38	55.51
16	688766	普冉股份	25,504,363.10	51.36
17	300395	菲利华	23,769,406.00	47.87
18	300476	胜宏科技	23,184,476.00	46.69
19	688388	嘉元科技	22,997,802.89	46.31

20	301308	江波龙	22,324,848.00	44.96
21	300658	延江股份	21,765,402.00	43.83
22	600183	生益科技	20,924,893.48	42.14
23	688143	长盈通	19,500,052.03	39.27
24	688525	佰维存储	19,474,062.48	39.22
25	688048	长光华芯	18,535,307.22	37.33
26	300570	太辰光	18,085,233.60	36.42
27	603986	兆易创新	17,422,870.95	35.09
28	002222	福晶科技	16,353,188.00	32.93
29	300475	香农芯创	16,105,359.00	32.43
30	688409	富创精密	14,967,760.62	30.14
31	605358	立昂微	14,964,621.10	30.14
32	600487	亨通光电	14,896,440.73	30.00
33	002463	沪电股份	14,149,598.00	28.49
34	688347	华虹公司	13,511,330.16	27.21
35	600330	天通股份	13,324,976.69	26.83
36	688195	腾景科技	12,993,140.46	26.17
37	001267	汇绿生态	12,611,292.87	25.40
38	688205	德科立	11,793,613.77	23.75
39	688603	天承科技	11,621,765.10	23.40
40	688308	欧科亿	10,809,661.96	21.77
41	300223	北京君正	10,645,426.35	21.44
42	301486	致尚科技	10,353,117.13	20.85
43	001309	德明利	10,205,206.00	20.55
44	688416	恒烁股份	9,959,870.36	20.06
45	688256	寒武纪	9,110,527.73	18.35
46	688702	盛科通信	8,726,471.99	17.57
47	002008	大族激光	8,711,786.00	17.54
48	300418	昆仑万维	8,563,311.00	17.24
49	301396	宏景科技	8,390,893.00	16.90
50	300911	亿田智能	7,648,216.00	15.40

51	300788	中信出版	7,396,604.00	14.90
52	300548	长芯博创	7,390,889.00	14.88
53	601231	环旭电子	7,138,125.00	14.37
54	301338	凯格精机	7,122,998.00	14.34
55	002943	宇晶股份	7,073,834.00	14.25
56	301196	唯科科技	7,033,945.00	14.16
57	688041	海光信息	7,027,593.36	14.15
58	688726	拉普拉斯	6,414,385.33	12.92
59	301511	德福科技	6,393,061.86	12.87
60	688025	杰普特	6,270,998.85	12.63
61	688082	盛美上海	6,026,770.72	12.14
62	000066	中国长城	5,802,082.00	11.68
63	300750	宁德时代	5,605,194.00	11.29
64	300724	捷佳伟创	5,440,667.00	10.96
65	688127	蓝特光学	5,376,474.81	10.83
66	688813	泰金新能	5,367,932.26	10.81
67	600481	双良节能	5,187,835.00	10.45
68	300720	海川智能	5,141,975.00	10.35
69	300975	商络电子	5,008,399.00	10.09
70	002796	世嘉科技	4,986,459.00	10.04
71	688502	茂莱光学	4,879,953.27	9.83
72	600498	烽火通信	4,742,501.83	9.55
73	603618	杭电股份	4,725,377.00	9.52
74	301217	铜冠铜箔	4,687,673.00	9.44
75	688234	天岳先进	4,600,393.89	9.26
76	301095	广立微	4,504,063.00	9.07
77	688047	龙芯中科	4,443,901.24	8.95
78	300857	协创数据	4,348,877.00	8.76
79	000021	深科技	4,153,282.00	8.36
80	688800	瑞可达	4,077,708.92	8.21
81	002980	华盛昌	3,896,705.20	7.85

82	688503	聚和材料	3,886,209.98	7.83
83	300131	英唐智控	3,818,617.00	7.69
84	300083	创世纪	3,639,845.00	7.33
85	688809	强一股份	3,534,032.26	7.12
86	688516	奥特维	3,518,834.95	7.09
87	003031	中瓷电子	3,408,802.00	6.86
88	601138	工业富联	3,379,011.00	6.80
89	688625	呈和科技	3,350,692.38	6.75
90	002475	立讯精密	3,279,008.00	6.60
91	688123	聚辰股份	3,143,796.04	6.33
92	688808	联讯仪器	2,976,371.22	5.99
93	002623	亚玛顿	2,891,457.00	5.82
94	300033	同花顺	2,878,119.00	5.80
95	000657	中钨高新	2,847,260.00	5.73
96	300624	万兴科技	2,794,197.00	5.63
97	002865	钧达股份	2,750,931.00	5.54
98	300987	川网传媒	2,743,695.00	5.53
99	300153	科泰电源	2,689,717.00	5.42
100	301200	大族数控	2,642,991.00	5.32
101	605060	联德股份	2,626,647.00	5.29
102	002371	北方华创	2,589,320.00	5.21
103	688012	中微公司	2,586,868.43	5.21
104	300438	鹏辉能源	2,572,149.00	5.18
105	688162	巨一科技	2,509,147.80	5.05
106	688072	拓荆科技	2,507,210.00	5.05
107	301171	易点天下	2,503,511.00	5.04
108	300672	国科微	2,395,138.00	4.82
109	688035	德邦科技	2,237,218.68	4.51
110	300017	网宿科技	2,232,001.00	4.49
111	600821	金开新能	2,219,969.00	4.47
112	300004	南风股份	2,124,215.00	4.28

113	002929	润建股份	2,121,567.00	4.27
114	301479	弘景光电	2,105,442.00	4.24
115	300058	蓝色光标	1,998,813.00	4.03
116	002281	光迅科技	1,989,298.00	4.01
117	600522	中天科技	1,976,723.00	3.98
118	300772	运达股份	1,961,705.00	3.95
119	688727	恒坤新材	1,927,175.92	3.88
120	300679	电连技术	1,863,331.00	3.75
121	002916	深南电路	1,854,580.00	3.73
122	601958	金钼股份	1,815,991.00	3.66
123	600633	浙数文化	1,792,597.65	3.61
124	301231	荣信文化	1,770,299.00	3.56
125	002025	航天电器	1,760,318.00	3.54
126	603000	人民网	1,725,601.00	3.47
127	603888	新华网	1,687,003.20	3.40
128	300456	赛微电子	1,654,041.00	3.33
129	300782	卓胜微	1,634,395.00	3.29
130	300785	值得买	1,602,299.00	3.23
131	002491	通鼎互联	1,584,128.00	3.19
132	603005	晶方科技	1,573,474.00	3.17
133	688615	合合信息	1,558,764.02	3.14
134	603738	泰晶科技	1,537,074.00	3.10
135	301556	托普云农	1,516,720.00	3.05
136	603228	景旺电子	1,463,610.00	2.95
137	002364	中恒电气	1,385,253.00	2.79
138	000681	视觉中国	1,377,659.00	2.77
139	300454	深信服	1,351,923.00	2.72
140	688361	中科飞测	1,328,015.10	2.67
141	688223	晶科能源	1,307,705.44	2.63
142	601869	长飞光纤	1,304,040.00	2.63
143	300803	指南针	1,299,343.00	2.62

144	605123	派克新材	1,269,457.00	2.56
145	002902	铭普光磁	1,229,781.00	2.48
146	688372	伟测科技	1,181,369.00	2.38
147	688519	南亚新材	1,103,149.00	2.22

注：1、卖出包括基金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、基金持有的股票的分类为交易型金融资产的，本项的"累计卖出金额"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	1,457,487,380.18
卖出股票收入（成交）总额	1,397,889,692.02

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、转股债、换股及行权等获得的股票，卖出包括基金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（成交）总额"、"卖出股票收入（成交）总额"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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期内未运用股指期货进行投资。

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

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

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 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同约定的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	15,119,365.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	23,046,210.66
6	其他应收款	658.55
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	38,166,235.14

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

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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
嘉合睿金混合A	4,511	10,050.37	105,604.15	0.23%	45,231,636.76	99.77%
嘉合睿金混合C	9,973	3,876.95	22,517.02	0.06%	38,642,285.15	99.94%
合计	14,484	5,799.64	128,121.17	0.15%	83,873,921.91	99.85%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C级比例分母为各自级别的份额，对合计数比例的分母采用基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025年07月01日-2026年06月30日）
盈利投资者数量占比	80.56%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	嘉合睿金混合A	820.58	0.00%

	嘉合睿金混合C	4,002.87	0.01%
	合计	4,823.45	0.01%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：1、本基金本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金A份额总量在0~10万份(含)之间。

2、本基金本报告期末，本基金的基金经理未持有本基金份额。

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	10,447,761.18	12.44%	自基金合同生效之日起不少于3年
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	0.00	0.00%	10,447,761.18	12.44%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	嘉合睿金混合A	嘉合睿金混合C
基金合同生效日(2019年03月13日)基金份额总额	10,452,941.18	508,336.72
本报告期期初基金份额总额	15,135,874.65	15,593,586.42
本报告期基金总申购份额	173,881,772.10	132,304,099.70
减：本报告期基金总赎回份额	143,680,405.84	109,232,883.95
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	45,337,240.91	38,664,802.17

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

自2026年4月21日起，景辉先生不再担任渤海银行股份有限公司托管业务部副总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产相关的诉讼事项。

本报告期内无对基金托管业务产生重大影响的重大诉讼和仲裁事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
天风证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	2	2,855,377,072.20	100.00%	1,427,969.06	100.00%	-

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式。

2、本基金本报告期内无租用券商交易单元变更情况。

3、本基金的基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研

究等服务能力较强的证券公司，作为本基金的证券经纪商。基金管理人根据上述标准评价并确定合作的证券公司，与证券公司签订证券经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中山证券	30,368,527.27	100.00%	-	-	-	-	-	-

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	嘉合基金管理有限公司旗下基金2025年第4季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2026-01-22
2	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2025年第4季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-01-22
3	嘉合基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
4	嘉合基金管理有限公司旗下基金2025年年度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2026-03-31
5	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2025年年度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-03-31
6	嘉合基金管理有限公司旗下基金2026年第1季度报告提示性公告	《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、基金管理人网站	2026-04-22

7	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-22
8	2025年度嘉合基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-04-30
9	嘉合基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票调整估值方法的公告	《证券日报》、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-19
10	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30
11	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30
12	嘉合睿金混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）（2026年第1号）	基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2026-06-30

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

一、中国证监会准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金募集注册的文件

二、《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》

三、《嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》

四、中国证监会准予嘉合睿金定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金变更注册的文件

五、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金基金合同》

六、《嘉合睿金混合型发起式证券投资基金托管协议》

七、相关法律意见书

八、基金管理人业务资格批件和营业执照

九、基金托管人业务资格批件和营业执照

十、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站（www.haoamc.com）进行查阅。

嘉合基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日