

东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:兴业银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年8月24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2026年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	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合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	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	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	76
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	76
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	76
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	76
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
7.12 投资组合报告附注	77
§8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
8.2 盈利投资者数量占比	78

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	78
§9 开放式基金份额变动	78
§10 重大事件揭示	79
10.1 基金份额持有人大会决议	79
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	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	79
10.4 基金投资策略的改变	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	79
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	79
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	80
10.8 其他重大事件	81
§11 影响投资者决策的其他重要信息	82
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	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	82
§12 备查文件目录	82
12.1 备查文件目录	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	东兴未来价值混合	
基金主代码	004695	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年07月26日	
基金管理人	东兴基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	160,196,965.48份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C
下属分级基金的交易代码	004695	007550
报告期末下属分级基金的份额总额	58,457,012.09份	101,739,953.39份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过"自上而下"的宏观分析和"自下而上"的个股选择相结合寻找具有优质成长特性的股票，力争在控制风险的基础上实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金将通过对宏观经济周期和市场运行阶段的判断来确定投资组合中各大类资产的权重。在此基础上，结合对行业周期、公司发展前景、金融市场行为等分析，精选个股，完成股票组合的构建，并通过运用久期策略、期限结构策略和个券选择策略完成债券组合的构建。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×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高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中高风险水平的投资品种。

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	东兴基金管理有限公司		兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李宛霖	冯萌
	联系电话	400-670-1800	021-52629999-213310
	电子邮箱	xxpl@dxamc.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话	400-670-1800		95561
传真	010-83770122		021-62159217
注册地址	北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室		福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层		上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码	100033		200120
法定代表人	王洪亮		吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.dxamc.cn
基金中期报告置备地点	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	东兴未来价值混合 A	东兴未来价值混合 C
本期已实现收益	9,672,039.58	16,006,444.61

本期利润	4,115,452.49	9,445,917.57
加权平均基金份额本期利润	0.0658	0.0837
本期加权平均净值利润率	3.81%	4.86%
本期基金份额净值增长率	8.01%	7.96%
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	40,790,844.76	70,492,199.73
期末可供分配基金份额利润	0.6978	0.6929
期末基金资产净值	99,247,856.85	172,232,153.12
期末基金份额净值	1.6978	1.6929
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	69.78%	69.29%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东兴未来价值混合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	4.58%	1.48%	7.36%	0.76%	-2.78%	0.72%
过去六个月	8.01%	1.52%	5.03%	0.68%	2.98%	0.84%
过去一年	30.54%	1.28%	15.25%	0.61%	15.29%	0.67%
过去三年	79.02%	1.51%	20.53%	0.66%	58.49%	0.85%
过去五年	32.98%	1.35%	2.28%	0.66%	30.70%	0.69%
自基金合同 生效起至今	69.78%	1.27%	24.70%	0.69%	45.08%	0.58%

东兴未来价值混合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	4.55%	1.48%	7.36%	0.76%	-2.81%	0.72%
过去六个月	7.96%	1.52%	5.03%	0.68%	2.93%	0.84%
过去一年	30.41%	1.28%	15.25%	0.61%	15.16%	0.67%
过去三年	78.50%	1.51%	20.53%	0.66%	57.97%	0.85%
过去五年	33.02%	1.36%	2.28%	0.66%	30.74%	0.70%
自基金合同 生效起至今	69.29%	1.27%	24.70%	0.69%	44.59%	0.58%

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



东兴未来价值混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年07月26日-2026年06月30日)



注：1、本基金基金合同生效日为2019年7月26日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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

东兴基金管理有限公司成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司，实际控制人为中央汇金投资有限责任公司。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：特色指数类产品--在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品--以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品--坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，75%以上员工具有硕士及以上学历。公司承载中国东方的红色基因，坚持以投资者利益为上的原则，精心打造守正拓新、忠诚担当、团结协作、专业精进的专业化人才队伍，秉承“守正、诚信、专业、协作的”核心价值观，以“客户为本、践行担当、同心同行、稳健致远”为使命，努力打造专业稳健、普惠为民、深受信赖的新时代公募基金管理公司。

截至2026年6月30日，本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金、东兴数字经济混合型发起式证券投资基金、东兴鑫颐3个月滚动持有纯债债券型证券投资基金、东兴成长优选混合型发起式证券投资基金、东兴医药生物量化选股混合型证券投资基金、东兴兴诚利率债债券型证券投资基金、东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金、东兴红利优选混合型证券投资基金、东兴中证A500指数增强型证券投资基金、东兴产业升级混合型发起式证券投资基金、东兴中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、东兴低碳经济混合型发起式证券投资基金、东兴中证全指指数量化增强型证券投资基金共30只开放式基金。

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		
李兵伟 先生	本基金 基金经 理	2023- 09-11	-	15年	毕业于中央财经大学金融学专业，硕士研究生学历。2010年7月至2015年9月，先后任职于信达证券股份有限公司研究开发中心、资产管理部；2015年9月至2021年5月，任职于东兴证券股份有限公

					司基金业务部；2021年5月至2025年1月，任职东兴基金管理有限公司权益投资部基金经理；2025年1月至今，任职东兴基金管理有限公司量化投资部基金经理。
张旭先生	公司助理总经理、权益投资部总经理（兼），本基金基金经理	2023-09-11	-	13年	毕业于对外经济贸易大学，硕士研究生学历。曾任职于东软集团、隆圣投资管理有限公司；2012年3月至2015年3月，任职银华基金管理有限公司特定资产管理部投资经理；2015年3月至2019年11月，任职中加基金管理有限公司投资研究部负责人。2019年11月加入东兴证券股份有限公司基金业务部，任职助理总经理、基金经理；2021年5月至2023年12月，任职东兴基金管理有限公司助理总经理、基金经理；2023年12月至今，任职东兴基金管理有限公司助理总经理、权益投资部总经理（兼）、基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

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

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，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。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由分管投资的公司领导决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易部根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的内向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）内向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年上半年，主要宽基指数均录得正收益。但结构表现极度分化，周期板块和硬科技先后驱动市场行情，而美伊冲突是指数层面走势的重要扰动。整个上半年来看，资金不断缩圈聚焦于AI上游硬科技产业链，挖掘细分领域投资机会，而内需整体承压。从基本面上看，AI资本开支带动了硬科技板块的高增长，无论是从上市公司财报还是高频数据均可以得到印证。而消费在多重深层次因素叠加下，基本面承压，社零单月转负。

周期板块在海外加息预期下，二季度也出现明显调整。但市场在对新老经济体基本面分化定价的过程中，我们认为还是出现了一些非理性的判断，一些基本面优质的上市公司估值已经明显低于其内在价值。这种极端分化的市场环境，确实给我们的量化策略带来一定的考验。但我们的策略经历过反复的迭代优化，在市场波动中经受住了考验。

东兴未来价值的投资策略依旧侧重于组合的构建而非择时，底层的选股逻辑为主要基于基本面多因子模型，采用分散化投资理念，重点关注兼具估值和成长性的公司。通过模型筛选，重点选择成长性好，盈利能力强的公司，结合估值预期形成投资组合，2026年上半年量化选股模型有效地抓住了结构性机会。同时，组合构建过程中的风险控制模块发挥了极大的作用，将我们的回撤控制在一个较低的水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2026年1月1日起至2026年6月30日，本基金A类份额净值增长率为8.01%，业绩比较基准收益率为5.03%，高于业绩比较基准2.98%；本基金C类份额净值增长率为7.96%，业绩比较基准收益率为5.03%，高于业绩比较基准2.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，新旧经济动能的此消彼长仍将是宏观层面的核心叙事主线。出口端，AI产业链的景气外溢将继续支撑高增，成为增长的主要压舱石；消费端，虽受制于居民预期偏弱，修复动能有限，但在基数走低与政策边际加力的共同作用下，预计将呈现弱复苏态势，其中服务消费的相对优势仍将延续。投资结构上，以“六张网”为代表的新型基建将持续发力，而传统地产基建链条则难有明显起色。尽管“新强旧弱”的格局是下半年基准情景，但我们判断，随着财政资金拨付节奏加快、地缘不确定性逐步消化，新旧经济之间的分化幅度有望边际收窄。

映射到二级市场，上半年指数上行更多由流动性宽松与估值抬升驱动，而进入下半年，市场定价逻辑将向内生增长回归。我们认为指数整体有望维持温和震荡上行的趋势，但上行斜率将取决于两个变量：AI产业基本面的实际兑现程度，以及内需修复的真实强度。当前，AI板块在经历估值快速扩张后，后续行情将高度依赖业绩落地的验证；而传统消费、制造等板块估值已处于历史偏低水位，随着下半年需求端企稳，部分被市场过度悲观定价的优质个股有望迎来估值修复窗口。总体来看，下半年阿尔法收益将优于贝塔收益，个股基本面将成为决定超额收益的关键标尺。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、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。定价服务机构按照商业合

同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,744,305.08	400,228.31
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	271,067,597.03	159,082,800.35
其中：股票投资		255,213,020.85	149,835,903.31
基金投资		-	-
债券投资		15,854,576.18	9,246,897.04
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		152,612.36	15,740,043.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		275,964,514.47	175,223,071.67
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		2,779.28	24.00
应付赎回款		4,121,112.89	421,880.61
应付管理人报酬		242,056.47	106,263.24
应付托管费		24,205.64	10,626.33
应付销售服务费		15,441.07	6,672.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		404.00	74.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	78,505.15	139,549.29
负债合计		4,484,504.50	685,090.99
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	160,196,965.48	111,181,858.45
未分配利润	6.4.7.8	111,283,044.49	63,356,122.23
净资产合计		271,480,009.97	174,537,980.68
负债和净资产总计		275,964,514.47	175,223,071.67

注：报告截止日2026年6月30日，基金份额总额160,196,965.48份；东兴未来价值混合A基金份额净值1.6978元，基金份额总额58,457,012.09份，东兴未来价值混合C基金份额净值1.6929元，基金份额总额101,739,953.39份。

6.2 利润表

会计主体：东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		15,386,583.09	7,895,210.12
1.利息收入		2,616.86	774.65
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,616.86	653.33

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		-	121.32
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		26,766,201.95	4,850,424.31
其中：股票投资收益	6.4.7.10	24,083,919.47	4,403,969.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	111,021.07	15,686.95
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	2,571,261.41	430,767.91
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-12,117,114.13	3,025,349.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	734,878.41	18,661.25
减：二、营业总支出		1,825,213.03	301,508.85
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,502,043.18	218,967.68
2.托管费	6.4.10.2.2	150,204.38	21,896.73
3.销售服务费	6.4.10.2.3	96,572.68	15,277.41
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		246.32	0.43
8.其他费用	6.4.7.19	76,146.47	45,366.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,561,370.06	7,593,701.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,561,370.06	7,593,701.27
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,561,370.06	7,593,701.27

6.3 净资产变动表

会计主体：东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	111,181,858.45	63,356,122.23	174,537,980.68
二、本期期初净资产	111,181,858.45	63,356,122.23	174,537,980.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	49,015,107.03	47,926,922.26	96,942,029.29
（一）、综合收益总额	-	13,561,370.06	13,561,370.06
（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）	49,015,107.03	34,365,552.20	83,380,659.23

其中：1.基金申购款	207,702,150.83	150,034,979.41	357,737,130.24
2.基金赎回款	-158,687,043.80	-115,669,427.21	-274,356,471.01
（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	160,196,965.48	111,283,044.49	271,480,009.97
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	53,871,426.52	4,900,743.43	58,772,169.95
二、本期期初净资产	53,871,426.52	4,900,743.43	58,772,169.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-23,573,792.35	4,162,604.43	-19,411,187.92
（一）、综合收益总额	-	7,593,701.27	7,593,701.27
（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）	-23,573,792.35	-3,431,096.84	-27,004,889.19
其中：1.基金申购款	13,466,831.15	2,479,299.51	15,946,130.66
2.基金赎回款	-37,040,623.50	-5,910,396.35	-42,951,019.85
（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	30,297,634.17	9,063,347.86	39,360,982.03

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:

王洪亮	黄言	王广辉
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

东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")根据2017年5月10日中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")《关于准予东兴量化新锐灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017] 676号）的批复及《关于准予东兴量化新锐灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》（证监许可[2019] 943号）的批复，自2019年7月1日起至2019年7月23日公开募集成立。本基金为混合型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集209,982,041.96元人民币，业经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）"德师报(验)字(19)第00365号"验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2019年7月26日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为210,091,082.68份，其中认购资金利息折合109,040.72份。本基金基金管理人为东兴基金管理有限公司（本基金原基金管理人为东兴证券股份有限公司，自2021年5月24日起变更为东兴基金管理有限公司），基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、股指期货、货币市场工具、同业存单、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金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%；本基金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，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

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，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、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1月1日至2026年6月30日的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上一年年度报告相一致。

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为2026年1月1日至2026年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1、金融资产的分类

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。

2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

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

1、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。

2、金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债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。

3、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)。

4、金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

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。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失

计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应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，应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。

3、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，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入；买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

（2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本 and 对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

①持有期间的利息收入：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利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益；

②交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本 and 对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

（3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性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，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

（4）其他收入

其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

(1)根据基金合同以及后续修订，基金管理费在2023年3月3日前按前一日基金资产净值的1.50%的年费率逐日计提；自2023年3月3日起按前一日基金资产净值的1.00%的年费率逐日计提；

(2)根据基金合同，基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

(3)根据基金合同，基金销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

(4)《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；基金份额持有人大会费用；基金的证券、期货交易费用；基金的银行汇划费用；基金的证券、期货账户开户费用、账户维护费用；按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用；根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为12次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的30%，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，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；选择采取红利再投资形式的，分红资金将按红利发放日的基金份额净值转成相应的基金份额，红利再投资的份额免收申购费。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，则登记机构将以投资者在各销售机构最后一次选择的分红方式为准；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的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；

4、同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、分红权益登记日申请申购的基金份额不享受当次分红，分红权益登记日申请赎回的基金份额享受当次分红；

6、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对现有基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人、登记机构可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

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。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》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券监督管理委员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

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

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[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号文《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[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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、资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；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。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

4、对基金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06月30日
活期存款	490,224.18
等于：本金	490,133.72

加：应计利息	90.46
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	4,254,080.90
等于：本金	4,254,031.62
加：应计利息	49.28
减：坏账准备	-
合计	4,744,305.08

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		266,968,287.63	-	255,213,020.85	-11,755,266.78
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	15,703,731.53	139,956.18	15,854,576.18	10,888.47
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	15,703,731.53	139,956.18	15,854,576.18	10,888.47
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		282,672,019.16	139,956.18	271,067,597.03	-11,744,378.31

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7,058.68
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	71,446.47
合计	78,505.15

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 东兴未来价值混合A

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(东兴未来价值混合A)	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	51,505,846.66	51,505,846.66
本期申购	66,414,230.37	66,414,230.37
本期赎回（以“-”号填列）	-59,463,064.94	-59,463,064.94
本期末	58,457,012.09	58,457,012.09

6.4.7.7.2 东兴未来价值混合C

金额单位：人民币元

项目 (东兴未来价值混合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	59,676,011.79	59,676,011.79
本期申购	141,287,920.46	141,287,920.46
本期赎回（以“-”号填列）	-99,223,978.86	-99,223,978.86
本期末	101,739,953.39	101,739,953.39

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 东兴未来价值混合A

单位：人民币元

项目 (东兴未来价值混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	59,178,221.44	-29,722,664.89	29,455,556.55
本期期初	59,178,221.44	-29,722,664.89	29,455,556.55
本期利润	9,672,039.58	-5,556,587.09	4,115,452.49
本期基金份额交易产生的变动数	8,117,260.95	-897,425.23	7,219,835.72
其中：基金申购款	82,776,637.02	-33,130,369.63	49,646,267.39
基金赎回款	-74,659,376.07	32,232,944.40	-42,426,431.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,967,521.97	-36,176,677.21	40,790,844.76

6.4.7.8.2 东兴未来价值混合C

单位：人民币元

项目 (东兴未来价值混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,954,933.74	-7,054,368.06	33,900,565.68
本期期初	40,954,933.74	-7,054,368.06	33,900,565.68
本期利润	16,006,444.61	-6,560,527.04	9,445,917.57
本期基金份额交易产生的变动数	29,795,061.12	-2,649,344.64	27,145,716.48
其中：基金申购款	112,130,786.56	-11,742,074.54	100,388,712.02
基金赎回款	-82,335,725.44	9,092,729.90	-73,242,995.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	86,756,439.47	-16,264,239.74	70,492,199.73

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	1,392.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,223.07
结算备付金利息收入	-
其他	1.35
合计	2,616.86

注：1、其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券资金账户的证券交易结算资金的利息收入。

2、其他为基金申购款利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
----	-------------------------------

卖出股票成交总额	1,126,207,613.41
减：卖出股票成本总额	1,100,391,590.63
减：交易费用	1,732,103.31
买卖股票差价收入	24,083,919.47

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	106,313.56
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,707.51
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	111,021.07

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,341,955.12
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,298,429.61
减：应计利息总额	38,544.12
减：交易费用	273.88
买卖债券差价收入	4,707.51

6.4.7.12 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。

6.4.7.13 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

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01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,571,261.41
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	2,571,261.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	-12,117,114.13
——股票投资	-12,125,757.74
——债券投资	8,643.61
——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	-12,117,114.13

6.4.7.17 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	726,733.99
转换费收入	8,144.42
合计	734,878.41

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01月01日至2026年06月30日
审计费用	7,439.10
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	200.00
账户维护费	9,000.00
合计	76,146.47

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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明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
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	315,702,942.05	13.47%	349,849,645.17	100.00%

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通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	8,894,347.00	56.63%	3,116,934.18	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购	成交金额	占当期债券回购

		成交总额的比例		成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	-	-	1,380,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东兴证券股份有限公司	155,835.56	13.39%	-	-
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
东兴证券股份有限公司	173,091.44	100.00%	-	-

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	1,502,043.18	218,967.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	633,103.10	102,104.17
应支付基金管理人的净管理费	868,940.08	116,863.51

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.00%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E\times 1.00\%\div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，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5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、公休假等，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	150,204.38	21,896.73

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，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5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

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		
	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	127.57	127.57
东兴证券股份有限公司	0.00	2,901.73	2,901.73
兴业银行股份有限公司	0.00	779.48	779.48
合计	0.00	3,808.78	3,808.78
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		
	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C	合计
东兴基金管理有限公司	0.00	68.76	68.76
东兴证券股份有限公司	0.00	0.24	0.24
兴业银行股份有限公司	0.00	0.00	0.00
合计	0.00	69.00	69.00

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类基金份额的基金资产净值的0.10%的年费率计提。C类基金份额的销售服务费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的C类基金份额基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间，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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		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
兴业银行股份有限公司	490,224.18	1,392.44	375,095.80	419.16

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未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

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

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

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

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601369	陕鼓动力	2026-06-29	因筹划发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易事项	9.05	2026-07-13	9.96	200	1,738.35	1,810.00	-
688072	拓荆科技	2026-06-29	因筹划发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金事项	879.53	2026-07-13	890.99	21	7,120.12	18,470.13	-

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

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由风险控制与审计委员会、投资决策委员会、风险管理部门组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、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；本基金持有一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，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，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行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，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	13,626,364.07	7,539,214.00

合计	13,626,364.07	7,539,214.00
----	---------------	--------------

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	2,228,212.11	1,707,683.04
合计	2,228,212.11	1,707,683.04

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。
2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在基金开放期内可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券除附注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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2026年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本报告所称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，风险管理的目标是确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。基金管理人在报告期内综合考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，综合进行流动性风险管理。

基金管理人坚持按照"组合管理、分散投资"的基本原则，严格按照法律法规的有关规定和基金合同约定的投资范围与比例限制进行投资管理，通过灵活配置的二级市场投资策略、分散化的投资原则、严格的投资比例限制等投资安排，使基金组合资产的流动性安排与基金申赎安排相匹配，报告期内未发生流动性风险事件。

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

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

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	4,744,165.34	-	-	-	-	139.74	4,744,305.08
交易性金融资产	2,800,560.00	1,501,050.00	11,413,010.00	-	-	255,352,977.03	271,067,597.03
应收申购款	-	-	-	-	-	152,612.36	152,612.36
资产总计	7,544,725.34	1,501,050.00	11,413,010.00	-	-	255,505,729.13	275,964,514.47
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,121,112.89	4,121,112.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	242,056.47	242,056.47
应付托管费	-	-	-	-	-	24,205.64	24,205.64
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,441.07	15,441.07
应交税费	-	-	-	-	-	404.00	404.00
其他负债	-	-	-	-	-	78,505.15	78,505.15
应付清算款	-	-	-	-	-	2,779.28	2,779.28
负债总计	-	-	-	-	-	4,484,504.50	4,484,504.50
利率敏感度缺口	7,544,725.34	1,501,050.00	11,413,010.00	-	-	251,021,224.63	271,480,009.97
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	400,180.67	-	-	-	-	47.64	400,228.31
交易性金融资产	200,000.00	-	9,002,160.00	-	-	149,880,640.35	159,082,800.35
应收申购款	-	-	-	-	-	15,740,043.01	15,740,043.01
资产总计	600,180.67	-	9,002,160.00	-	-	165,620,731.00	175,223,071.67
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	421,880.61	421,880.61
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	106,263.24	106,263.24
应付托管费	-	-	-	-	-	10,626.33	10,626.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,672.96	6,672.96

应交税费	-	-	-	-	-	74.56	74.56
其他负债	-	-	-	-	-	139,549.29	139,549.29
应付清算款	-	-	-	-	-	24.00	24.00
负债总计	-	-	-	-	-	685,090.99	685,090.99
利率敏感度缺口	600,180.67	-	9,002,160.00	-	-	164,935,640.01	174,537,980.68

注：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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本报告期末及上年度末，市场利率上升或下降25个基点，对本基金资产净值无重大影响。

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

本基金所面临的其他价格风险主要是市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险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市场价格风险，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。

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	255,213,020.85	94.01	149,835,903.31	85.85
交易性金融资产	-	-	-	-

—基金投资				
交易性金融资产—债券投资	15,854,576.18	5.84	9,246,897.04	5.30
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	271,067,597.03	99.85	159,082,800.35	91.15

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	市场其他变量保持不变，只有业绩比较基准所对应的市场组合价格发生合理、可能的变动；		
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
	业绩比较基准变动+5%	21,319,819.58	12,211,633.94
	业绩比较基准变动-5%	-21,319,819.58	-12,211,633.94

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	255,192,740.72	149,787,775.31

第二层次	15,874,856.31	9,295,025.04
第三层次	-	-
合计	271,067,597.03	159,082,800.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收申购款和其他应付款项，其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告报出日，本基金无需要披露的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	255,213,020.85	92.48
	其中：股票	255,213,020.85	92.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,854,576.18	5.75
	其中：债券	15,854,576.18	5.75
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,744,305.08	1.72
8	其他各项资产	152,612.36	0.06
9	合计	275,964,514.47	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	8,558.00	0.00
B	采矿业	3,103,516.10	1.14
C	制造业	180,079,146.43	66.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	170,681.84	0.06
E	建筑业	63,012.00	0.02
F	批发和零售业	11,174,688.33	4.12
G	交通运输、仓储和邮政业	136,605.00	0.05
H	住宿和餐饮业	154,700.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,607,776.88	12.01
J	金融业	11,847,894.44	4.36
K	房地产业	24,655.40	0.01
L	租赁和商务服务业	860,137.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	6,571,139.43	2.42
N	水利、环境和公共设施管理业	4,564,984.00	1.68
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,186,044.00	0.81
Q	卫生和社会工作	416,444.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	1,243,038.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	255,213,020.85	94.01

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	603061	金海通	23,600	11,852,392.00	4.37
2	300738	奥飞数据	539,400	10,906,668.00	4.02
3	600051	宁波联合	1,776,300	10,000,569.00	3.68
4	300855	图南股份	288,500	9,018,510.00	3.32
5	688681	科汇股份	564,398	7,890,284.04	2.91
6	688198	佰仁医疗	85,924	7,667,857.76	2.82
7	688486	龙迅股份	112,012	7,121,722.96	2.62
8	300371	汇中股份	681,300	6,663,114.00	2.45
9	688239	航宇科技	109,548	6,554,256.84	2.41
10	688025	杰普特	13,914	6,539,580.00	2.41
11	688390	固德威	54,841	5,950,796.91	2.19
12	688717	艾罗能源	71,781	5,926,957.17	2.18
13	688293	奥浦迈	126,909	5,290,836.21	1.95
14	688667	菱电电控	37,231	4,975,923.15	1.83
15	688636	智明达	135,083	4,894,057.09	1.80
16	688616	西力科技	480,572	4,853,777.20	1.79
17	002961	瑞达期货	245,500	4,806,890.00	1.77
18	301130	西点药业	199,500	4,784,010.00	1.76
19	002616	长青集团	1,019,400	4,556,718.00	1.68
20	688356	键凯科技	57,423	4,426,164.84	1.63
21	000686	东北证券	497,400	4,178,160.00	1.54
22	300236	上海新阳	31,500	4,142,250.00	1.53
23	002566	益盛药业	629,500	3,802,180.00	1.40
24	688045	必易微	42,210	3,409,723.80	1.26
25	688255	凯尔达	118,438	3,292,576.40	1.21
26	688700	东威科技	35,458	3,169,945.20	1.17
27	301606	绿联科技	49,000	2,989,980.00	1.10
28	603998	方盛制药	309,100	2,791,173.00	1.03
29	688368	晶丰明源	12,788	2,768,857.76	1.02
30	688678	福立旺	114,424	2,765,628.08	1.02
31	002284	亚太股份	263,700	2,502,513.00	0.92
32	688113	联测科技	69,678	2,445,697.80	0.90

33	600037	歌华有线	389,200	2,440,284.00	0.90
34	603876	鼎胜新材	89,200	2,320,092.00	0.85
35	603041	美思德	221,800	2,300,066.00	0.85
36	603198	迎驾贡酒	77,300	2,288,080.00	0.84
37	600455	博通股份	99,300	2,180,628.00	0.80
38	002043	兔宝宝	183,200	2,029,856.00	0.75
39	688533	上声电子	96,048	2,003,561.28	0.74
40	301160	翔楼新材	41,515	1,936,674.75	0.71
41	600395	盘江股份	420,700	1,918,392.00	0.71
42	688088	虹软科技	53,259	1,893,357.45	0.70
43	603323	苏农银行	474,530	1,836,431.10	0.68
44	300602	飞荣达	35,300	1,807,360.00	0.67
45	301086	鸿富瀚	8,500	1,778,880.00	0.66
46	003017	大洋生物	74,040	1,702,920.00	0.63
47	300693	盛弘股份	33,800	1,647,750.00	0.61
48	002942	新农股份	113,200	1,622,156.00	0.60
49	688668	鼎通科技	4,312	1,609,669.60	0.59
50	300363	博腾股份	90,100	1,463,224.00	0.54
51	688410	山外山	100,782	1,447,229.52	0.53
52	300387	富邦科技	210,300	1,427,937.00	0.53
53	301391	卡莱特	23,500	1,341,850.00	0.49
54	688059	华锐精密	6,228	1,243,793.88	0.46
55	605577	龙版传媒	133,300	1,174,373.00	0.43
56	600099	林海股份	145,400	1,160,292.00	0.43
57	600573	惠泉啤酒	123,900	1,102,710.00	0.41
58	601798	蓝科高新	147,800	1,070,072.00	0.39
59	300424	航新科技	67,000	1,054,580.00	0.39
60	300987	川网传媒	84,990	1,045,377.00	0.39
61	688337	普源精电	12,097	906,428.21	0.33
62	002494	华斯股份	203,200	902,208.00	0.33
63	688215	瑞晟智能	21,775	874,484.00	0.32
64	688021	奥福科技	44,724	865,856.64	0.32
65	688095	福昕软件	13,404	796,599.72	0.29
66	002576	通达动力	54,100	765,515.00	0.28

67	603102	百合股份	24,000	757,680.00	0.28
68	301080	百普赛斯	15,040	721,920.00	0.27
69	301162	国能日新	15,120	661,500.00	0.24
70	300990	同飞股份	6,100	640,927.00	0.24
71	688067	爱威科技	30,894	622,514.10	0.23
72	603836	海程邦达	75,840	599,136.00	0.22
73	300976	达瑞电子	7,212	574,435.80	0.21
74	300286	安科瑞	23,100	557,865.00	0.21
75	688328	深科达	5,166	494,386.20	0.18
76	301489	思泉新材	2,861	470,863.38	0.17
77	600419	天润乳业	59,600	451,172.00	0.17
78	002991	甘源食品	11,300	446,463.00	0.16
79	605266	健之佳	30,240	442,713.60	0.16
80	605117	德业股份	4,156	441,284.08	0.16
81	603901	永创智能	40,300	438,061.00	0.16
82	688372	伟测科技	2,339	435,054.00	0.16
83	603659	璞泰来	14,900	431,057.00	0.16
84	301103	何氏眼科	27,800	416,444.00	0.15
85	300743	天地数码	26,840	391,595.60	0.14
86	002206	海利得	74,400	384,648.00	0.14
87	301163	宏德股份	16,300	361,534.00	0.13
88	600150	中国船舶	10,231	345,705.49	0.13
89	001218	丽臣实业	15,420	340,165.20	0.13
90	002128	电投能源	14,500	335,240.00	0.12
91	301033	迈普医学	6,300	326,277.00	0.12
92	601233	桐昆股份	14,400	311,760.00	0.11
93	002833	弘亚数控	16,100	310,569.00	0.11
94	600833	第一医药	30,100	271,502.00	0.10
95	002839	张家港行	68,300	266,370.00	0.10
96	300592	华凯易佰	14,600	258,420.00	0.10
97	000935	四川双马	9,900	258,291.00	0.10
98	000933	神火股份	12,100	256,520.00	0.09
99	002687	乔治白	48,500	254,140.00	0.09
100	601688	华泰证券	12,300	253,626.00	0.09

101	688269	凯立新材	7,906	250,699.26	0.09
102	688002	睿创微纳	1,535	237,449.15	0.09
103	600989	宝丰能源	11,600	235,828.00	0.09
104	688484	南芯科技	4,131	233,360.19	0.09
105	002281	光迅科技	900	231,246.00	0.09
106	002712	思美传媒	54,900	227,835.00	0.08
107	000603	盛达资源	9,800	226,380.00	0.08
108	300833	浩洋股份	7,300	220,314.00	0.08
109	000807	云铝股份	9,800	216,972.00	0.08
110	300073	当升科技	4,500	216,180.00	0.08
111	688600	皖仪科技	6,375	212,160.00	0.08
112	300772	运达股份	17,200	211,560.00	0.08
113	601899	紫金矿业	8,300	208,662.00	0.08
114	688127	蓝特光学	2,110	205,936.00	0.08
115	688692	达梦数据	842	205,692.18	0.08
116	002293	罗莱生活	20,500	202,745.00	0.07
117	301065	本立科技	11,150	196,797.50	0.07
118	688787	海天瑞声	1,450	194,952.50	0.07
119	600183	生益科技	1,100	190,740.00	0.07
120	601665	齐鲁银行	33,000	190,410.00	0.07
121	301607	富特科技	3,600	188,100.00	0.07
122	688778	厦钨新能	3,441	187,190.40	0.07
123	301345	涛涛车业	800	184,800.00	0.07
124	688536	思瑞浦	501	182,409.09	0.07
125	000657	中钨高新	1,900	181,868.00	0.07
126	002643	万润股份	8,421	176,419.95	0.06
127	688411	海博思创	602	175,302.40	0.06
128	688103	国力电子	2,351	174,937.91	0.06
129	002817	黄山胶囊	29,400	172,284.00	0.06
130	688786	悦安新材	3,732	171,970.56	0.06
131	000975	山金国际	9,900	168,300.00	0.06
132	002487	大金重工	2,900	168,113.00	0.06
133	002463	沪电股份	1,100	168,080.00	0.06
134	603986	兆易创新	200	163,000.00	0.06

135	002080	中材科技	1,800	162,000.00	0.06
136	002384	东山精密	600	157,410.00	0.06
137	002864	盘龙药业	6,000	154,800.00	0.06
138	301073	君亭酒店	8,500	154,700.00	0.06
139	688378	奥来德	2,303	142,786.00	0.05
140	301031	中熔电气	1,192	142,384.40	0.05
141	688200	华峰测控	268	140,726.80	0.05
142	002353	杰瑞股份	900	137,250.00	0.05
143	300645	正元智慧	11,500	135,355.00	0.05
144	002008	大族激光	900	135,099.00	0.05
145	688203	海正生材	12,816	127,903.68	0.05
146	300308	中际旭创	100	127,000.00	0.05
147	600111	北方稀土	2,600	124,930.00	0.05
148	000419	通程控股	27,700	124,927.00	0.05
149	002518	科士达	2,300	123,257.00	0.05
150	300583	赛托生物	10,800	121,284.00	0.04
151	301608	博实结	2,400	120,624.00	0.04
152	300893	松原安全	7,420	120,204.00	0.04
153	688401	路维光电	1,208	115,943.84	0.04
154	301536	星辰科技	900	115,839.00	0.04
155	300922	天秦装备	7,600	115,140.00	0.04
156	002838	道恩股份	3,700	113,294.00	0.04
157	601168	西部矿业	4,100	111,274.00	0.04
158	002249	大洋电机	14,800	111,000.00	0.04
159	600549	厦门钨业	1,300	110,760.00	0.04
160	002926	华西证券	13,400	109,478.00	0.04
161	603256	宏和科技	400	106,132.00	0.04
162	603181	皇马科技	6,300	102,186.00	0.04
163	002156	通富微电	1,300	98,631.00	0.04
164	688633	星球石墨	3,298	98,049.54	0.04
165	002544	普天科技	5,200	94,744.00	0.03
166	301110	青木科技	2,360	89,349.60	0.03
167	603297	永新光学	600	88,170.00	0.03
168	605338	巴比食品	4,800	85,920.00	0.03

169	000408	藏格矿业	1,200	83,184.00	0.03
170	003010	若羽臣	3,300	80,190.00	0.03
171	300196	长海股份	2,600	76,882.00	0.03
172	301185	鸥玛软件	5,100	75,786.00	0.03
173	600262	北方股份	3,800	75,202.00	0.03
174	300041	回天新材	4,600	71,484.00	0.03
175	603186	华正新材	300	67,590.00	0.02
176	688155	先惠技术	811	65,601.79	0.02
177	688073	毕得医药	1,179	63,453.78	0.02
178	688049	炬芯科技	1,311	61,499.01	0.02
179	000680	山推股份	6,000	60,300.00	0.02
180	688508	芯朋微	632	58,750.72	0.02
181	300756	金马游乐	1,760	58,168.00	0.02
182	688087	英科再生	1,723	57,582.66	0.02
183	603187	海容冷链	4,900	56,301.00	0.02
184	301377	鼎泰高科	100	55,090.00	0.02
185	688345	博力威	947	55,001.76	0.02
186	000100	TCL科技	9,100	52,962.00	0.02
187	603083	剑桥科技	200	50,974.00	0.02
188	001205	盛航股份	3,700	50,616.00	0.02
189	688219	会通股份	3,815	49,366.10	0.02
190	300790	宇瞳光学	1,880	49,086.80	0.02
191	601886	江河集团	6,100	48,983.00	0.02
192	003043	华亚智能	480	47,707.20	0.02
193	603350	安乃达	1,500	47,325.00	0.02
194	688258	卓易信息	388	45,993.52	0.02
195	002916	深南电路	100	45,790.00	0.02
196	300763	锦浪科技	500	45,175.00	0.02
197	001283	豪鹏科技	900	44,118.00	0.02
198	002911	佛燃能源	4,600	43,654.00	0.02
199	688708	佳驰科技	855	43,434.00	0.02
200	688183	生益电子	311	41,176.40	0.02
201	000783	长江证券	4,200	40,950.00	0.02
202	002895	川恒股份	1,400	40,880.00	0.02

203	688689	银河微电	627	40,579.44	0.01
204	603993	洛阳钼业	2,300	40,365.00	0.01
205	605319	无锡振华	1,760	39,934.40	0.01
206	300636	同和药业	6,200	39,494.00	0.01
207	301215	中汽股份	7,400	38,406.00	0.01
208	002736	国信证券	3,800	37,962.00	0.01
209	600098	广州发展	6,300	37,233.00	0.01
210	002222	福晶科技	400	36,912.00	0.01
211	002479	富春环保	8,700	36,627.00	0.01
212	300702	天宇股份	1,800	36,288.00	0.01
213	002671	龙泉股份	9,700	35,987.00	0.01
214	688267	中触媒	1,819	35,834.30	0.01
215	301528	多浦乐	435	35,626.50	0.01
216	688123	聚辰股份	167	35,504.20	0.01
217	000719	中原传媒	3,100	35,433.00	0.01
218	600595	中孚实业	6,100	34,282.00	0.01
219	301219	腾远钴业	600	32,880.00	0.01
220	601881	中国银河	2,600	32,682.00	0.01
221	002637	赞宇科技	3,100	32,643.00	0.01
222	300207	欣旺达	1,700	32,283.00	0.01
223	300409	道氏技术	1,600	31,888.00	0.01
224	603309	维力医疗	2,800	31,416.00	0.01
225	688662	富信科技	183	30,744.00	0.01
226	688557	兰剑智能	926	28,733.78	0.01
227	688279	峰昭科技	128	28,728.32	0.01
228	603713	密尔克卫	400	28,468.00	0.01
229	601901	方正证券	3,500	25,200.00	0.01
230	688233	神工股份	117	25,087.14	0.01
231	600060	海信视像	900	25,083.00	0.01
232	300009	安科生物	3,100	24,335.00	0.01
233	603071	物产环能	2,200	24,332.00	0.01
234	603979	金诚信	400	23,612.00	0.01
235	002468	申通快递	1,600	23,296.00	0.01
236	603031	安孚科技	435	23,163.75	0.01

237	600019	宝钢股份	4,100	22,263.00	0.01
238	300694	蠡湖股份	2,300	22,080.00	0.01
239	300035	中科电气	1,500	21,630.00	0.01
240	688018	乐鑫科技	168	21,490.56	0.01
241	000951	中国重汽	1,100	21,461.00	0.01
242	601963	重庆银行	2,100	21,168.00	0.01
243	601101	昊华能源	2,000	21,120.00	0.01
244	688362	甬矽电子	219	21,111.60	0.01
245	002233	塔牌集团	3,000	20,910.00	0.01
246	601900	南方传媒	1,900	20,634.00	0.01
247	603556	海兴电力	910	20,020.00	0.01
248	600969	郴电国际	2,600	19,838.00	0.01
249	605123	派克新材	200	19,402.00	0.01
250	300837	浙矿股份	800	19,008.00	0.01
251	603893	瑞芯微	100	18,836.00	0.01
252	688072	拓荆科技	21	18,470.13	0.01
253	605058	澳弘电子	501	18,116.16	0.01
254	688261	东微半导	172	18,047.96	0.01
255	688612	威迈斯	609	18,020.31	0.01
256	001228	永泰运	700	17,885.00	0.01
257	000159	国际实业	3,300	17,754.00	0.01
258	002035	华帝股份	3,900	17,628.00	0.01
259	688146	中船特气	50	17,499.50	0.01
260	688347	华虹宏力	52	17,487.60	0.01
261	003041	真爱美家	400	17,460.00	0.01
262	688257	新锐股份	165	16,813.50	0.01
263	688300	联瑞新材	67	16,374.80	0.01
264	300274	阳光电源	100	15,902.00	0.01
265	600533	栖霞建设	8,400	15,876.00	0.01
266	688120	华海清科	48	15,464.64	0.01
267	688392	骄成超声	65	14,766.70	0.01
268	300703	创源股份	1,100	14,047.00	0.01
269	603706	东方环宇	800	13,832.00	0.01
270	688657	浩辰软件	381	13,628.37	0.01

271	688109	品茗科技	178	13,474.60	0.00
272	688181	八亿时空	215	13,459.00	0.00
273	002344	海宁皮城	3,600	12,600.00	0.00
274	603259	药明康德	100	12,451.00	0.00
275	688029	南微医学	167	11,990.60	0.00
276	301095	广立微	100	11,805.00	0.00
277	603489	八方股份	400	11,184.00	0.00
278	600487	亨通光电	100	10,934.00	0.00
279	600160	巨化股份	200	10,602.00	0.00
280	688160	步科股份	97	10,550.69	0.00
281	002484	江海股份	100	10,500.00	0.00
282	605259	绿田机械	560	10,046.40	0.00
283	601595	上海电影	600	9,960.00	0.00
284	605111	新洁能	100	9,914.00	0.00
285	300697	电工合金	650	9,847.50	0.00
286	603799	华友钴业	200	9,652.00	0.00
287	603859	能科科技	200	9,596.00	0.00
288	600012	皖通高速	600	9,456.00	0.00
289	002980	华盛昌	80	9,323.20	0.00
290	601137	博威合金	400	8,932.00	0.00
291	300842	帝科股份	100	8,917.00	0.00
292	688661	和林微纳	56	8,902.88	0.00
293	603301	振德医疗	100	8,716.00	0.00
294	600362	江西铜业	201	8,703.30	0.00
295	002948	青岛银行	1,700	8,636.00	0.00
296	600030	中信证券	300	8,619.00	0.00
297	600097	开创国际	1,100	8,558.00	0.00
298	688475	萤石网络	312	8,533.20	0.00
299	603628	清源股份	900	8,460.00	0.00
300	688009	中国通号	1,762	8,387.12	0.00
301	300442	润泽科技	100	8,307.00	0.00
302	600785	新华百货	840	8,232.00	0.00
303	688608	恒玄科技	49	8,192.31	0.00
304	600929	雪天盐业	1,800	8,172.00	0.00

305	603739	蔚蓝生物	700	8,071.00	0.00
306	688092	爱科科技	373	7,922.52	0.00
307	002990	盛视科技	100	7,900.00	0.00
308	605377	华旺科技	840	7,812.00	0.00
309	603028	赛福天	1,200	7,764.00	0.00
310	603267	鸿远电子	100	7,748.00	0.00
311	605158	华达新材	1,200	7,680.00	0.00
312	605166	聚合顺	800	7,672.00	0.00
313	600469	风神股份	1,400	7,616.00	0.00
314	601609	金田股份	700	7,560.00	0.00
315	000333	美的集团	100	7,553.00	0.00
316	002438	江苏神通	500	7,465.00	0.00
317	600897	厦门空港	500	7,300.00	0.00
318	688550	瑞联新材	125	7,231.25	0.00
319	600489	中金黄金	400	7,220.00	0.00
320	601138	工业富联	100	7,215.00	0.00
321	300653	正海生物	500	7,180.00	0.00
322	603236	移远通信	140	7,163.80	0.00
323	002993	奥海科技	100	7,161.00	0.00
324	603045	福达合金	100	7,139.00	0.00
325	603700	宁水集团	600	6,966.00	0.00
326	301502	华阳智能	100	6,952.00	0.00
327	601918	新集能源	800	6,872.00	0.00
328	603681	永冠新材	300	6,855.00	0.00
329	688129	东来技术	260	6,809.40	0.00
330	605088	冠盛股份	241	6,791.38	0.00
331	603192	汇得科技	400	6,776.00	0.00
332	601089	福元医药	400	6,512.00	0.00
333	603790	雅运股份	300	6,402.00	0.00
334	002749	国光股份	796	6,352.08	0.00
335	688150	莱特光电	92	6,313.04	0.00
336	688231	隆达股份	170	6,244.10	0.00
337	000028	国药一致	330	6,240.30	0.00
338	000923	河钢资源	500	6,205.00	0.00

339	601077	渝农商行	1,000	6,110.00	0.00
340	601898	中煤能源	500	6,090.00	0.00
341	601388	怡球资源	2,100	5,943.00	0.00
342	301257	普蕊斯	130	5,899.40	0.00
343	002508	老板电器	400	5,848.00	0.00
344	300909	汇创达	100	5,822.00	0.00
345	600875	东方电气	200	5,754.00	0.00
346	605337	李子园	700	5,740.00	0.00
347	603339	四方科技	400	5,716.00	0.00
348	688188	柏楚电子	53	5,655.10	0.00
349	000507	珠海港	1,200	5,616.00	0.00
350	603326	我乐家居	900	5,544.00	0.00
351	600583	海油工程	1,100	5,533.00	0.00
352	002155	湖南黄金	230	5,490.10	0.00
353	003033	征和工业	100	5,451.00	0.00
354	605098	行动教育	100	5,416.00	0.00
355	603201	常润股份	385	5,374.60	0.00
356	301003	江苏博云	100	5,350.00	0.00
357	600386	北巴传媒	1,700	5,304.00	0.00
358	603966	法兰泰克	650	5,297.50	0.00
359	688590	新致软件	421	5,233.03	0.00
360	603967	中创物流	500	5,175.00	0.00
361	600059	古越龙山	700	5,124.00	0.00
362	600660	福耀玻璃	100	5,044.00	0.00
363	603112	华翔股份	300	5,019.00	0.00
364	002909	集泰股份	1,000	4,940.00	0.00
365	603156	养元饮品	100	4,907.00	0.00
366	603351	威尔药业	200	4,882.00	0.00
367	600104	上汽集团	500	4,880.00	0.00
368	603059	倍加洁	200	4,850.00	0.00
369	603920	世运电路	100	4,804.00	0.00
370	688663	新风光	54	4,776.84	0.00
371	605066	天正电气	700	4,753.00	0.00
372	300872	天阳科技	300	4,740.00	0.00

373	002401	中远海科	400	4,644.00	0.00
374	603968	醋化股份	500	4,630.00	0.00
375	600250	南京商旅	600	4,626.00	0.00
376	002179	中航光电	100	4,620.00	0.00
377	600547	山东黄金	200	4,618.00	0.00
378	001979	招商蛇口	700	4,501.00	0.00
379	601825	沪农商行	600	4,494.00	0.00
380	301168	通灵股份	100	4,491.00	0.00
381	600566	济川药业	200	4,438.00	0.00
382	600642	申能股份	500	4,365.00	0.00
383	000926	福星股份	2,240	4,278.40	0.00
384	002060	广东建工	1,400	4,242.00	0.00
385	603020	爱普股份	300	4,230.00	0.00
386	605305	中际联合	100	4,192.00	0.00
387	605287	德才股份	100	4,149.00	0.00
388	301061	匠心家居	117	4,103.19	0.00
389	600483	福能股份	400	4,076.00	0.00
390	605020	永和股份	100	4,072.00	0.00
391	600854	春兰股份	1,000	4,070.00	0.00
392	601298	青岛港	500	4,025.00	0.00
393	603022	新通联	500	3,995.00	0.00
394	002032	苏泊尔	100	3,960.00	0.00
395	688799	华纳药厂	88	3,948.56	0.00
396	688357	建龙微纳	133	3,919.51	0.00
397	600488	津药药业	800	3,864.00	0.00
398	601003	柳钢股份	1,100	3,707.00	0.00
399	001215	千味央厨	100	3,690.00	0.00
400	603596	伯特利	148	3,676.32	0.00
401	300785	值得买	100	3,667.00	0.00
402	002605	姚记科技	200	3,654.00	0.00
403	601728	中国电信	700	3,633.00	0.00
404	002271	东方雨虹	300	3,561.00	0.00
405	600036	招商银行	100	3,550.00	0.00
406	603926	铁流股份	200	3,538.00	0.00

407	601058	赛轮轮胎	300	3,459.00	0.00
408	002824	和胜股份	100	3,458.00	0.00
409	301353	普莱得	208	3,454.88	0.00
410	601619	嘉泽新能	800	3,440.00	0.00
411	688591	泰凌微	100	3,438.00	0.00
412	688032	禾迈股份	40	3,380.80	0.00
413	688296	和达科技	294	3,363.36	0.00
414	600727	鲁北化工	500	3,360.00	0.00
415	603810	丰山集团	300	3,339.00	0.00
416	300791	仙乐健康	208	3,332.16	0.00
417	603151	邦基科技	300	3,297.00	0.00
418	688656	浩欧博	34	3,290.18	0.00
419	600482	中国动力	100	3,280.00	0.00
420	600517	国网英大	700	3,276.00	0.00
421	605009	豪悦护理	140	3,263.40	0.00
422	603897	长城科技	100	3,246.00	0.00
423	000999	华润三九	143	3,216.07	0.00
424	600184	光电股份	100	3,201.00	0.00
425	600741	华域汽车	200	3,104.00	0.00
426	601607	上海医药	200	3,080.00	0.00
427	600731	湖南海利	600	3,072.00	0.00
428	002276	万马股份	300	3,033.00	0.00
429	002461	珠江啤酒	400	3,028.00	0.00
430	301330	熵基科技	120	3,007.20	0.00
431	301266	宇邦新材	130	2,969.20	0.00
432	600388	龙净环保	200	2,910.00	0.00
433	300660	江苏雷利	104	2,897.44	0.00
434	688162	巨一科技	122	2,884.08	0.00
435	688046	药康生物	119	2,879.80	0.00
436	600710	苏美达	300	2,868.00	0.00
437	601601	中国太保	100	2,852.00	0.00
438	601878	浙商证券	300	2,850.00	0.00
439	301278	快可电子	100	2,840.00	0.00
440	688510	航亚科技	116	2,770.08	0.00

441	002801	微光股份	100	2,760.00	0.00
442	688236	春立医疗	190	2,747.40	0.00
443	600323	瀚蓝环境	100	2,746.00	0.00
444	688252	天德钰	113	2,712.00	0.00
445	301195	北路智控	100	2,710.00	0.00
446	300435	中泰股份	100	2,707.00	0.00
447	300908	仲景食品	122	2,688.88	0.00
448	603758	秦安股份	300	2,682.00	0.00
449	600066	宇通客车	100	2,681.00	0.00
450	600988	赤峰黄金	100	2,632.00	0.00
451	605016	百龙创园	100	2,585.00	0.00
452	600312	平高电气	145	2,560.70	0.00
453	603909	建发合诚	300	2,559.00	0.00
454	688136	科兴制药	119	2,464.49	0.00
455	300827	上能电气	80	2,463.20	0.00
456	600722	金牛化工	300	2,436.00	0.00
457	603948	建业股份	100	2,410.00	0.00
458	605222	起帆电缆	100	2,332.00	0.00
459	603995	甬金股份	100	2,321.00	0.00
460	600128	苏豪弘业	300	2,277.00	0.00
461	603755	日辰股份	100	2,269.00	0.00
462	603217	元利科技	100	2,243.00	0.00
463	688682	霍莱沃	57	2,217.30	0.00
464	000400	许继电气	100	2,170.00	0.00
465	600057	厦门象屿	400	2,168.00	0.00
466	603939	益丰药房	120	2,157.60	0.00
467	603518	锦泓集团	300	2,145.00	0.00
468	300994	久祺股份	200	2,134.00	0.00
469	300457	赢合科技	100	2,108.00	0.00
470	603987	康德莱	300	2,070.00	0.00
471	002773	康弘药业	100	2,045.00	0.00
472	603218	日月股份	200	2,044.00	0.00
473	300539	横河精密	100	2,037.00	0.00
474	002580	圣阳股份	100	2,016.00	0.00

475	603505	金石资源	100	2,015.00	0.00
476	301050	雷电微力	60	2,006.40	0.00
477	601169	北京银行	400	1,960.00	0.00
478	002880	卫光生物	100	1,948.00	0.00
479	600578	京能电力	300	1,935.00	0.00
480	688186	广大特材	126	1,908.90	0.00
481	001206	依依股份	100	1,876.00	0.00
482	603589	口子窖	100	1,868.00	0.00
483	600479	千金药业	200	1,860.00	0.00
484	688687	凯因科技	113	1,843.03	0.00
485	688314	康拓医疗	54	1,829.52	0.00
486	003011	海象新材	100	1,817.00	0.00
487	603093	南华期货	100	1,815.00	0.00
488	601369	陕鼓动力	200	1,810.00	0.00
489	600862	中航高科	100	1,803.00	0.00
490	002106	莱宝高科	100	1,752.00	0.00
491	603320	迪贝电气	100	1,745.00	0.00
492	301106	骏成科技	84	1,742.16	0.00
493	002600	领益智造	100	1,734.00	0.00
494	600031	三一重工	100	1,728.00	0.00
495	603888	新华网	100	1,703.00	0.00
496	605033	美邦股份	100	1,664.00	0.00
497	002236	大华股份	100	1,649.00	0.00
498	000920	沃顿科技	100	1,646.00	0.00
499	601600	中国铝业	200	1,644.00	0.00
500	603829	洛凯股份	100	1,637.00	0.00
501	000589	贵州轮胎	400	1,624.00	0.00
502	603611	诺力股份	100	1,619.00	0.00
503	605167	利柏特	100	1,610.00	0.00
504	600062	华润双鹤	100	1,604.00	0.00
505	600694	大商股份	121	1,600.83	0.00
506	605567	春雪食品	200	1,598.00	0.00
507	601555	东吴证券	200	1,584.00	0.00
508	600299	安迪苏	200	1,570.00	0.00

509	605189	富春染织	130	1,566.50	0.00
510	000869	张裕A	100	1,558.00	0.00
511	605378	野马电池	112	1,552.32	0.00
512	603579	荣泰健康	90	1,527.30	0.00
513	300674	宇信科技	100	1,505.00	0.00
514	600713	南京医药	300	1,500.00	0.00
515	688056	莱伯泰科	23	1,484.65	0.00
516	300925	法本信息	100	1,479.00	0.00
517	688501	青达环保	77	1,478.40	0.00
518	605183	确成股份	100	1,474.00	0.00
519	002237	恒邦股份	100	1,469.00	0.00
520	600926	杭州银行	100	1,445.00	0.00
521	000625	长安汽车	200	1,434.00	0.00
522	600985	淮北矿业	100	1,405.00	0.00
523	300298	三诺生物	100	1,395.00	0.00
524	002367	康力电梯	200	1,382.00	0.00
525	603759	海天股份	200	1,376.00	0.00
526	300705	九典制药	140	1,369.20	0.00
527	300535	达威股份	100	1,363.00	0.00
528	001222	源飞宠物	100	1,328.00	0.00
529	603161	科华控股	100	1,327.00	0.00
530	688578	艾力斯	12	1,310.40	0.00
531	300389	艾比森	100	1,282.00	0.00
532	301000	肇民科技	40	1,280.40	0.00
533	301156	美农生物	117	1,271.79	0.00
534	000708	中信特钢	100	1,262.00	0.00
535	688259	创耀科技	32	1,251.84	0.00
536	300789	唐源电气	70	1,243.90	0.00
537	300233	金城医药	100	1,240.00	0.00
537	002732	燕塘乳业	100	1,240.00	0.00
538	603158	腾龙股份	100	1,223.00	0.00
539	002275	桂林三金	100	1,219.00	0.00
540	688558	国盛智科	37	1,215.82	0.00
541	603214	爱婴室	100	1,211.00	0.00

542	300218	安利股份	100	1,190.00	0.00
543	300589	江龙船艇	100	1,180.00	0.00
544	002722	物产金轮	100	1,179.00	0.00
545	600557	康缘药业	100	1,177.00	0.00
546	600268	国电南自	100	1,162.00	0.00
547	600377	宁沪高速	100	1,157.00	0.00
548	002835	同为股份	100	1,147.00	0.00
549	603170	宝立食品	100	1,130.00	0.00
550	002705	新宝股份	100	1,108.00	0.00
551	603520	司太立	100	1,104.00	0.00
552	601811	新华文轩	100	1,094.00	0.00
553	600372	中航机载	100	1,085.00	0.00
554	002507	涪陵榨菜	100	1,080.00	0.00
555	002790	瑞尔特	200	1,064.00	0.00
556	002011	盾安环境	100	1,061.00	0.00
557	002429	兆驰股份	100	1,039.00	0.00
558	300951	博硕科技	20	1,010.00	0.00
559	600968	海油发展	300	999.00	0.00
560	600577	精达股份	100	978.00	0.00
561	300993	玉马科技	100	972.00	0.00
562	600033	福建高速	300	966.00	0.00
563	301327	华宝新能	20	961.40	0.00
564	603697	有友食品	100	959.00	0.00
565	603577	汇金通	100	942.00	0.00
566	600615	鑫源智造	100	924.00	0.00
567	300453	三鑫医疗	100	904.00	0.00
568	000888	峨眉山A	100	894.00	0.00
569	601928	凤凰传媒	100	879.00	0.00
570	000600	建投能源	100	875.00	0.00
571	601857	中国石油	100	868.00	0.00
571	000725	京东方A	100	868.00	0.00
572	688208	道通科技	33	831.27	0.00
573	600637	东方明珠	100	831.00	0.00
574	688391	钜泉科技	23	825.01	0.00

575	002332	仙琚制药	100	806.00	0.00
576	002242	九阳股份	100	786.00	0.00
577	000987	越秀资本	100	782.00	0.00
578	601311	骆驼股份	100	779.00	0.00
579	002809	红墙股份	100	744.00	0.00
580	300824	北鼎股份	100	718.00	0.00
581	300590	移为通信	50	717.50	0.00
582	603689	皖天然气	100	693.00	0.00
583	300897	山科智能	48	668.64	0.00
584	600551	时代出版	100	665.00	0.00
585	603889	新澳股份	130	664.30	0.00
586	002340	格林美	100	661.00	0.00
587	603507	振江股份	20	657.80	0.00
588	688565	力源科技	68	642.60	0.00
589	688223	晶科能源	126	598.50	0.00
590	688015	交控科技	38	584.44	0.00
591	601800	中国交建	100	571.00	0.00
592	002264	新华都	100	564.00	0.00
593	300292	吴通控股	100	542.00	0.00
594	603569	长久物流	100	530.00	0.00
595	301102	兆讯传媒	60	513.00	0.00
596	601669	中国电建	100	470.00	0.00
597	688035	德邦科技	5	459.00	0.00
598	600582	天地科技	100	445.00	0.00
599	603176	汇通集团	100	428.00	0.00
600	002807	江阴银行	110	408.10	0.00
601	688677	海泰新光	4	404.52	0.00
602	688606	奥泰生物	9	369.72	0.00
603	688013	天臣医疗	14	345.38	0.00
604	688798	艾为电子	4	293.28	0.00
605	688377	迪威尔	12	282.96	0.00
606	002437	誉衡药业	100	270.00	0.00
607	688503	聚和材料	2	265.40	0.00
608	688132	邦彦技术	20	263.00	0.00

609	003038	鑫铂股份	20	226.20	0.00
610	603725	天安新材	20	226.00	0.00
611	000552	甘肃能化	100	224.00	0.00
612	688117	圣诺生物	8	216.24	0.00
613	300884	狄耐克	20	198.40	0.00
614	688800	瑞可达	2	191.94	0.00
615	688131	皓元医药	2	189.20	0.00
616	601128	常熟银行	32	186.24	0.00
617	301319	唯特偶	1	167.33	0.00
618	688332	中科蓝讯	1	157.50	0.00
619	000153	丰原药业	20	101.40	0.00
620	688628	优利德	1	98.94	0.00
621	688138	清溢光电	2	94.00	0.00
622	688379	华光新材	1	84.03	0.00
623	688559	海目星	1	83.92	0.00
624	688419	耐科装备	1	78.65	0.00
625	688315	诺禾致源	4	50.04	0.00
626	688439	振华风光	1	46.20	0.00
627	605162	新中港	4	30.84	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	688681	科汇股份	19,537,728.64	11.19
2	603071	物产环能	15,027,291.00	8.61
3	688786	悦安新材	14,645,579.39	8.39
4	688633	星球石墨	13,464,028.45	7.71
5	600051	宁波联合	13,031,474.00	7.47
6	300738	奥飞数据	12,881,833.00	7.38
7	603556	海兴电力	12,683,295.00	7.27
8	002284	亚太股份	12,540,398.00	7.18
9	300855	图南股份	12,062,641.00	6.91

10	688049	炬芯科技	11,730,796.66	6.72
11	002293	罗莱生活	11,392,689.00	6.53
12	002206	海利得	11,018,715.00	6.31
13	688390	固德威	10,995,804.58	6.30
14	000603	盛达资源	10,894,584.00	6.24
15	300371	汇中股份	10,640,009.00	6.10
16	688550	瑞联新材	10,458,449.57	5.99
17	002687	乔治白	9,808,999.00	5.62
18	688616	西力科技	9,773,003.41	5.60
19	688708	佳驰科技	9,740,514.68	5.58
20	688551	科威尔	9,693,431.65	5.55
21	688484	南芯科技	9,543,906.50	5.47
22	001218	丽臣实业	9,504,887.00	5.45
23	001283	豪鹏科技	9,466,637.00	5.42
24	688239	航宇科技	9,395,998.84	5.38
25	688486	龙迅股份	9,290,432.45	5.32
26	688636	智明达	9,226,284.66	5.29
27	688155	先惠技术	9,217,456.57	5.28
28	688557	兰剑智能	9,212,605.52	5.28
29	688073	毕得医药	8,779,702.18	5.03
30	300922	天秦装备	8,755,047.00	5.02
31	688255	凯尔达	8,676,273.50	4.97
32	002616	长青集团	8,669,819.00	4.97
33	000686	东北证券	8,589,181.00	4.92
34	301606	绿联科技	8,556,965.00	4.90
35	605266	健之佳	8,516,066.00	4.88
36	688401	路维光电	8,430,529.65	4.83
37	688087	英科再生	8,395,374.37	4.81
38	300772	运达股份	8,364,717.00	4.79
39	600262	北方股份	8,353,203.00	4.79
40	688668	鼎通科技	8,329,463.71	4.77
41	688219	会通股份	8,234,637.23	4.72
42	603061	金海通	7,927,262.65	4.54
43	300756	金马游乐	7,804,330.00	4.47

44	600057	厦门象屿	7,649,068.00	4.38
45	688103	国力电子	7,511,407.78	4.30
46	688293	奥浦迈	7,400,558.36	4.24
47	000935	四川双马	7,379,071.00	4.23
48	688657	浩辰软件	7,377,765.83	4.23
49	301162	国能日新	7,299,479.00	4.18
50	688198	佰仁医疗	7,256,781.25	4.16
51	600455	博通股份	7,242,068.00	4.15
52	688717	艾罗能源	7,205,654.72	4.13
53	002961	瑞达期货	7,162,375.00	4.10
54	300236	上海新阳	7,152,069.00	4.10
55	301163	宏德股份	7,149,509.00	4.10
56	300535	达威股份	7,091,502.00	4.06
57	300602	飞荣达	6,887,596.00	3.95
58	688372	伟测科技	6,752,265.88	3.87
59	003017	大洋生物	6,750,500.60	3.87
60	688269	凯立新材	6,646,799.33	3.81
61	603073	彩蝶实业	6,618,382.00	3.79
62	688357	建龙微纳	6,613,527.40	3.79
63	688410	山外山	6,574,623.28	3.77
64	688215	瑞晟智能	6,563,303.07	3.76
65	601798	蓝科高新	6,400,613.00	3.67
66	301031	中熔电气	6,390,966.00	3.66
67	002864	盘龙药业	6,347,279.00	3.64
68	300893	松原安全	6,287,436.40	3.60
69	688677	海泰新光	6,168,381.44	3.53
70	603500	祥和实业	6,153,072.00	3.53
71	688356	键凯科技	6,148,552.54	3.52
72	603236	移远通信	5,979,106.00	3.43
73	301130	西点药业	5,952,374.00	3.41
74	688787	海天瑞声	5,895,524.68	3.38
75	301110	青木科技	5,794,072.00	3.32
76	603700	宁水集团	5,788,479.00	3.32
77	301185	鸥玛软件	5,716,384.00	3.28

78	601600	中国铝业	5,668,586.00	3.25
79	688046	药康生物	5,603,388.98	3.21
80	603323	苏农银行	5,574,174.00	3.19
81	603297	永新光学	5,531,946.00	3.17
82	688612	威迈斯	5,428,372.28	3.11
83	603320	迪贝电气	5,395,565.00	3.09
84	688045	必易微	5,224,073.55	2.99
85	688162	巨一科技	5,099,700.01	2.92
86	605577	龙版传媒	5,091,808.00	2.92
87	688358	祥生医疗	5,084,322.73	2.91
88	688667	菱电电控	5,066,130.15	2.90
89	002839	张家港行	5,031,776.00	2.88
90	688386	泛亚微透	5,031,179.59	2.88
91	002043	兔宝宝	4,994,928.00	2.86
92	688025	杰普特	4,930,727.67	2.83
93	603351	威尔药业	4,893,476.00	2.80
94	688123	聚辰股份	4,804,449.41	2.75
95	600989	宝丰能源	4,778,487.00	2.74
96	688591	泰凌微	4,713,521.21	2.70
97	600160	巨化股份	4,704,646.00	2.70
98	603214	爱婴室	4,691,186.00	2.69
99	301033	迈普医学	4,677,654.00	2.68
100	605001	威奥股份	4,644,902.00	2.66
101	688113	联测科技	4,593,232.79	2.63
102	601377	兴业证券	4,585,195.00	2.63
103	301080	百普赛斯	4,575,821.00	2.62
104	300286	安科瑞	4,560,238.00	2.61
105	688056	莱伯泰科	4,531,516.60	2.60
106	301160	翔楼新材	4,521,162.00	2.59
107	688029	南微医学	4,509,799.19	2.58
108	603993	洛阳钼业	4,483,106.00	2.57
109	605305	中际联合	4,395,045.00	2.52
110	601138	工业富联	4,391,182.00	2.52
111	688345	博力威	4,387,875.15	2.51

112	688095	福昕软件	4,378,525.59	2.51
113	600037	歌华有线	4,348,403.00	2.49
114	688163	赛伦生物	4,319,847.18	2.48
115	301065	本立科技	4,264,123.50	2.44
116	002576	通达动力	4,228,319.00	2.42
117	600419	天润乳业	4,223,657.00	2.42
118	688131	皓元医药	4,216,592.70	2.42
119	002566	益盛药业	4,208,858.00	2.41
120	300845	捷安高科	4,181,261.00	2.40
121	600150	中国船舶	4,180,676.00	2.40
122	301607	富特科技	4,117,559.00	2.36
123	603187	海容冷链	4,068,836.00	2.33
124	603998	方盛制药	4,037,064.00	2.31
125	605088	冠盛股份	3,983,739.00	2.28
126	002671	龙泉股份	3,920,431.00	2.25
127	688533	上声电子	3,894,307.78	2.23
128	601609	金田股份	3,854,552.00	2.21
129	301103	何氏眼科	3,681,539.00	2.11
130	688686	奥普特	3,644,921.13	2.09
131	688517	金冠电气	3,588,526.11	2.06
132	688321	微芯生物	3,536,682.42	2.03
133	301029	怡合达	3,515,747.00	2.01
134	300790	宇瞳光学	3,507,397.00	2.01
135	688138	清溢光电	3,506,365.06	2.01

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

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	688633	星球石墨	17,380,905.89	9.96

2	688786	悦安新材	16,372,432.92	9.38
3	603071	物产环能	15,657,318.00	8.97
4	688668	鼎通科技	14,958,221.80	8.57
5	688677	海泰新光	12,841,969.50	7.36
6	688551	科威尔	12,279,839.39	7.04
7	688155	先惠技术	12,001,738.03	6.88
8	688049	炬芯科技	11,988,178.32	6.87
9	002206	海利得	11,863,060.00	6.80
10	001218	丽臣实业	11,814,197.80	6.77
11	603556	海兴电力	11,812,861.00	6.77
12	002293	罗莱生活	11,335,923.00	6.49
13	688681	科汇股份	11,091,418.75	6.35
14	688484	南芯科技	10,657,146.14	6.11
15	688401	路维光电	10,636,245.10	6.09
16	301031	中熔电气	10,252,296.84	5.87
17	688550	瑞联新材	10,054,742.69	5.76
18	001283	豪鹏科技	9,934,561.00	5.69
19	000603	盛达资源	9,722,383.00	5.57
20	688087	英科再生	9,586,807.50	5.49
21	688708	佳驰科技	9,564,027.40	5.48
22	300922	天秦装备	9,338,800.00	5.35
23	002687	乔治白	9,209,906.00	5.28
24	301163	宏德股份	8,828,467.00	5.06
25	688103	国力电子	8,752,778.62	5.01
26	603073	彩蝶实业	8,628,076.00	4.94
27	600262	北方股份	8,297,514.00	4.75
28	688557	兰剑智能	8,286,955.25	4.75
29	300535	达威股份	8,188,948.00	4.69
30	688219	会通股份	8,112,103.17	4.65
31	000935	四川双马	7,960,227.00	4.56
32	688269	凯立新材	7,746,974.80	4.44
33	688046	药康生物	7,732,767.19	4.43
34	002284	亚太股份	7,678,681.00	4.40
35	603236	移远通信	7,582,404.00	4.34

36	300756	金马游乐	7,557,611.00	4.33
37	688073	毕得医药	7,528,090.77	4.31
38	600057	厦门象屿	7,361,243.00	4.22
39	300772	运达股份	7,210,526.00	4.13
40	688657	浩辰软件	7,068,070.32	4.05
41	605266	健之佳	6,933,712.00	3.97
42	688163	赛伦生物	6,824,722.58	3.91
43	688372	伟测科技	6,807,858.97	3.90
44	300602	飞荣达	6,703,975.00	3.84
45	688357	建龙微纳	6,689,541.17	3.83
46	301162	国能日新	6,501,581.80	3.73
47	603297	永新光学	6,481,086.00	3.71
48	688056	莱伯泰科	6,462,875.87	3.70
49	688612	威迈斯	6,435,004.24	3.69
50	603320	迪贝电气	6,372,646.00	3.65
51	301110	青木科技	6,306,907.00	3.61
52	605001	威奥股份	6,170,523.00	3.54
53	300845	捷安高科	5,952,154.00	3.41
54	003017	大洋生物	5,920,184.60	3.39
55	301065	本立科技	5,903,673.00	3.38
56	301185	鸥玛软件	5,812,029.00	3.33
57	300893	松原安全	5,796,984.00	3.32
58	600160	巨化股份	5,794,944.00	3.32
59	688123	聚辰股份	5,792,974.98	3.32
60	002864	盘龙药业	5,782,147.00	3.31
61	600989	宝丰能源	5,696,397.00	3.26
62	601600	中国铝业	5,690,562.00	3.26
63	688787	海天瑞声	5,682,786.38	3.26
64	603500	祥和实业	5,665,628.00	3.25
65	603700	宁水集团	5,603,452.00	3.21
66	603993	洛阳钼业	5,422,507.00	3.11
67	688345	博力威	5,285,405.08	3.03
68	688386	泛亚微透	5,175,929.30	2.97
69	600479	千金药业	5,098,082.00	2.92

70	600507	方大特钢	5,097,714.00	2.92
71	688162	巨一科技	5,073,779.60	2.91
72	301080	百普赛斯	5,054,412.00	2.90
73	002576	通达动力	5,022,670.00	2.88
74	300286	安科瑞	4,933,316.00	2.83
75	688358	祥生医疗	4,926,085.55	2.82
76	688131	皓元医药	4,787,799.19	2.74
77	601138	工业富联	4,780,706.00	2.74
78	688410	山外山	4,760,221.32	2.73
79	603351	威尔药业	4,682,594.00	2.68
80	000686	东北证券	4,658,234.00	2.67
81	002839	张家港行	4,651,879.00	2.67
82	688395	正弦电气	4,574,645.67	2.62
83	301606	绿联科技	4,573,842.54	2.62
84	688255	凯尔达	4,522,686.49	2.59
85	688029	南微医学	4,502,431.59	2.58
86	603267	鸿远电子	4,501,418.00	2.58
87	688390	固德威	4,473,236.08	2.56
88	601798	蓝科高新	4,459,857.00	2.56
89	301033	迈普医学	4,399,684.00	2.52
90	601377	兴业证券	4,391,507.00	2.52
91	603214	爱婴室	4,332,663.00	2.48
92	301607	富特科技	4,274,014.00	2.45
93	688486	龙迅股份	4,218,132.10	2.42
94	688215	瑞晟智能	4,216,612.72	2.42
95	600150	中国船舶	4,215,144.00	2.42
96	605305	中际联合	4,167,148.89	2.39
97	688591	泰凌微	4,148,459.28	2.38
98	688200	华峰测控	4,137,946.29	2.37
99	688138	清溢光电	4,113,197.76	2.36
100	603300	海南华铁	4,100,772.00	2.35
101	300987	川网传媒	4,070,218.00	2.33
102	688092	爱科科技	4,054,547.51	2.32
103	000600	建投能源	3,930,030.00	2.25

104	688517	金冠电气	3,913,840.33	2.24
105	300645	正元智慧	3,886,457.00	2.23
106	300236	上海新阳	3,881,297.00	2.22
107	601899	紫金矿业	3,835,601.00	2.20
108	688239	航宇科技	3,816,944.99	2.19
109	002616	长青集团	3,744,017.00	2.15
110	601609	金田股份	3,710,087.00	2.13
111	600455	博通股份	3,666,555.00	2.10
112	605088	冠盛股份	3,604,775.00	2.07
113	301160	翔楼新材	3,577,695.85	2.05
114	605577	龙版传媒	3,576,957.00	2.05
115	603890	春秋电子	3,571,841.00	2.05
116	002671	龙泉股份	3,566,872.00	2.04

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

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,217,894,465.91
卖出股票收入（成交）总额	1,126,207,613.41

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

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	15,444,557.88	5.69
2	央行票据	-	-

3	金融债券	410,018.30	0.15
	其中：政策性金融债	410,018.30	0.15
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	15,854,576.18	5.84

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	019827	26国债01	53,000	5,334,354.16	1.96
2	019792	25国债19	50,000	5,052,461.64	1.86
3	102310	国债2513	19,000	1,923,988.41	0.71
4	019755	24国债19	15,000	1,516,528.77	0.56
5	019785	25国债13	9,000	911,362.93	0.34

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期内未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	152,612.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	152,612.36

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情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
东兴未来 价值混合A	3,287	17,784.31	2,060,305.52	3.52%	56,396,706.57	96.48%
东兴未来 价值混合C	6,014	16,917.19	52,482,628.08	51.59%	49,257,325.31	48.41%
合计	9,301	17,223.63	54,542,933.60	34.05%	105,654,031.88	65.95%

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	42.95%

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	东兴未来价值混合A	34,789.12	0.06%
	东兴未来价值混合C	781,695.33	0.77%
	合计	816,484.45	0.51%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	东兴未来价值混合A	0~10
	东兴未来价值混合C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本 开放式基金	东兴未来价值混合A	0~10
	东兴未来价值混合C	10~50
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴未来价值混合A	东兴未来价值混合C
基金合同生效日(2019年07月26	200,090,407.68	10,000,675.00

日)基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	51,505,846.66	59,676,011.79
本报告期基金总申购份额	66,414,230.37	141,287,920.46
减：本报告期基金总赎回份额	59,463,064.94	99,223,978.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	58,457,012.09	101,739,953.39

§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。

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。

报告期内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，无涉及基金管理人、基金财产、本基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

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，本基金管理人高级管理人员、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

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中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

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中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	
国新证券股份有限公司	2	529,674,849.71	22.60%	258,674.47	22.23%	-
华宝证券股份有限公司	2	1,498,724,287.56	63.94%	749,376.08	64.39%	-
东兴证券股份有限公司	4	315,702,942.05	13.47%	155,835.56	13.39%	-

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

2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究等服务实力较强的证券公司参与证券交易。其中财务状况良好、经营行为规范指最近一年证券公司分类评级在C类或C类以上；合规风控能力是指证券公司近三年无重大违法违规行为、无正在接受立案调查，或受到监管机构严重处罚，责令改正逾期未改，影响正常经营等情形；交易、研究实力较强以公司交易部门、投资部门、研究部及投研分管领导的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定。在满足证券公司选择标准的前提下，公司应当与提供证券交易服务的证券公司签订委托协议，约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。证券公司的选择由研究部发起，由合规法律部对选择标准、选择程序是否符合法规及本制度规定进行初步合规审查后，报督察长进行合规性审查和总经理审批，公司与其建立合作关系并签署委托协议。

3、本基金本报告期内新增租用2个交易单元，分别为国新证券股份有限公司上海交易所交易单元及深圳交易所交易单元。

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
国新证券股份有限公司	6,811,310.00	43.37%	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	8,894,347.00	56.63%	-	-	-	-	-	-

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	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2025年第4季度报告	指定网站	2026-01-22
2	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年第四季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-01-22
3	东兴基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-03-11
4	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2025年年度报告	指定网站	2026-03-31
5	东兴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）	指定网站	2026-03-31
6	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年年度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-03-31
7	关于调整东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金首笔申购的最低金额、每笔追加申购的最低金额、每笔转换转入的最低金额及每笔定期定额	指定报刊、指定网站	2026-04-10
8	东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金2026年第1季度报告	指定网站	2026-04-22
9	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2026年第一季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2026-04-22
10	2025年度东兴基金管理有限公司	指定网站	2026-04-30

	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		
--	---------------------------------	--	--

§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

本基金本报告期内无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、中国证监会核准东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- 二、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 三、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 四、《东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 五、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

12.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.dxamc.cn）查阅。

东兴基金管理有限公司
二〇二六年八月二十八日