

汇泉策略优选混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:汇泉基金管理有限公司

基金托管人:中国光大银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	57
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	57
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	57
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	57
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.11 投资组合报告附注	58
§ 8 基金份额持有人信息	58

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 盈利投资者数量占比	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
§ 9 开放式基金份额变动.....	60
§ 10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	60
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.....	61
10.8 其他重大事件	62
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇泉策略优选混合型证券投资基金	
基金简称	汇泉策略优选混合	
基金主代码	012412	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 07 月 20 日	
基金管理人	汇泉基金管理有限公司	
基金托管人	中国光大银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,093,426,019.45 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇泉策略优选混合 A	汇泉策略优选混合 C
下属分级基金的交易代码	012412	013939
报告期末下属分级基金的份 额总额	1,089,850,716.60 份	3,575,302.85 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置和投资管理，追求超越基金业绩比较基准的投资回报和基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的投资策略主要包括： 1、大类资产配置策略；2、股票投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、参与融资业务的投资策略
业绩比较基准	中证 800 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*20%+中债综合全价（总值）指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇泉基金管理有限公司	中国光大银行股份有限公司
信息披露负 责人	姓名	张强	王茵
	联系电话	010-81925261	010-63639180
	电子邮箱	zhangqiang@springsfund.com	wangyin@cebbank.com
客户服务电话		400-001-5252、010-81925252	95595

传真	010-81925299	010-63639132
注册地址	北京市通州区贡院街 1 号院 1 号楼二层 206-40 室	北京市西城区太平桥大街 25 号、甲 25 号中国光大中心
办公地址	北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层	北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心
邮政编码	100044	100033
法定代表人	孟朝霞	吴利军

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	汇泉策略优选混合 A	汇泉策略优选混合 C
本期已实现收益	139,705,703.21	316,390.29
本期利润	184,338,445.36	389,200.87
加权平均基金份额本期利润	0.1540	0.1673
本期加权平均净值利润率	24.16%	26.85%
本期基金份额净值增长率	26.66%	26.28%
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	-339,294,533.65	-1,197,416.06
期末可供分配基金份额利润	-0.3113	-0.3349
期末基金资产净值	834,631,741.21	2,662,603.19
期末基金份额净值	0.7658	0.7447
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	-23.42%	-25.07%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除

相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

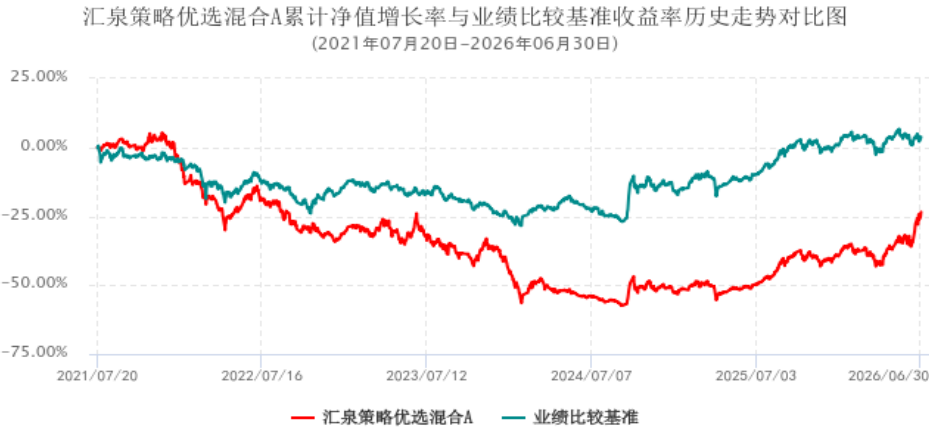
汇泉策略优选混合 A

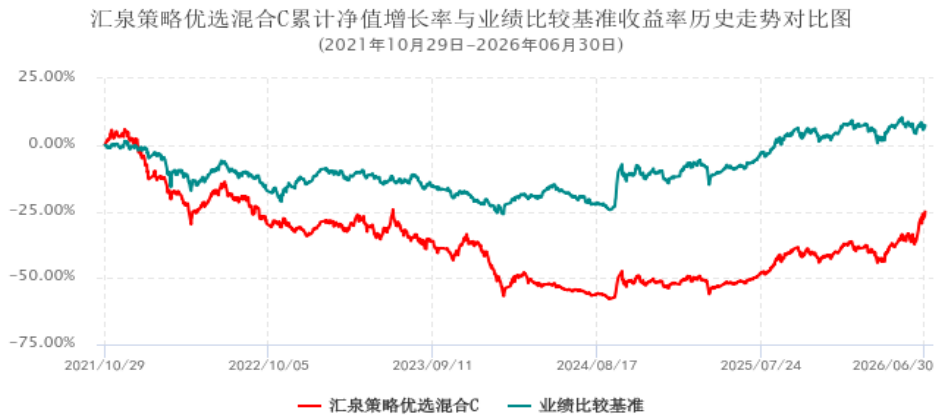
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	33.53%	1.82%	5.65%	0.89%	27.88%	0.93%
过去六个月	26.66%	1.63%	3.15%	0.86%	23.51%	0.77%
过去一年	52.40%	1.35%	15.45%	0.77%	36.95%	0.58%
过去三年	7.21%	1.35%	24.34%	0.84%	-17.13%	0.51%
自基金合同生 效起至今	-23.42%	1.27%	3.81%	0.84%	-27.23%	0.43%

汇泉策略优选混合 C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	33.34%	1.81%	5.65%	0.89%	27.69%	0.92%
过去六个月	26.28%	1.62%	3.15%	0.86%	23.13%	0.76%
过去一年	51.48%	1.35%	15.45%	0.77%	36.03%	0.58%
过去三年	5.29%	1.35%	24.34%	0.84%	-19.05%	0.51%
自 2021 年 10 月 29 日起至 今	-25.07%	1.30%	7.39%	0.84%	-32.46%	0.46%

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





注：本基金自 2021 年 10 月 29 日起增设 C 类基金份额。汇泉策略优选混合 C 基金份额的首次确认日为 2021 年 11 月 1 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇泉基金管理有限公司（以下简称“我公司”）经中国证券监督管理委员会证监许可【2020】1028 号文批准，于 2020 年 6 月 15 日在北京市注册成立，注册资本 10468 万元人民币。并于 2020 年 12 月 21 日取得中国证券监督管理委员会核发的《经营证券期货业务许可证》。我公司目前股东及其出资比例为：杨宇先生 52.83%，梁永强先生 29.61%，孟朝霞女士 2.01%，柴功先生 1.51%，北京溪泉企业管理中心（有限合伙）4.68%，上海澹泉企业管理中心（有限合伙）4.68%，上海沛泉企业管理中心（有限合伙）4.68%。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职	离任日		

		日期	期		
梁永强	本基金的基金经理、投资经理	2021-07-20	-	23 年	中国国籍，博士研究生，具有基金从业资格。曾任华商基金管理有限公司投资管理部副总经理、量化投资部总经理、公司副总经理、公司总经理，曾任汇泉基金管理有限公司总经理、基金经理、投资经理。现任汇泉基金管理有限公司基金经理兼任投资经理。
沈鑫	本基金的基金经理、量化投资部总监	2024-12-27	-	10 年	中国国籍，博士研究生，具有基金从业资格。曾任华西证券股份有限公司固定收益研究员、中国国际期货有限公司权益研究员、大家资产管理有限公司量化研究员、汇泉基金管理有限公司量化研究员。现任汇泉基金管理有限公司量化投资部总监、基金经理。

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

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

3、本基金的基金经理梁永强于 2026 年 7 月 3 日离任。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
梁永强	公募基金	1	837,294,344.40	2021-07-20
	私募资产管理计划	1	33,479,302.77	2022-07-27
	其他组合	-	-	-
	合计	2	870,773,647.17	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，PMI 在荣枯线上下波动；CPI 同比为正，PPI 同比转正；离岸人民币升值 2.64%。海外方面，地区冲突不断，影响能源及贵金属价格。

上半年，沪深 300 上涨 7.55%，中证 500 上涨 20.97%，中证 1000 上涨 15.99%，中证 2000 上涨 9.10%，中盘股优于其他；国证成长上涨 19.18%，国证价值下跌 8.40%，成长股优于价值股。从行业来看，中信一级行业中，电子、通信、建材、基础化工、机械、电力设备及新能源、煤炭、有色金属、电力及公用事业、计算机表现较好，消费者服务、综合金融、综合、农林牧渔、商贸零售、传媒、食品饮料、汽车、钢铁、房地产表现较弱。

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

报告期间，产品坚持定性、定量相结合的方式进行投资决策。定性方面，优选个股，找寻定量投资不擅长的投资领域。定量方面，以偏股混合基金行业配置水平为中枢，根据行业配置模型，采取有限偏离，严格控制行业错配风险；在个股选择层面，通过多因子模型进行股票优选；在组合优化层面，根据风险偏好，在控制风险暴露的前提下，寻求超额收益与风险之间的最优化平衡。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末汇泉策略优选混合 A 基金份额净值为 0.7658 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 26.66%，同期业绩比较基准收益率为 3.15%；截至报告期末汇泉策略优选混合 C 基金份

额净值为 0.7447 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 26.28%，同期业绩比较基准收益率为 3.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

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

本报告期内，本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额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合规守信情况声明

本报告期内，中国光大银行股份有限公司在汇泉策略优选混合型证券投资基金（以下称“本基金”）托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，依法安全保管了基金的全部资产，对本基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，对发现的问题及时提出了意见和建议。同时，按规定如实、独立地向监管机构提交了本基金运作情况报告，没有发生任何损害基金份额持有人利益的行为，诚实信用、勤勉尽责地履行了作为基金托管人所应尽的义务。

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

本报告期内，中国光大银行股份有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他法律法规、基金合同、托管协议等的规定，对基金管理人的投资运作等行为进行了复核、监督，未发现基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配等方面存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金在运作中遵守了有关法律法规的要求，各重要方面的运作严格依据基金合同的约定进行。

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

中国光大银行股份有限公司以自身能够获取的数据和信息为限，根据法律法规规定、基金合同和托管协议约定对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进行了复核，认为以上内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：汇泉策略优选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	61,819,300.78	51,625,755.84
结算备付金		5,803,853.13	5,798,831.27
存出保证金		—	—

交易性金融资产	6.4.7.2	771,512,328.04	742,114,935.11
其中：股票投资		740,345,118.02	732,081,310.45
基金投资		-	-
债券投资		31,167,210.02	10,033,624.66
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		222,861.92	-
应收申购款		1,423,793.65	11,298.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		840,782,137.52	799,550,821.02
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		2,494,162.14	1,762,505.40
应付管理人报酬		756,214.83	809,725.98
应付托管费		126,035.79	134,954.31
应付销售服务费		781.32	801.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,921.48	386.06
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	108,677.56	211,311.80
负债合计		3,487,793.12	2,919,685.52
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,093,426,019.45	1,317,587,041.02
未分配利润	6.4.7.8	-256,131,675.05	-520,955,905.52
净资产合计		837,294,344.40	796,631,135.50
负债和净资产总计		840,782,137.52	799,550,821.02

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 1,093,426,019.45 份。其中汇泉策略优选混合 A 基金份额净值 0.7658 元，基金份额总额 1,089,850,716.60 份；汇泉策略优选混合 C 基金份额净值 0.7447 元，基金份额总额 3,575,302.85 份。

6.2 利润表

会计主体：汇泉策略优选混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		190,156,624.89	31,495,772.31
1. 利息收入		85,979.70	171,968.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	85,979.70	171,968.09
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）		145,354,370.03	6,799,408.98
其中：股票投资收益	6.4.7.10	141,673,494.50	-1,171,557.77
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.11	37,171.87	87,929.72
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.13	—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	-1,142,786.69
股利收益	6.4.7.15	3,643,703.66	9,025,823.72
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	44,705,552.73	24,515,920.92
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	10,722.43	8,474.32
减：二、营业总支出		5,428,978.66	5,803,374.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,548,980.68	4,867,039.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	758,163.41	811,173.22
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	4,304.16	6,637.83
4. 投资顾问费		—	—
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 信用减值损失		—	—
7. 税金及附加		1,222.39	1,638.92
8. 其他费用	6.4.7.18	116,308.02	116,885.57
三、利润总额（亏损总额以		184,727,646.23	25,692,397.42

“-”号填列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		184,727,646.23	25,692,397.42
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		184,727,646.23	25,692,397.42

6.3 净资产变动表

会计主体：汇泉策略优选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	1,317,587,041.02	-520,955,905.52	796,631,135.50
二、本期期初净资产	1,317,587,041.02	-520,955,905.52	796,631,135.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-224,161,021.57	264,824,230.47	40,663,208.90
（一）、综合收益总额	-	184,727,646.23	184,727,646.23
（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）	-224,161,021.57	80,096,584.24	-144,064,437.33
其中：1. 基金申购款	13,377,076.23	-4,364,210.32	9,012,865.91
2. 基金赎回款	-237,538,097.80	84,460,794.56	-153,077,303.24
（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	1,093,426,019.45	-256,131,675.05	837,294,344.40
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	1,750,068,713.42	-898,062,961.01	852,005,752.41
二、本期期初净资产	1,750,068,713.42	-898,062,961.01	852,005,752.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-165,481,866.52	109,654,832.25	-55,827,034.27
（一）、综合收益总额	-	25,692,397.42	25,692,397.42
（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）	-165,481,866.52	83,962,434.83	-81,519,431.69
其中：1. 基金申购款	7,525,040.27	-3,852,590.74	3,672,449.53
2. 基金赎回款	-173,006,906.79	87,815,025.57	-85,191,881.22
（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	1,584,586,846.90	-788,408,128.76	796,178,718.14

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

梁永强	陈磊	陈磊
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

汇泉策略优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]1548号《关于准予汇泉策略优选混合型证券投资基金注册的批复》注册,由汇泉基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉策略优选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,576,717,651.17元,业经亚太(集团)会计师事务所(特殊普通合伙)亚会验字(2021)第03110262验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《汇泉策略优选混合型证券投资基金基金合同》于2021年7月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,577,092,358.81份基金份额,其中认购资金利息折合374,707.64份基金份额。本基金的基金管理人为汇泉基金管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人汇泉基金管理有限公司于2021年10月29日发布的《汇泉基金管理有限公司关于汇泉策略优选混合型证券投资基金增加基金份额类别并修改基金合同和托管协议的公告》以及更新后的《汇泉策略优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,自2021年10月29日起,本基金增设C类基金份额。本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购时收取申购费用、并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《汇泉策略优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、港股通标的股票(包括沪港通股票及深港通股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范

围。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的资产占股票资产的 0%-50%）。每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率 $\times$ 55%+中证港股通综合指数(人民币)收益率 $\times$ 20%+中债综合全价(总值)指数收益率 $\times$ 25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》《证券投资基金会计核算业务指引》、本基金基金合同和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年度中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通

知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号《财政部、国家税务总局、证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]127号《财政部、国家税务总局、证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2017]56号《财政部、税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《财政部、税务总局关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部 税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适

用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	1,124,110.48
等于：本金	1,123,672.85
加：应计利息	437.63
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	60,695,190.30
等于：本金	60,690,188.41
加：应计利息	5,001.89
减：坏账准备	-
合计	61,819,300.78

注：其他存款为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	632,988,986.15	-	740,345,118.02	107,356,131.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	1,014,212.19	26,652.76	1,036,852.76
	银行间市场	29,959,317.25	144,357.26	30,130,357.26
	合计	30,973,529.44	171,010.02	31,167,210.02
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	663,962,515.59	171,010.02	771,512,328.04	107,378,802.43

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

价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	71.36
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	918.75
其中：交易所市场	-
银行间市场	918.75
应付利息	-
预提费用	103,519.55
其他应付	4,167.90
合计	108,677.56

6.4.7.7 实收基金

汇泉策略优选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,314,932,588.99	1,314,932,588.99
本期申购	11,337,291.70	11,337,291.70

本期赎回（以“-”号填列）	-236,419,164.09	-236,419,164.09
本期末	1,089,850,716.60	1,089,850,716.60

汇泉策略优选混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,654,452.03	2,654,452.03
本期申购	2,039,784.53	2,039,784.53
本期赎回（以“-”号填列）	-1,118,933.71	-1,118,933.71
本期末	3,575,302.85	3,575,302.85

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

汇泉策略优选混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-566,930,032.97	47,063,202.64	-519,866,830.33
本期期初	-566,930,032.97	47,063,202.64	-519,866,830.33
本期利润	139,705,703.21	44,632,742.15	184,338,445.36
本期基金份额交易产生的变动数	87,929,796.11	-7,620,386.53	80,309,409.58
其中：基金申购款	-4,267,097.75	520,846.42	-3,746,251.33
基金赎回款	92,196,893.86	-8,141,232.95	84,055,660.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-339,294,533.65	84,075,558.26	-255,218,975.39

汇泉策略优选混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,193,773.75	104,698.56	-1,089,075.19
本期期初	-1,193,773.75	104,698.56	-1,089,075.19
本期利润	316,390.29	72,810.58	389,200.87
本期基金份额交易产生的变动数	-320,032.60	107,207.26	-212,825.34
其中：基金申购款	-775,245.24	157,286.25	-617,958.99
基金赎回款	455,212.64	-50,078.99	405,133.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,197,416.06	284,716.40	-912,699.66

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	1,824.16
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	79,133.68
结算备付金利息收入	5,021.86
其他	—
合计	85,979.70

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

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,870,771,481.98
减：卖出股票成本总额	1,726,347,031.30
减：交易费用	2,750,956.18
买卖股票差价收入	141,673,494.50

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	339,551.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-302,379.77
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	37,171.87

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	40,099,655.53
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	40,078,265.89
减：应计利息总额	322,305.25
减：交易费用	1,464.16
买卖债券差价收入	-302,379.77

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	3,643,703.66
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	3,643,703.66

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	44,705,552.73
——股票投资	44,703,684.91
——债券投资	1,867.82
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	44,705,552.73

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	10,691.47
转换费收入	30.96
合计	10,722.43

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

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
账户维护费	18,600.00
证券组合费	3,299.29
存托服务费	189.18
合计	116,308.02

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

关联方名称	与本基金的关系
汇泉基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国光大银行股份有限公司(“光大银行”)	基金托管人、基金销售机构
杨宇	基金管理人股东
梁永强	基金管理人股东
孟朝霞	基金管理人股东
柴功	基金管理人股东
上海沛泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
上海澹泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东
北京溪泉企业管理中心(有限合伙)	基金管理人股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,548,980.68	4,867,039.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,239,917.70	2,401,044.51
应支付基金管理人的净管理费	2,309,062.98	2,465,994.84

注：支付基金管理人汇泉基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
----	---	--

当期发生的基金应支付的托管费	758,163.41	811,173.22
----------------	------------	------------

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

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇泉策略优选混合 A	汇泉策略优选混合 C	合计
汇泉基金管理有限公司	-	487.56	487.56
光大银行	-	0	0
合计	-	487.56	487.56
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇泉策略优选混合 A	汇泉策略优选混合 C	合计
汇泉基金管理有限公司	-	489.00	489.00
光大银行	-	0	0
合计	-	489.00	489.00

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

汇泉策略优选混合 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的基金份 额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
杨宇	2,540,235.31	0.23%	2,540,235.31	0.19%
梁永强	1,012,091.77	0.09%	1,012,091.77	0.08%

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金招募说明书的规定费率执行。

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
光大银行	1,124,110.48	1,824.16	7,403,200.16	44,746.40

注：本基金的银行存款由基金托管人光大银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代 码	证券 名称	成功 认购 日	受限期	流通 受限 类型	认购价 格	期末估 值单价	数量 (单 位： 股)	期末成本 总额	期末估值总 额	备 注
001399	惠科 股份	2026 年	6 个月	股票 流通	10.12	27.73	4,282	43,333.84	118,739.86	-

		06 月 16 日		受限						
688785	恒运 昌	2026 年 01 月 20 日	6 个月	科创板新 股限售	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
001365	天海 电子	2026 年 05 月 11 日	6 个月	股票流 通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
301696	三瑞 智能	2026 年 03 月 31 日	6 个月	创业 板新 股限售	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康 科技	2026 年 05 月 15 日	6 个月	股票流 通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301687	新广 益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	创业 板新 股限售	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
601112	振石 股份	2026 年 01 月 21 日	6 个月	股票流 通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-
688781	视涯 科技	2026 年 03 月	6 个月	科创板新 股限售	22.68	47.61	217	4,921.56	10,331.37	-

		18 日								
301513	尚水智能	2026 年 04 月 10 日	6 个月	创业板新股限售	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
603435	嘉德利	2026 年 05 月 15 日	6 个月	股票流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026 年 01 月 08 日	6 个月	股票流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026 年 04 月 09 日	6 个月	股票流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
118071	华峰转债	2026 年 06 月 23 日	-	新债未上市	100.00	100.00	280	28,000.00	28,000.49	-
127114	宜化转债	2026 年 06 月 26 日	1 个月 内 (含)	新债未上市	100.00	100.00	100	10,000.00	10,000.22	-

注：本基金参与网下申购获得的新股，在新股上市之前及上市之后的约定期限(若有)内不得转

让；本基金参与网上申购获得的新股，在新股上市之前不得转让。此外，根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

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
688072	拓荆科技	2026-06-29	-	879.53	2026-07-13	890.99	19,166	8,921,580.84	16,857,071.98	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理

人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导合规风控工作。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按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	19,966,981.92	-
AAA 以下	10,201,376.05	10,033,624.66
未评级	998,852.05	-
合计	31,167,210.02	10,033,624.66

注：未评级债券包含剩余期限大于一年的未有第三方机构评级的企业发行的债券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	61,819,300.78	-	-	-	61,819,300.78
结算备付金	5,803,853.13	-	-	-	5,803,853.13
交易性金融资产	-	31,129,209.31	38,000.71	740,345,118.02	771,512,328.04
应收股利	-	-	-	222,861.92	222,861.92
应收申购款	-	-	-	1,423,793.65	1,423,793.65
资产总计	67,623,153.91	31,129,209.31	38,000.71	741,991,773.59	840,782,137.52
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,494,162.14	2,494,162.14
应付管理人报酬	-	-	-	756,214.83	756,214.83
应付托管费	-	-	-	126,035.79	126,035.79
应付销售服务费	-	-	-	781.32	781.32
应交税费	-	-	-	1,921.48	1,921.48

其他负债	-	-	-	108,677.56	108,677.56
负债总计	-	-	-	3,487,793.12	3,487,793.12
利率敏感度缺口	67,623,153.91	31,129,209.31	38,000.71	738,503,980.47	837,294,344.40
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	51,625,755.84	-	-	-	51,625,755.84
结算备付金	5,798,831.27	-	-	-	5,798,831.27
交易性金融资产	-	10,033,624.66	-	732,081,310.45	742,114,935.11
应收申购款	-	-	-	11,298.80	11,298.80
资产总计	57,424,587.11	10,033,624.66	-	732,092,609.25	799,550,821.02
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,762,505.40	1,762,505.40
应付管理人报酬	-	-	-	809,725.98	809,725.98
应付托管费	-	-	-	134,954.31	134,954.31
应付销售服务费	-	-	-	801.97	801.97
应交税费	-	-	-	386.06	386.06
其他负债	-	-	-	211,311.80	211,311.80
负债总计	-	-	-	2,919,685.52	2,919,685.52
利率敏感度缺口	57,424,587.11	10,033,624.66	-	729,172,923.73	796,631,135.50

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金净资产的比例为 3.72%(2025 年 12 月 31 日：1.26%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	54,529,491.97	-	54,529,491.97
应收股利	-	222,861.92	-	222,861.92
资产合计	-	54,752,353.89	-	54,752,353.89
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	54,752,353.89	-	54,752,353.89
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	96,813,639.04	-	96,813,639.04
资产合计	-	96,813,639.04	-	96,813,639.04
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	96,813,639.04	-	96,813,639.04

6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 所有外币相对人民币升值 5%	-	4,840,681.95
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-	-4,840,681.95

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	740,345,118.02	88.42	732,081,310.45	91.90
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	740,345,118.02	88.42	732,081,310.45	91.90

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证 800 指数收益率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	1. 中证 800 指数收益率上升 5%	51,827,747.18	41,968,736.20
	2. 中证 800 指数收益率下降 5%	-51,827,747.18	-41,968,736.20

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	723,201,256.95	729,650,608.52
第二层次	48,024,282.00	12,103,569.46
第三层次	286,789.09	360,757.13
合计	771,512,328.04	742,114,935.11

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	740,345,118.02	88.05
	其中：股票	740,345,118.02	88.05

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,167,210.02	3.71
	其中：债券	31,167,210.02	3.71
	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	67,623,153.91	8.04
8	其他各项资产	1,646,655.57	0.20
9	合计	840,782,137.52	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 54,529,491.97 元，占净值比例 6.51%。

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	965,136.00	0.12
B	采矿业	21,231,898.00	2.54
C	制造业	580,401,697.37	69.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,366,006.00	0.28
E	建筑业	1,901,101.00	0.23
F	批发和零售业	6,817,509.40	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	5,550,507.00	0.66
H	住宿和餐饮业	326,628.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,083,504.28	3.71
J	金融业	18,546,481.00	2.22
K	房地产业	994,730.00	0.12
L	租赁和商务服务业	2,711,867.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	10,378,356.00	1.24
N	水利、环境和公共设施管理业	737,229.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	247,110.00	0.03
Q	卫生和社会工作	958,005.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	588,995.00	0.07
S	综合	8,866.00	0.00
	合计	685,815,626.05	81.91

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
原材料	8,137,119.24	0.97
非日常生活消费品	11,981,894.79	1.43
能源	1,464,861.69	0.17
金融	7,520,088.30	0.90
医疗保健	1,712,954.31	0.20
信息技术	6,117,760.47	0.73
通讯业务	17,594,813.17	2.10
合计	54,529,491.97	6.51

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	28,000	35,560,000.00	4.25
2	688498	源杰科技	13,881	26,179,566.00	3.13
3	002384	东山精密	97,600	25,605,360.00	3.06
4	300502	新易盛	39,320	23,867,240.00	2.85
5	603986	兆易创新	24,500	19,967,500.00	2.38
6	688072	拓荆科技	19,166	16,857,071.98	2.01
7	688012	中微公司	32,073	15,026,200.50	1.79
8	688120	华海清科	41,960	13,518,672.80	1.61
9	688525	佰维存储	26,800	13,258,764.00	1.58
10	688256	寒武纪	7,522	12,001,727.10	1.43
11	00700	腾讯控股	31,800	11,871,028.72	1.42
12	688361	中科飞测	27,400	11,782,000.00	1.41
13	688008	澜起科技	34,400	10,660,560.00	1.27
14	688981	中芯国际	40,915	6,498,120.30	0.78
14	00981	中芯国际	51,000	3,960,066.87	0.47
15	301308	江波龙	14,100	9,923,580.00	1.19
16	300394	天孚通信	32,660	9,885,528.80	1.18
17	601899	紫金矿业	237,900	5,980,806.00	0.71
17	02899	紫金矿业	152,000	3,617,337.04	0.43
18	300750	宁德时代	23,400	9,196,434.00	1.10
19	688037	芯源微	19,600	8,605,380.00	1.03
20	600487	亨通光电	67,300	7,358,582.00	0.88
21	002916	深南电路	16,000	7,326,400.00	0.88
22	600183	生益科技	38,900	6,745,260.00	0.81
23	603259	药明康德	48,400	6,026,284.00	0.72
24	002281	光迅科技	23,200	5,961,008.00	0.71
25	301377	鼎泰高科	9,900	5,453,910.00	0.65

26	002463	沪电股份	35,605	5,440,444.00	0.65
27	09992	泡泡玛特	40,000	5,374,587.40	0.64
28	300604	长川科技	15,500	5,292,010.00	0.63
29	600519	贵州茅台	4,400	5,216,156.00	0.62
30	600522	中天科技	82,600	5,012,168.00	0.60
31	001309	德明利	5,100	4,808,790.00	0.57
32	300476	胜宏科技	13,200	4,572,876.00	0.55
33	01818	招金矿业	317,500	4,519,782.20	0.54
34	300475	香农芯创	14,200	4,260,000.00	0.51
35	002080	中材科技	46,200	4,158,000.00	0.50
36	03690	美团-W	68,900	4,099,252.01	0.49
37	688019	安集科技	11,940	4,053,152.40	0.48
38	00388	香港交易所	12,700	4,004,102.36	0.48
39	688025	杰普特	8,200	3,854,000.00	0.46
40	688002	睿创微纳	24,800	3,836,312.00	0.46
41	01024	快手-W	105,400	3,808,279.07	0.45
42	605117	德业股份	34,720	3,686,569.60	0.44
43	688652	京仪装备	17,600	3,522,992.00	0.42
44	02611	国泰海通	272,600	3,515,985.94	0.42
45	688266	泽璟制药	30,000	3,499,800.00	0.42
46	002738	中矿资源	57,600	3,397,824.00	0.41
47	688372	伟测科技	17,375	3,231,750.00	0.39
48	002484	江海股份	30,700	3,223,500.00	0.38
49	688301	奕瑞科技	25,640	3,179,360.00	0.38
50	601601	中国太保	111,000	3,165,720.00	0.38
51	002709	天赐材料	60,900	3,132,087.00	0.37
52	601138	工业富联	42,600	3,073,590.00	0.37
53	601231	环旭电子	93,900	3,042,360.00	0.36
54	300277	汽轮科技	197,800	2,974,912.00	0.36
55	002001	新和成	104,300	2,964,206.00	0.35
56	600938	中国海油	55,200	1,498,680.00	0.18
56	00883	中国海洋石油	83,000	1,464,861.69	0.17
57	000933	神火股份	139,400	2,955,280.00	0.35
58	002371	北方华创	3,340	2,954,430.40	0.35
59	300438	鹏辉能源	35,400	2,932,890.00	0.35
60	603659	璞泰来	100,400	2,904,572.00	0.35
61	688531	日联科技	16,200	2,881,008.00	0.34
62	688388	嘉元科技	65,450	2,879,800.00	0.34
63	301358	湖南裕能	37,800	2,867,886.00	0.34
64	300661	圣邦股份	19,800	2,840,904.00	0.34
65	300395	菲利华	21,100	2,821,703.00	0.34
66	688183	生益电子	21,200	2,806,880.00	0.34
67	688578	艾力斯	25,200	2,751,840.00	0.33

68	300274	阳光电源	17,200	2,735,144.00	0.33
69	000975	山金国际	160,300	2,725,100.00	0.33
70	600711	盛屯矿业	247,500	2,715,075.00	0.32
71	001267	汇绿生态	50,300	2,691,050.00	0.32
72	601169	北京银行	547,200	2,681,280.00	0.32
73	000651	格力电器	71,500	2,681,250.00	0.32
74	300432	富临精工	133,200	2,675,988.00	0.32
75	600809	山西汾酒	24,400	2,668,628.00	0.32
76	600660	福耀玻璃	52,800	2,663,232.00	0.32
77	601126	四方股份	42,100	2,660,720.00	0.32
78	603606	东方电缆	63,500	2,635,885.00	0.31
79	688234	天岳先进	15,000	2,602,650.00	0.31
80	603699	纽威股份	50,400	2,535,120.00	0.30
81	688041	海光信息	6,800	2,518,040.00	0.30
82	09988	阿里巴巴-W	31,100	2,508,055.38	0.30
83	603256	宏和科技	9,400	2,494,102.00	0.30
84	601377	兴业证券	399,500	2,412,980.00	0.29
85	300567	精测电子	7,500	2,382,000.00	0.28
86	002475	立讯精密	33,600	2,365,440.00	0.28
87	000408	藏格矿业	34,000	2,356,880.00	0.28
88	601166	兴业银行	141,300	2,339,928.00	0.28
89	688192	迪哲医药	57,800	2,307,954.00	0.28
90	002353	杰瑞股份	15,100	2,302,750.00	0.28
91	600549	厦门钨业	26,000	2,215,200.00	0.26
92	688052	纳芯微	7,600	2,191,156.00	0.26
93	000100	TCL 科技	349,500	2,034,090.00	0.24
94	300757	罗博特科	3,200	1,980,800.00	0.24
95	688205	德科立	9,400	1,956,986.00	0.23
96	00941	中国移动	19,000	1,256,661.57	0.15
96	600941	中国移动	7,000	602,910.00	0.07
97	002126	银轮股份	35,100	1,747,980.00	0.21
98	000338	潍柴动力	63,500	1,730,375.00	0.21
99	02269	药明生物	57,000	1,712,954.31	0.20
100	000425	徐工机械	206,500	1,670,585.00	0.20
101	600690	海尔智家	78,200	1,596,062.00	0.19
102	002028	思源电气	9,100	1,574,300.00	0.19
103	002602	世纪华通	105,100	1,481,910.00	0.18
104	600309	万华化学	21,500	1,470,815.00	0.18
105	300953	震裕科技	11,000	1,470,700.00	0.18
106	002670	国盛证券	133,300	1,466,300.00	0.18
107	000333	美的集团	17,900	1,351,987.00	0.16
108	02382	舜宇光学科技	25,400	1,345,731.37	0.16
109	301345	涛涛车业	5,800	1,339,800.00	0.16

110	600276	恒瑞医药	25,400	1,321,816.00	0.16
111	000426	兴业银锡	39,800	1,311,808.00	0.16
112	688279	峰岬科技	5,600	1,256,864.00	0.15
113	601872	招商轮船	68,000	1,194,760.00	0.14
114	000703	恒逸石化	85,900	1,165,663.00	0.14
115	002025	航天电器	15,000	1,143,300.00	0.14
116	688257	新锐股份	11,160	1,137,204.00	0.14
117	688486	龙迅股份	17,600	1,119,008.00	0.13
118	603929	亚翔集成	4,100	1,115,282.00	0.13
119	000630	铜陵有色	170,400	1,083,744.00	0.13
120	002222	福晶科技	11,700	1,079,676.00	0.13
121	002379	宏桥控股	70,800	1,045,716.00	0.12
122	601898	中煤能源	84,900	1,034,082.00	0.12
123	603799	华友钴业	21,400	1,032,764.00	0.12
124	002444	巨星科技	33,100	1,029,410.00	0.12
125	300357	我武生物	44,100	1,028,412.00	0.12
126	601208	东材科技	14,500	1,026,455.00	0.12
127	688206	概伦电子	22,800	1,011,636.00	0.12
128	002414	高德红外	76,200	1,010,412.00	0.12
129	601939	建设银行	104,800	1,009,224.00	0.12
130	688503	聚和材料	7,600	1,008,520.00	0.12
131	600426	华鲁恒升	42,100	1,007,032.00	0.12
132	002311	海大集团	22,400	999,264.00	0.12
133	300408	三环集团	5,900	984,710.00	0.12
134	688472	阿特斯	89,600	969,472.00	0.12
135	688778	厦钨新能	17,800	968,320.00	0.12
136	688029	南微医学	13,400	962,120.00	0.11
137	002271	东方雨虹	80,800	959,096.00	0.11
138	688172	燕东微	11,400	953,724.00	0.11
139	000739	普洛药业	57,200	952,952.00	0.11
140	605060	联德股份	16,600	941,884.00	0.11
141	603993	洛阳钼业	53,400	937,170.00	0.11
142	002714	牧原股份	26,700	934,233.00	0.11
143	601869	长飞光纤	1,700	928,030.00	0.11
144	300850	新强联	34,600	927,280.00	0.11
145	301536	星辰科技	7,200	926,712.00	0.11
146	688239	航宇科技	15,400	921,382.00	0.11
147	688158	优刻得	24,800	911,648.00	0.11
148	688617	惠泰医疗	5,000	907,800.00	0.11
149	301031	中熔电气	7,588	906,386.60	0.11
150	688210	统联精密	22,200	899,322.00	0.11
151	000682	东方电子	71,100	897,993.00	0.11
152	300772	运达股份	72,000	885,600.00	0.11

153	603893	瑞芯微	4,700	885,292.00	0.11
154	002558	巨人网络	32,100	884,676.00	0.11
155	000783	长江证券	90,600	883,350.00	0.11
156	000811	冰轮环境	15,700	882,654.00	0.11
157	689009	九号公司	23,000	877,450.00	0.10
158	688678	福立旺	35,800	865,286.00	0.10
159	002487	大金重工	14,900	863,753.00	0.10
160	300015	爱尔眼科	104,500	863,170.00	0.10
161	000880	潍柴重机	37,500	862,875.00	0.10
162	300012	华测检测	62,100	860,706.00	0.10
163	603035	常熟汽饰	80,900	859,158.00	0.10
164	600029	南方航空	164,700	853,146.00	0.10
165	002409	雅克科技	3,800	853,100.00	0.10
166	688475	萤石网络	31,000	847,850.00	0.10
167	603998	方盛制药	93,400	843,402.00	0.10
168	300866	安克创新	8,000	836,000.00	0.10
169	002448	中原内配	67,700	832,710.00	0.10
170	002050	三花智控	18,900	828,387.00	0.10
171	600388	龙净环保	56,900	827,895.00	0.10
172	002284	亚太股份	86,900	824,681.00	0.10
173	600893	航发动力	21,400	820,476.00	0.10
174	600221	海航控股	607,400	819,990.00	0.10
175	688190	云路股份	9,000	816,390.00	0.10
176	01810	小米集团-W	43,200	811,962.23	0.10
177	300684	中石科技	13,300	811,300.00	0.10
178	603626	科森科技	43,600	806,600.00	0.10
179	603198	迎驾贡酒	27,100	802,160.00	0.10
180	600989	宝丰能源	39,200	796,936.00	0.10
181	002468	申通快递	54,600	794,976.00	0.09
182	688278	特宝生物	14,600	794,240.00	0.09
183	603530	神马电力	15,600	794,040.00	0.09
184	002594	比亚迪	9,900	789,030.00	0.09
185	688300	联瑞新材	3,200	782,080.00	0.09
186	603268	松发股份	5,400	752,112.00	0.09
187	300972	万辰集团	4,200	728,322.00	0.09
188	603296	华勤技术	9,700	720,419.00	0.09
189	002922	伊戈尔	21,900	718,320.00	0.09
190	002466	天齐锂业	11,700	717,444.00	0.09
191	002027	分众传媒	146,000	706,640.00	0.08
192	600185	珠免集团	152,400	685,800.00	0.08
193	600499	科达制造	49,200	678,960.00	0.08
194	000807	云铝股份	30,600	677,484.00	0.08
195	300814	中富电路	3,300	674,850.00	0.08

196	603100	川仪股份	36,800	664,240.00	0.08
197	002966	苏州银行	95,100	661,896.00	0.08
198	600066	宇通客车	24,600	659,526.00	0.08
199	600887	伊利股份	27,500	658,900.00	0.08
200	03888	金山软件	34,200	658,843.81	0.08
201	300693	盛弘股份	13,500	658,125.00	0.08
202	688208	道通科技	26,000	654,940.00	0.08
203	300699	光威复材	22,400	641,760.00	0.08
204	601077	渝农商行	102,500	626,275.00	0.07
205	002250	联化科技	45,500	621,985.00	0.07
206	300181	佐力药业	44,100	621,810.00	0.07
207	600961	株冶集团	19,100	618,649.00	0.07
208	688258	卓易信息	5,200	616,408.00	0.07
209	300389	艾比森	47,800	612,796.00	0.07
210	001203	大中矿业	20,100	601,995.00	0.07
211	600875	东方电气	20,800	598,416.00	0.07
212	601398	工商银行	84,300	596,001.00	0.07
213	002956	西麦食品	28,500	591,660.00	0.07
214	603816	顾家家居	25,900	579,124.00	0.07
215	002518	科士达	10,800	578,772.00	0.07
216	603345	安井食品	7,200	577,368.00	0.07
217	688220	翱捷科技	4,600	571,872.00	0.07
218	688127	蓝特光学	5,800	566,080.00	0.07
219	000762	西藏矿业	21,200	566,040.00	0.07
220	600141	兴发集团	11,900	558,943.00	0.07
221	300073	当升科技	11,500	552,460.00	0.07
222	000301	东方盛虹	48,200	551,890.00	0.07
223	002078	太阳纸业	43,800	547,062.00	0.07
224	300451	创业慧康	168,600	539,520.00	0.06
225	603444	吉比特	1,500	537,630.00	0.06
226	300153	科泰电源	23,700	536,094.00	0.06
227	600674	川投能源	37,600	532,792.00	0.06
228	600563	法拉电子	2,700	515,160.00	0.06
229	600301	华锡有色	8,400	515,088.00	0.06
230	688111	金山办公	2,400	511,320.00	0.06
231	603162	海通发展	56,800	509,496.00	0.06
232	002299	圣农发展	33,500	507,860.00	0.06
233	000738	航发控制	27,700	506,633.00	0.06
234	301606	绿联科技	8,300	506,466.00	0.06
235	688088	虹软科技	14,200	504,810.00	0.06
236	600801	华新建材	32,200	502,320.00	0.06
237	002324	普利特	41,200	497,284.00	0.06
238	600098	广州发展	84,000	496,440.00	0.06

239	601058	赛轮轮胎	42,800	493,484.00	0.06
240	000932	华菱钢铁	141,800	492,046.00	0.06
241	300033	同花顺	2,040	491,640.00	0.06
242	603663	三祥新材	5,100	491,130.00	0.06
243	002262	恩华药业	26,100	489,375.00	0.06
244	002415	海康威视	14,100	482,220.00	0.06
245	002074	国轩高科	17,400	478,674.00	0.06
246	600389	江山股份	24,400	476,288.00	0.06
247	688518	联赢激光	15,400	475,860.00	0.06
248	600259	中稀有色	4,600	467,406.00	0.06
249	601318	中国平安	9,700	463,078.00	0.06
250	002796	世嘉科技	11,300	460,814.00	0.06
251	300302	同有科技	9,000	460,530.00	0.06
252	603939	益丰药房	25,500	458,490.00	0.05
253	000729	燕京啤酒	45,000	455,850.00	0.05
254	601225	陕西煤业	22,400	455,840.00	0.05
255	688696	极米科技	6,600	425,964.00	0.05
256	002545	东方铁塔	26,100	423,342.00	0.05
257	002318	久立特材	17,400	415,860.00	0.05
258	002901	大博医疗	9,900	413,622.00	0.05
259	002478	常宝股份	66,600	411,588.00	0.05
260	002317	众生药业	16,700	410,319.00	0.05
261	601699	潞安环能	28,100	401,268.00	0.05
262	601991	大唐发电	56,600	400,728.00	0.05
263	603027	千禾味业	56,300	392,411.00	0.05
264	002716	湖南白银	48,500	392,365.00	0.05
265	600583	海油工程	77,300	388,819.00	0.05
266	688155	先惠技术	4,800	388,272.00	0.05
267	600019	宝钢股份	71,500	388,245.00	0.05
268	603297	永新光学	2,600	382,070.00	0.05
269	688615	合合信息	3,360	380,016.00	0.05
270	002008	大族激光	2,500	375,275.00	0.04
271	002396	星网锐捷	19,400	371,898.00	0.04
272	601888	中国中免	6,900	370,599.00	0.04
273	603871	嘉友国际	36,100	368,581.00	0.04
274	603156	养元饮品	7,500	368,025.00	0.04
275	601877	正泰电器	14,500	363,515.00	0.04
276	688392	骄成超声	1,600	363,488.00	0.04
277	300373	扬杰科技	2,300	361,629.00	0.04
278	688059	华锐精密	1,800	359,478.00	0.04
279	601155	新城控股	34,900	358,074.00	0.04
280	600298	安琪酵母	9,800	354,760.00	0.04
281	603061	金海通	700	351,554.00	0.04

282	001979	招商蛇口	54,300	349,149.00	0.04
283	002192	融捷股份	3,900	348,660.00	0.04
284	688488	艾迪药业	27,000	346,950.00	0.04
285	003031	中瓷电子	1,900	342,570.00	0.04
286	603067	振华股份	7,400	342,546.00	0.04
287	688169	石头科技	3,600	341,892.00	0.04
288	000973	佛塑科技	23,400	335,790.00	0.04
289	601319	中国人保	49,500	334,620.00	0.04
290	002138	顺络电子	4,500	328,950.00	0.04
291	600901	江苏金租	57,100	328,325.00	0.04
292	600153	建发股份	41,000	325,130.00	0.04
293	002683	广东宏大	11,100	325,119.00	0.04
294	300727	润禾材料	8,500	318,070.00	0.04
295	300681	英搏尔	11,000	314,820.00	0.04
296	688717	艾罗能源	3,800	313,766.00	0.04
297	601668	中国建筑	72,200	313,348.00	0.04
298	600496	精工钢构	100,200	310,620.00	0.04
299	002605	姚记科技	17,000	310,590.00	0.04
300	603999	读者传媒	61,900	309,500.00	0.04
301	300390	天华新能	3,300	308,583.00	0.04
302	002155	湖南黄金	12,900	307,923.00	0.04
303	603737	三棵树	12,700	306,070.00	0.04
304	603920	世运电路	6,300	302,652.00	0.04
305	300731	科创新源	5,100	297,636.00	0.04
306	002064	华峰化学	31,000	294,190.00	0.04
307	002345	潮宏基	32,000	293,440.00	0.04
308	600418	江淮汽车	11,000	284,130.00	0.03
309	605016	百龙创园	10,700	276,595.00	0.03
310	003010	若羽臣	11,300	274,590.00	0.03
311	688569	铁科轨道	17,000	274,550.00	0.03
312	688499	利元亨	5,200	273,260.00	0.03
313	603379	三美股份	3,600	273,204.00	0.03
314	600262	北方股份	13,800	273,102.00	0.03
315	600930	华电新能	57,000	271,890.00	0.03
316	600595	中孚实业	47,900	269,198.00	0.03
317	688347	华虹宏力	800	269,040.00	0.03
318	002831	裕同科技	7,500	266,700.00	0.03
319	603338	浙江鼎力	6,100	259,250.00	0.03
320	601333	广深铁路	89,000	244,750.00	0.03
321	600819	耀皮玻璃	38,300	244,354.00	0.03
322	000949	新乡化纤	38,100	241,554.00	0.03
323	600258	首旅酒店	22,100	241,332.00	0.03
324	603991	领先股份	1,700	239,955.00	0.03

325	605090	九丰能源	6,300	234,171.00	0.03
326	600323	瀚蓝环境	8,400	230,664.00	0.03
327	603619	中曼石油	12,100	226,391.00	0.03
328	603298	杭叉集团	9,400	224,284.00	0.03
329	300058	蓝色光标	16,200	222,912.00	0.03
330	000988	华工科技	1,200	221,532.00	0.03
331	301316	慧博云通	5,600	220,528.00	0.03
332	688599	天合光能	15,600	220,272.00	0.03
333	603766	隆鑫通用	18,400	219,512.00	0.03
334	688049	炬芯科技	4,600	215,786.00	0.03
335	600315	上海家化	12,800	215,296.00	0.03
336	002508	老板电器	14,600	213,452.00	0.03
337	600919	江苏银行	19,800	213,444.00	0.03
338	002533	金杯电工	19,800	211,266.00	0.03
339	688337	普源精电	2,800	209,804.00	0.03
340	000683	博源化工	36,400	209,664.00	0.03
341	300852	四会富仕	3,000	207,720.00	0.02
342	301039	中集车辆	29,400	207,270.00	0.02
343	300316	晶盛机电	3,300	199,320.00	0.02
344	300490	华自科技	15,000	198,450.00	0.02
345	301004	嘉益股份	6,400	198,400.00	0.02
346	300979	华利集团	6,600	196,350.00	0.02
347	600109	国金证券	22,100	194,038.00	0.02
348	300700	岱勒新材	8,900	189,392.00	0.02
349	300592	华凯易佰	10,700	189,390.00	0.02
350	603031	安孚科技	3,500	186,375.00	0.02
351	000963	华东医药	6,600	185,592.00	0.02
352	002107	沃华医药	32,600	185,494.00	0.02
353	603013	亚普股份	11,700	184,743.00	0.02
354	600415	小商品城	18,000	182,880.00	0.02
355	001872	招商港口	9,400	182,642.00	0.02
356	002020	京新药业	14,600	182,354.00	0.02
357	688720	艾森股份	1,800	181,800.00	0.02
358	688295	中复神鹰	3,000	181,620.00	0.02
359	002111	威海广泰	20,100	180,900.00	0.02
360	000039	中集集团	22,100	179,231.00	0.02
361	600398	海澜之家	34,000	177,820.00	0.02
362	301128	强瑞技术	1,140	177,726.00	0.02
363	601107	四川成渝	36,400	177,632.00	0.02
364	301121	紫建电子	5,500	176,110.00	0.02
365	002204	大连重工	33,300	175,824.00	0.02
366	002265	建设工业	10,100	175,740.00	0.02
367	688533	上声电子	8,400	175,224.00	0.02

368	688221	前沿生物	7,800	174,720.00	0.02
369	688209	英集芯	6,000	174,480.00	0.02
370	300515	三德科技	13,300	173,565.00	0.02
371	300743	天地数码	11,800	172,162.00	0.02
372	688081	兴图新科	4,200	171,696.00	0.02
373	601827	三峰环境	23,600	171,572.00	0.02
374	002437	誉衡药业	63,500	171,450.00	0.02
375	000899	赣能股份	17,700	170,982.00	0.02
376	688309	恒誉环保	2,800	170,464.00	0.02
377	300298	三诺生物	12,200	170,190.00	0.02
378	300169	天晟新材	34,000	169,660.00	0.02
379	300622	博士眼镜	12,160	169,510.40	0.02
380	688568	中科星图	4,074	168,948.78	0.02
381	688113	联测科技	4,800	168,480.00	0.02
382	002378	章源钨业	5,000	167,400.00	0.02
383	301032	新柴股份	18,000	167,400.00	0.02
384	601038	一拖股份	15,800	167,322.00	0.02
385	000498	山东路桥	35,300	166,969.00	0.02
386	600841	动力新科	27,300	166,530.00	0.02
387	001277	速达股份	6,000	165,540.00	0.02
388	688315	诺禾致源	13,200	165,132.00	0.02
389	300694	蠡湖股份	17,200	165,120.00	0.02
390	000001	平安银行	16,200	162,810.00	0.02
391	600150	中国船舶	4,700	158,813.00	0.02
392	002595	豪迈科技	3,390	157,974.00	0.02
393	001338	永顺泰	18,700	156,893.00	0.02
394	000902	新洋丰	13,400	154,904.00	0.02
395	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.02
396	002801	微光股份	5,500	151,800.00	0.02
397	301085	亚康股份	2,500	151,525.00	0.02
398	600028	中国石化	33,200	148,072.00	0.02
399	300503	昊志机电	1,600	147,680.00	0.02
400	603811	诚意药业	19,300	145,136.00	0.02
401	603195	公牛集团	3,700	144,855.00	0.02
402	300492	华图山鼎	4,200	144,270.00	0.02
403	000895	双汇发展	6,300	141,120.00	0.02
404	001313	粤海饲料	19,500	138,255.00	0.02
405	600267	海正药业	13,500	136,485.00	0.02
406	300098	高新兴	29,700	136,323.00	0.02
407	603558	健盛集团	12,200	135,298.00	0.02
408	600063	皖维高新	17,800	135,280.00	0.02
409	605099	共创草坪	4,200	135,240.00	0.02
410	000589	贵州轮胎	33,300	135,198.00	0.02

411	603855	华荣股份	7,700	133,441.00	0.02
412	600039	四川路桥	17,000	132,940.00	0.02
413	603187	海容冷链	11,500	132,135.00	0.02
414	605196	华通线缆	5,000	130,500.00	0.02
415	002601	龙佰集团	7,900	130,192.00	0.02
416	002648	卫星化学	5,500	129,195.00	0.02
417	603629	利通电子	700	125,167.00	0.01
418	300619	金银河	4,000	124,440.00	0.01
419	688409	富创精密	400	122,500.00	0.01
420	300610	晨化股份	12,500	121,875.00	0.01
421	001914	招商积余	14,900	121,584.00	0.01
422	301165	锐捷网络	1,500	120,675.00	0.01
423	601916	浙商银行	45,500	119,665.00	0.01
424	688577	浙海德曼	2,600	119,158.00	0.01
425	001399	惠科股份	4,282	118,739.86	0.01
426	301216	万凯新材	5,100	117,249.00	0.01
427	003006	百亚股份	8,000	116,080.00	0.01
428	603551	奥普科技	12,900	115,971.00	0.01
429	601811	新华文轩	10,600	115,964.00	0.01
430	600704	物产中大	24,300	114,696.00	0.01
431	300447	全信股份	7,500	111,975.00	0.01
432	603969	银龙股份	15,400	111,958.00	0.01
433	002315	焦点科技	4,680	108,950.40	0.01
434	688203	海正生材	10,800	107,784.00	0.01
435	002006	精工科技	7,300	107,383.00	0.01
436	002236	大华股份	6,500	107,185.00	0.01
437	002033	丽江股份	12,900	106,554.00	0.01
438	600096	云天化	3,500	106,400.00	0.01
439	000828	东莞控股	11,300	105,768.00	0.01
440	002587	奥拓电子	13,300	103,873.00	0.01
441	603337	杰克科技	2,800	101,444.00	0.01
442	603045	福达合金	1,400	99,946.00	0.01
443	600686	金龙汽车	8,800	99,352.00	0.01
444	601633	长城汽车	6,500	98,085.00	0.01
445	002410	广联达	12,000	97,920.00	0.01
446	688148	芳源股份	11,200	96,096.00	0.01
447	000830	鲁西化工	8,000	96,000.00	0.01
448	301381	赛维时代	5,200	95,888.00	0.01
449	002116	中国海诚	14,100	95,316.00	0.01
450	301267	华夏眼科	6,500	94,835.00	0.01
451	601965	中国汽研	7,900	94,484.00	0.01
452	688152	麒麟信安	3,400	93,432.00	0.01
453	688345	博力威	1,600	92,928.00	0.01

454	601002	晋亿实业	21,500	92,880.00	0.01
455	601579	会稽山	6,300	92,547.00	0.01
456	688439	振华风光	2,000	92,400.00	0.01
457	000036	华联控股	21,100	92,207.00	0.01
458	300407	凯发电气	8,500	91,800.00	0.01
459	300473	德尔股份	3,000	91,200.00	0.01
460	603889	新澳股份	17,800	90,958.00	0.01
461	603093	南华期货	5,000	90,750.00	0.01
462	300842	帝科股份	1,000	89,170.00	0.01
463	603365	水星家纺	5,700	88,749.00	0.01
464	001266	宏英智能	1,800	88,380.00	0.01
465	300413	芒果超媒	6,000	87,780.00	0.01
466	301026	浩通科技	4,300	86,946.00	0.01
467	300278	华昌达	22,000	85,360.00	0.01
468	300418	昆仑万维	2,100	84,756.00	0.01
469	002170	芭田股份	7,700	83,622.00	0.01
470	600236	桂冠电力	9,500	83,410.00	0.01
471	002652	扬子新材	19,500	83,070.00	0.01
472	000612	焦作万方	7,800	82,602.00	0.01
473	688570	天玛智控	5,800	82,534.00	0.01
474	300358	楚天科技	10,300	82,400.00	0.01
475	002195	岩山科技	12,500	81,750.00	0.01
476	688084	晶品特装	1,600	80,448.00	0.01
477	301608	博实结	1,600	80,416.00	0.01
478	002946	新乳业	5,700	80,256.00	0.01
479	301578	辰奕智能	3,910	79,724.90	0.01
480	603966	法兰泰克	9,680	78,892.00	0.01
481	002582	好想你	9,100	76,895.00	0.01
482	301073	君亭酒店	4,000	72,800.00	0.01
483	002154	报喜鸟	20,300	72,268.00	0.01
484	000596	古井贡酒	900	71,820.00	0.01
485	605338	巴比食品	4,000	71,600.00	0.01
486	600808	马钢股份	28,600	71,500.00	0.01
487	300921	南凌科技	3,500	71,085.00	0.01
488	301101	明月镜片	2,600	70,824.00	0.01
489	603233	大参林	4,700	70,641.00	0.01
490	300487	蓝晓科技	1,200	70,620.00	0.01
491	600273	嘉化能源	10,800	70,416.00	0.01
492	002895	川恒股份	2,400	70,080.00	0.01
493	603260	合盛硅业	1,400	67,564.00	0.01
494	600894	广日股份	8,800	67,056.00	0.01
495	600210	紫江企业	10,800	66,960.00	0.01
496	002851	麦格米特	400	66,872.00	0.01

497	301149	隆华新材	6,300	66,654.00	0.01
498	603236	移远通信	1,300	66,521.00	0.01
499	600369	西南证券	16,100	64,722.00	0.01
500	601577	长沙银行	7,300	63,583.00	0.01
501	600348	华阳股份	8,300	63,495.00	0.01
502	601728	中国电信	12,200	63,318.00	0.01
503	603170	宝立食品	5,600	63,280.00	0.01
504	002753	永东股份	11,100	62,715.00	0.01
505	600479	千金药业	6,700	62,310.00	0.01
506	300230	永利股份	14,800	62,160.00	0.01
507	002841	视源股份	1,800	62,154.00	0.01
508	000923	河钢资源	5,000	62,050.00	0.01
509	300415	伊之密	3,100	61,721.00	0.01
510	601595	上海电影	3,700	61,420.00	0.01
511	001376	百通能源	5,900	61,360.00	0.01
512	601033	永兴股份	4,500	60,300.00	0.01
513	603507	振江股份	1,800	59,202.00	0.01
514	688526	科前生物	4,800	58,080.00	0.01
515	300133	华策影视	8,200	58,056.00	0.01
516	300446	航天智造	3,400	57,222.00	0.01
517	603600	永艺股份	6,300	55,881.00	0.01
518	300737	科顺股份	8,500	55,845.00	0.01
519	000020	深华发 A	5,100	55,590.00	0.01
520	000888	峨眉山 A	6,200	55,428.00	0.01
521	601881	中国银河	4,400	55,308.00	0.01
522	301376	致欧科技	3,100	54,932.00	0.01
523	000937	冀中能源	13,650	54,327.00	0.01
524	002376	新北洋	9,400	54,050.00	0.01
525	002959	小熊电器	1,700	53,924.00	0.01
526	600787	中储股份	12,900	53,922.00	0.01
527	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.01
528	603790	雅运股份	2,500	53,350.00	0.01
529	600626	申达股份	16,600	52,954.00	0.01
530	300041	回天新材	3,400	52,836.00	0.01
531	001316	润贝航科	1,600	52,768.00	0.01
532	603515	欧普照明	3,200	52,288.00	0.01
533	000421	南京公用	10,400	51,584.00	0.01
534	300321	同大股份	800	51,504.00	0.01
535	002115	三维通信	5,000	51,500.00	0.01
536	603072	天和磁材	1,300	50,960.00	0.01
537	600717	天津港	13,100	50,959.00	0.01
538	601519	大智慧	5,900	50,917.00	0.01
539	603908	牧高笛	3,000	50,640.00	0.01

540	688679	通源环境	1,200	50,508.00	0.01
541	603111	康尼机电	8,900	50,374.00	0.01
542	600848	上海临港	6,600	49,434.00	0.01
543	300424	航新科技	3,100	48,794.00	0.01
544	605098	行动教育	900	48,744.00	0.01
545	000550	江铃汽车	3,000	48,660.00	0.01
546	603310	巍华新材	3,300	48,477.00	0.01
547	600623	华谊集团	6,000	48,420.00	0.01
548	603970	中农立华	5,000	48,150.00	0.01
549	002891	中宠股份	1,800	48,096.00	0.01
550	002206	海利得	9,300	48,081.00	0.01
551	001391	国货航	11,800	48,026.00	0.01
552	002701	奥瑞金	11,100	47,286.00	0.01
553	600861	北京人力	3,800	46,360.00	0.01
554	603486	科沃斯	900	45,675.00	0.01
555	301191	菲菱科思	400	45,420.00	0.01
556	600694	大商股份	3,400	44,982.00	0.01
557	603739	蔚蓝生物	3,900	44,967.00	0.01
558	603708	家家悦	5,200	44,616.00	0.01
559	603193	润本股份	2,400	44,520.00	0.01
560	300738	奥飞数据	2,200	44,484.00	0.01
561	002668	TCL 智家	4,000	44,320.00	0.01
562	600738	丽尚国潮	12,300	44,280.00	0.01
563	603466	风语筑	4,500	44,055.00	0.01
564	000089	深圳机场	7,300	44,019.00	0.01
565	603919	金徽酒	2,900	43,645.00	0.01
566	002591	恒大高新	7,000	42,840.00	0.01
567	600335	国机汽车	9,100	42,588.00	0.01
568	002780	三夫户外	3,400	41,276.00	0.00
569	603102	百合股份	1,300	41,041.00	0.00
570	002230	科大讯飞	1,000	40,840.00	0.00
571	301498	乖宝宠物	1,000	40,590.00	0.00
572	600987	航民股份	6,600	39,930.00	0.00
573	300898	熊猫乳品	2,200	39,864.00	0.00
574	600361	创新新材	11,000	39,600.00	0.00
575	601069	西部黄金	1,800	39,600.00	0.00
576	002763	汇洁股份	5,800	39,382.00	0.00
577	002627	三峡旅游	6,800	38,828.00	0.00
578	603602	纵横通信	3,500	38,570.00	0.00
579	600397	江钨装备	1,400	38,122.00	0.00
580	000717	中南股份	18,900	37,989.00	0.00
581	300662	科锐国际	2,200	37,356.00	0.00
582	000626	远大控股	5,900	37,347.00	0.00

583	300228	富瑞特装	5,000	37,000.00	0.00
584	301021	英诺激光	300	36,570.00	0.00
585	600897	厦门空港	2,500	36,500.00	0.00
586	600125	铁龙物流	7,100	35,997.00	0.00
587	300577	开润股份	2,400	35,064.00	0.00
588	600452	涪陵电力	3,700	34,521.00	0.00
589	600618	氯碱化工	3,400	34,170.00	0.00
590	301516	中远通	2,400	33,960.00	0.00
591	688559	海目星	400	33,568.00	0.00
592	600936	北投科技	7,800	33,540.00	0.00
593	600908	无锡银行	6,600	33,528.00	0.00
594	600661	昂立教育	4,800	33,168.00	0.00
595	601886	江河集团	4,000	32,120.00	0.00
596	300281	金明精机	5,300	31,959.00	0.00
597	000990	诚志股份	3,800	31,084.00	0.00
598	002838	道恩股份	1,000	30,620.00	0.00
599	300573	兴齐眼药	750	30,570.00	0.00
600	300042	朗科科技	400	30,468.00	0.00
601	000599	青岛双星	7,200	30,384.00	0.00
602	688616	西力科技	3,000	30,300.00	0.00
603	605138	盛泰集团	5,300	29,256.00	0.00
604	003012	东鹏控股	6,700	29,212.00	0.00
605	300213	佳讯飞鸿	4,800	29,088.00	0.00
606	600132	重庆啤酒	700	28,910.00	0.00
607	600925	苏能股份	7,200	28,872.00	0.00
608	301631	壹连科技	400	28,744.00	0.00
609	301219	腾远钴业	520	28,496.00	0.00
610	002163	海南发展	3,400	28,356.00	0.00
611	600780	通宝能源	4,800	28,128.00	0.00
612	300805	电声股份	3,800	27,550.00	0.00
613	000629	钒钛股份	8,000	26,720.00	0.00
614	002043	兔宝宝	2,400	26,592.00	0.00
615	688689	银河微电	400	25,888.00	0.00
616	301223	中荣股份	1,600	25,792.00	0.00
617	603508	思维列控	1,200	25,632.00	0.00
618	603194	中力股份	700	25,592.00	0.00
619	603350	安乃达	800	25,240.00	0.00
620	002746	仙坛股份	4,900	24,990.00	0.00
621	600230	沧州大化	1,900	24,738.00	0.00
622	601311	骆驼股份	3,100	24,149.00	0.00
623	002842	翔鹭钨业	500	24,100.00	0.00
624	300986	志特新材	1,400	24,010.00	0.00
625	300043	星辉娱乐	5,500	23,925.00	0.00

626	603227	雪峰科技	3,400	23,868.00	0.00
627	300355	蒙草生态	8,500	23,375.00	0.00
628	688721	龙图光罩	400	23,352.00	0.00
629	600356	恒丰纸业	3,100	22,971.00	0.00
630	000567	海德股份	3,800	22,686.00	0.00
631	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
632	605599	菜百股份	1,600	21,920.00	0.00
633	600425	青松建化	6,700	21,909.00	0.00
634	000708	中信特钢	1,700	21,454.00	0.00
635	000554	泰山石油	3,800	21,318.00	0.00
636	000737	北方铜业	1,600	21,152.00	0.00
637	300952	恒辉安防	1,200	20,880.00	0.00
638	002659	凯文教育	5,500	20,570.00	0.00
639	300511	雪榕生物	3,900	19,617.00	0.00
640	600650	锦江在线	2,000	19,280.00	0.00
641	688328	深科达	200	19,140.00	0.00
642	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
643	301555	惠柏新材	400	18,164.00	0.00
644	002416	爱施德	1,900	17,024.00	0.00
645	000726	鲁泰 A	3,100	16,833.00	0.00
646	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
647	002862	实丰文化	1,300	16,679.00	0.00
648	002563	森马服饰	3,300	16,632.00	0.00
649	000058	深赛格	2,700	16,578.00	0.00
650	002968	新大正	1,900	16,074.00	0.00
651	603396	金辰股份	600	15,900.00	0.00
652	000420	吉林化纤	3,900	15,795.00	0.00
653	603382	海阳科技	900	15,435.00	0.00
654	300795	米奥会展	1,800	15,408.00	0.00
655	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
656	300008	天海防务	2,500	15,150.00	0.00
657	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
658	600050	中国联通	3,400	13,600.00	0.00
659	000957	中通客车	1,400	13,104.00	0.00
660	601101	昊华能源	1,200	12,672.00	0.00
661	002632	道明光学	1,400	12,614.00	0.00
662	002117	东港股份	1,600	12,608.00	0.00
663	605108	同庆楼	1,100	12,496.00	0.00
664	000869	张裕 A	800	12,464.00	0.00
665	603280	南方路机	500	12,400.00	0.00
666	603071	物产环能	1,100	12,166.00	0.00
667	600725	云维股份	3,900	12,051.00	0.00
668	301011	华立科技	800	11,312.00	0.00

669	002061	浙江交科	3,400	11,220.00	0.00
670	002292	奥飞娱乐	1,700	11,152.00	0.00
671	000906	浙商中拓	2,200	11,088.00	0.00
672	300050	世纪鼎利	1,800	10,656.00	0.00
673	688781	视涯科技	217	10,331.37	0.00
674	603888	新华网	600	10,218.00	0.00
675	002153	石基信息	1,400	10,122.00	0.00
676	000848	承德露露	1,300	9,620.00	0.00
677	603167	渤海轮渡	1,100	9,427.00	0.00
678	300226	上海钢联	600	9,186.00	0.00
679	600805	悦达投资	2,200	8,866.00	0.00
680	601360	三六零	1,000	8,690.00	0.00
681	301116	益客食品	1,000	8,560.00	0.00
682	002576	通达动力	600	8,490.00	0.00
683	002752	昇兴股份	1,500	8,280.00	0.00
684	600639	浦东金桥	900	8,208.00	0.00
685	002873	新天药业	1,100	8,052.00	0.00
686	000563	陕国投 A	2,900	8,004.00	0.00
687	600489	中金黄金	400	7,220.00	0.00
688	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
689	002201	九鼎新材	600	6,558.00	0.00
690	000570	苏常柴 A	1,400	6,538.00	0.00
691	601658	邮储银行	1,300	6,409.00	0.00
692	002148	北纬科技	1,100	6,391.00	0.00
693	300770	新媒股份	200	6,298.00	0.00
694	603214	爱婴室	500	6,055.00	0.00
695	600170	上海建工	2,500	5,550.00	0.00
696	601061	中信金属	500	5,385.00	0.00
697	002998	优彩资源	800	5,208.00	0.00
698	000798	中水渔业	700	4,942.00	0.00
699	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
700	603611	诺力股份	300	4,857.00	0.00
701	600983	惠而浦	700	4,851.00	0.00
702	000881	中广核技	700	4,536.00	0.00
703	600531	豫光金铅	300	4,428.00	0.00
704	601808	中海油服	400	4,324.00	0.00
705	002381	双箭股份	800	4,144.00	0.00
706	600968	海油发展	1,200	3,996.00	0.00
707	002523	天桥起重	1,300	3,874.00	0.00
708	300279	和晶科技	600	3,630.00	0.00
709	002069	獐子岛	1,000	2,940.00	0.00
710	002707	众信旅游	600	2,880.00	0.00
711	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00

712	001208	华菱线缆	200	2,838.00	0.00
713	002035	华帝股份	600	2,712.00	0.00
714	300713	英可瑞	200	2,548.00	0.00
715	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
716	002216	三全食品	200	2,306.00	0.00
717	003017	大洋生物	100	2,300.00	0.00
718	300414	中光防雷	200	2,204.00	0.00
719	301276	嘉曼服饰	100	2,132.00	0.00
720	603899	晨光股份	100	2,063.00	0.00
721	300970	华绿生物	100	1,828.00	0.00
722	002679	福建金森	200	1,576.00	0.00
723	002136	安纳达	100	1,308.00	0.00
724	301559	中集环科	100	1,219.00	0.00
725	000059	华锦股份	200	750.00	0.00
726	601065	江盐集团	100	671.00	0.00
727	002120	韵达股份	100	636.00	0.00
728	300359	全通教育	100	358.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	37,544,576.00	4.71
2	300502	新易盛	28,581,795.00	3.59
3	603986	兆易创新	16,022,226.00	2.01
4	688525	佰维存储	15,893,867.52	2.00
5	002384	东山精密	15,294,813.00	1.92
6	688120	华海清科	14,983,420.70	1.88
7	688012	中微公司	14,738,907.28	1.85
8	688498	源杰科技	13,475,493.56	1.69
9	688008	澜起科技	13,337,721.41	1.67
10	300394	天孚通信	12,548,896.00	1.58
11	688072	拓荆科技	10,871,153.42	1.36
12	000807	云铝股份	10,041,055.00	1.26
13	301308	江波龙	9,861,186.00	1.24
14	300433	蓝思科技	9,802,712.00	1.23
15	688266	泽璟制药	9,309,556.59	1.17
16	600183	生益科技	9,269,450.00	1.16
17	688041	海光信息	9,060,296.05	1.14
18	603259	药明康德	8,986,346.00	1.13
19	300750	宁德时代	8,943,318.00	1.12

20	600487	亨通光电	8,914,863.00	1.12
----	--------	------	--------------	------

注：本项的“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300308	中际旭创	31,861,753.00	4.00
2	300502	新易盛	29,117,387.80	3.66
3	603986	兆易创新	21,358,931.00	2.68
4	300750	宁德时代	14,039,338.00	1.76
5	600183	生益科技	13,737,134.00	1.72
6	002371	北方华创	13,653,603.80	1.71
7	300014	亿纬锂能	12,486,419.81	1.57
8	688012	中微公司	12,324,707.16	1.55
9	002475	立讯精密	11,994,231.00	1.51
10	002463	沪电股份	11,931,823.00	1.50
11	688008	澜起科技	11,834,877.13	1.49
12	600519	贵州茅台	11,488,420.00	1.44
13	688766	普冉股份	10,835,069.67	1.36
14	688041	海光信息	10,490,156.79	1.32
15	600660	福耀玻璃	9,660,480.00	1.21
16	300433	蓝思科技	9,539,430.00	1.20
17	300475	香农芯创	9,527,735.00	1.20
18	603799	华友钴业	9,476,281.00	1.19
19	688525	佰维存储	9,400,989.81	1.18
20	300857	协创数据	9,299,519.80	1.17

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,689,907,153.96
卖出股票收入（成交）总额	1,870,771,481.98

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,130,357.26	3.60
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	998,852.05	0.12
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	38,000.71	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,167,210.02	3.72

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	272680007	26 横琴人寿资本补充债01	200,000	19,966,981.92	2.38
2	242580064	25 同方全球人寿永续债01	100,000	10,163,375.34	1.21
3	241289	24 建控债	10,000	998,852.05	0.12
4	118071	华峰转债	280	28,000.49	0.00
5	127114	宣化转债	100	10,000.22	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11 投资组合报告附注

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

除横琴人寿保险有限公司外，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。

本基金投资横琴人寿保险有限公司的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.11.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	222,861.92
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,423,793.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,646,655.57

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688072	拓荆科技	16,857,071.98	2.01	重大事项停牌

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
汇泉策略优选混合 A	19,119	57,003.54	547,228.80	0.05%	1,089,303,487.80	99.95%
汇泉策略优选混合 C	678	5,273.31	0.00	0%	3,575,302.82	100%
合计	19,797	55,231.90	547,228.80	0.05%	1,092,878,790.62	99.95%

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

2、户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	99.68%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	汇泉策略优选混合 A	3,860,405.84	0.35%
	汇泉策略优选混合 C	31,944.95	0.89%
	合计	3,892,350.79	0.36%

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	汇泉策略优选混合 A	10~50
	汇泉策略优选混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	汇泉策略优选混合 A	>100
	汇泉策略优选混合 C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	汇泉策略优选混合 A	汇泉策略优选混合 C
基金合同生效日（2021 年 07 月 20 日）基金份额总额	3,577,092,358.81	0.00
本报告期期初基金份额总额	1,314,932,588.99	2,654,452.03
本报告期基金总申购份额	11,337,291.70	2,039,784.53
减：本报告期基金总赎回份额	236,419,164.09	1,118,933.71
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	1,089,850,716.60	3,575,302.85

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 基金管理人的重大人事变动

本报告期内基金管理人无重大人事变动。

2. 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及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，本基金投资策略无变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所无变化。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人没有发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人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，本基金托管人相关从业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	
光大证券	3	3,560,082,606.84	100.00%	1,576,296.03	100.00%	—

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

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

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
光大证券	1,082,191.01	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	汇泉策略优选混合证券投资基金 2025 年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-01-22
2	汇泉策略优选混合型证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-03-31
3	汇泉策略优选混合型证券投资基金 2026 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2026-04-22
4	汇泉基金管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-26
5	汇泉策略优选混合型证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2026-06-26

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇泉策略优选混合型证券投资基金设立的文件；
- 2、《汇泉策略优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇泉策略优选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《汇泉策略优选混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

北京市海淀区西直门外大街 168 号腾达大厦 16 层。

12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。相关

公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站（www.springsfund.com）查阅。

汇泉基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日