

# 苏新韵启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:苏新基金管理有限公司

基金托管人:北京银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年3月24日（基金合同生效日）起至6月30日止。

## 1.2 目录

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>1</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 1         |
| 1.2 目录                                  | 2         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>4</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>5</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 5         |
| 3.2 基金净值表现                              | 6         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>7</b>  |
| 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              | 9         |
| 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                 | 11        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 11        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>11</b> |
| 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        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>              | <b>11</b> |
| 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                                | 14        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>34</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 34        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 35        |
| 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       | 35        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 40        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 41        |
| 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      | 42        |
| 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   | 42        |
| 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   | 42        |
| 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      | 42        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策                     | 42        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明               | 42        |
| 7.12 投资组合报告附注                           | 42        |

|                                    |           |
|------------------------------------|-----------|
| <b>§ 8 基金份额持有人信息</b>               | <b>43</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构              | 43        |
| 8.2 盈利投资者数量占比                      | 44        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况           | 44        |
| 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   | 44        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动</b>               | <b>44</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示</b>                 | <b>44</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议                   | 44        |
| 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   | 45        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼        | 45        |
| 10.4 基金投资策略的改变                     | 45        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况              | 45        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况       | 45        |
| 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   | 45        |
| 10.8 其他重大事件                        | 46        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b>         | <b>46</b> |
| 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 | 46        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息                | 46        |
| <b>§ 12 备查文件目录</b>                 | <b>47</b> |
| 12.1 备查文件目录                        | 47        |
| 12.2 存放地点                          | 47        |
| 12.3 查阅方式                          | 47        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                  |                 |
|---------------------|------------------|-----------------|
| 基金名称                | 苏新韵启混合型证券投资基金    |                 |
| 基金简称                | 苏新韵启混合           |                 |
| 基金主代码               | 026864           |                 |
| 基金运作方式              | 契约型开放式           |                 |
| 基金合同生效日             | 2026 年 03 月 24 日 |                 |
| 基金管理人               | 苏新基金管理有限公司       |                 |
| 基金托管人               | 北京银行股份有限公司       |                 |
| 报告期末基金份额总额          | 208,742,052.66 份 |                 |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                 |
| 下属分级基金的基金简称         | 苏新韵启混合 A         | 苏新韵启混合 C        |
| 下属分级基金的交易代码         | 026864           | 026865          |
| 报告期末下属分级基金的份<br>额总额 | 193,826,808.78 份 | 14,915,243.88 份 |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                       |
|--------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在控制投资组合风险并保持良好流动性的前提下，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期稳健增值与超越业绩比较基准的投资回报。                                                                                                                                                        |
| 投资策略   | 本基金主要采用自上而下分析的方法进行大类资产配置，确定股票、债券、现金等资产的投资比例，重点通过跟踪宏观经济数据（包括 GDP 增长率、工业增加值、PPI、CPI、市场利率变化、进出口贸易数据等）和政策环境的变化趋势，来做前瞻性的战略判断。<br>本基金的投资策略主要包括：大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券与可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、融资业务策略等。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*5%+中债-综合全价（总值）指数收益率*20%                                                                                                                                                            |
| 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。本基金如投资港股通标的股票，还需承担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      |      | 苏新基金管理有限公司                        | 北京银行股份有限公司                   |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 张玉梅                               | 闫朝                           |
|         | 联系电话 | 021-60160867                      | 010-66223587                 |
|         | 电子邮箱 | zhangym002@susingfund.com         | yanzhao@bankofbeijing.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 400-622-8862                      | 95526                        |
| 传真      |      | 021-61390352                      | 010-89661115                 |
| 注册地址    |      | 中国（江苏）自由贸易试验区苏州片区苏州工业园区钟园路728号20层 | 北京市西城区金融大街甲17号首层             |
| 办公地址    |      | 上海市虹口区公平路18号-1栋6层                 | 北京市西城区金融大街丙17号               |
| 邮政编码    |      | 200082                            | 100033                       |
| 法定代表人   |      | 卢凯                                | 关文杰                          |

## 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 | www.susingfund.com |
| 基金中期报告置备地点        | 基金管理人及基金托管人办公场所    |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称         | 办公地址              |
|--------|------------|-------------------|
| 注册登记机构 | 苏新基金管理有限公司 | 上海市虹口区公平路18号-1栋6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03月24日（基金合同生效日）-2026年06月30日） |               |
|---------------|---------------------------------------|---------------|
|               | 苏新韵启混合 A                              | 苏新韵启混合 C      |
| 本期已实现收益       | 9,958,803.30                          | 1,056,498.44  |
| 本期利润          | 12,643,663.09                         | 1,751,243.21  |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0484                                | 0.0470        |
| 本期加权平均净值利润率   | 4.74%                                 | 4.63%         |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.75%                                 | 4.63%         |
| 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      | 7,950,615.68                          | 594,004.20    |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0410                                | 0.0398        |
| 期末基金资产净值      | 203,038,864.92                        | 15,606,350.54 |
| 期末基金份额净值      | 1.0475                                | 1.0463        |

| 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  | 4.75%                  | 4.63% |

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

3、期末可供分配利润，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。

4、本基金成立于 2026 年 3 月 24 日，截止本报告期末，本基金成立未满半年。

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

苏新韵启混合 A 净值表现

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 4.95%        | 0.65%               | 8.52%              | 0.98%                     | -3.57% | -0.33% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 4.75%        | 0.62%               | 9.22%              | 0.97%                     | -4.47% | -0.35% |

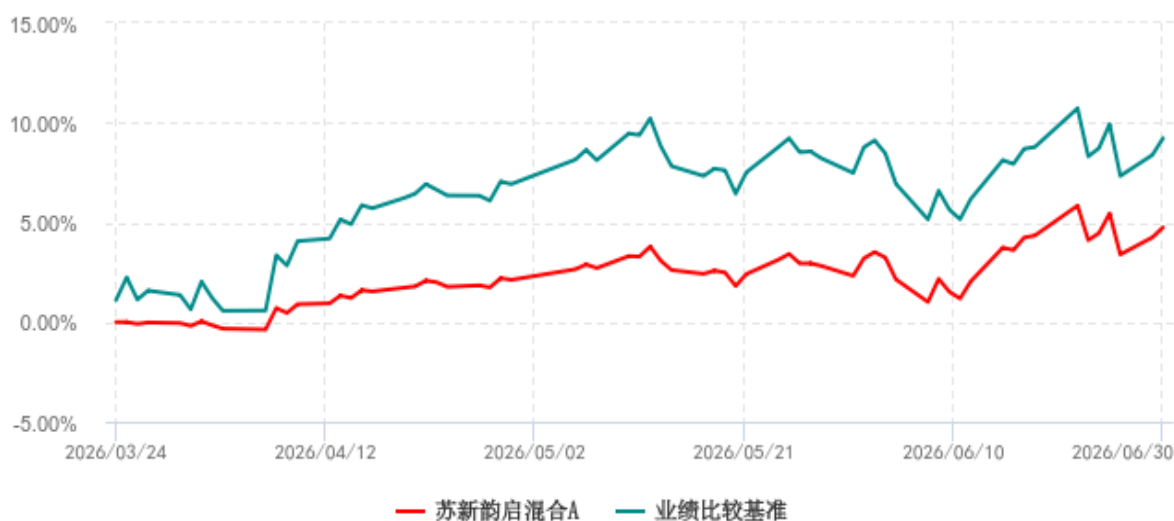
苏新韵启混合 C 净值表现

| 阶段             | 份额净值<br>增长率① | 份额净值<br>增长率标<br>准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较<br>基准收益<br>率标准差<br>④ | ①—③    | ②—④    |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | 4.84%        | 0.65%               | 8.52%              | 0.98%                     | -3.68% | -0.33% |
| 自基金合同生<br>效起至今 | 4.63%        | 0.62%               | 9.22%              | 0.97%                     | -4.59% | -0.35% |

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

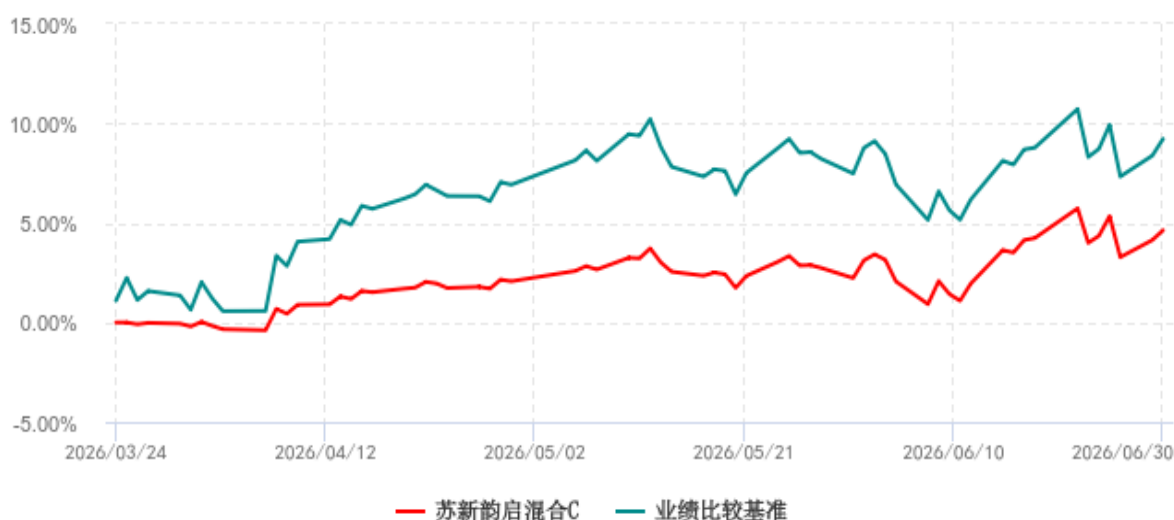
苏新韵启混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2026年03月24日-2026年06月30日)



苏新韵启混合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

(2026年03月24日-2026年06月30日)



注：本基金合同于 2026 年 3 月 24 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；按照基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

## § 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

苏新基金管理有限公司是苏州银行股份有限公司联合 Capitaland Fund Management Pte.



Ltd.（凯德基金管理有限公司）和苏州工业园区经济发展有限公司共同发起设立的基金公司，注册资本人民币 3 亿元。苏州银行出资额 1.68 亿元，出资比例 56%；凯德基金出资额 7200 万元，出资比例 24%；苏州工业园区经济发展有限公司出资额 6000 万元，出资比例 20%。

苏新基金于 2022 年 11 月 25 日获得中国证监会《关于核准设立苏新基金管理有限公司的批复》，于 2023 年 2 月 6 日取得营业执照，正式组建成立，并于 2024 年 4 月 22 日取得中国证监会核发的《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》。

截至 2026 年 6 月 30 日，公司旗下管理 10 只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务               | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|-----|------------------|-----------------|------|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                  | 任职日期            | 离任日期 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
| 李永兴 | 公司副总经理、基金经理兼投资经理 | 2026-03-24      | -    | 19 年   | 北京大学中国经济研究中心金融学硕士，具有基金从业资格。2006 年 7 月进入交银施罗德基金管理有限公司工作，先后任研究员、基金经理助理、基金经理。2015 年 11 月起任九泰基金管理有限公司投资总监。2017 年 6 月起任永赢基金管理有限公司总经理助理、基金经理，2018 年 10 月起任永赢基金管理有限公司副总经理、基金经理，其中，2018 年 7 月至 2025 年 1 月兼北京分公司负责人。2025 年 6 月入职苏新基金管理有限公司，2025 年 8 月起任公司副总经理。2025 年 11 月至今任苏新睿见量化选股股票型证券投资基金基金经理。2025 年 12 月至今任苏新苏匠债券型证券投资基金基金经理。2026 年 3 月至今任苏新韵启混合型证券投资基金基金经理。2026 年 6 月至今任苏新中证 800 指数增强型证券投资基金基金经理。另，2025 年 12 月起兼任投资经理。 |

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

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      |
|-----|----------|---------|------------------|-----------|
| 李永兴 | 公募基金     | 4       | 1,091,754,283.55 | 2025-11-4 |
|     | 私募资产管理计划 | 1       | 51,406,722.06    | 2025-12-9 |
|     | 其他组合     | -       | -                | -         |
|     | 合计       | 5       | 1,143,161,005.61 | -         |

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》等有关法律法规和本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。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《苏新基金管理有限公司公平交易管理办法》，涵盖了投资研究、交易执行等投资管理活动的各个环节，确保公平对待不同投资组合。公司通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现，同时，对公平交易的过程和结果进行监督。本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易制度，公平对待各投资组合，不存在不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，股票市场波动上行，上证指数上涨 3.16%，沪深 300 指数上涨 7.55%，创业板指数上涨 35.58%。

一季度，股票市场呈现出较大幅度的波动。自去年年底开始，在增量资金加速入市的情况下股票市场快速上涨，一直持续到 1 月中旬；1 月中下旬至 2 月在外部扰动下股票市场呈现波动状态；进入 3 月后受地缘冲突等因素影响，股票市场整体回调明显。从风格来看，中小盘指数相对抗跌，而大盘指数尤其是权重类标的，回调相对明显。

二季度，股票市场出现了较大幅度的反弹。在 4 月份美伊冲突缓解之后，A 股市场全面反弹；进入 5 月中旬之后，A 股市场开始出现较大幅度的分化，仅 AI 相关行业股价出现大幅上涨，其他多数行业股价出现下跌。从结构上看，行业之间分化明显，申万一级行业中仅 4 个行业涨幅超过指数，包括电子、通信、建筑材料、机械设备；2 个行业小幅上涨，包括基础化工和电力设备；其他 25 个行业均出现下跌，尤其是石油石化、农林牧渔等行业跌幅较大。

本基金于 3 月下旬成立，在二季度建仓期内以控制风险力争提升基金净值为主要目标，因此采取了稳步加仓的策略。截至二季度末，本基金的股票仓位约为 67%。这使得本基金的净值在二季度虽然取得了正收益，但涨幅落后于业绩比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末苏新韵启混合 A 基金份额净值为 1.0475 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.75%，同期业绩比较基准收益率为 9.22%；截至报告期末苏新韵启混合 C 基金份额净值为 1.0463 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 4.63%，同期业绩比较基准收益率为 9.22%。

#### 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，我们认为 A 股市场的投资逻辑暂时不会发生实质性改变。自 2024 年 9 月以来，A 股市场的投资主逻辑是：在低利率环境下，资金需要寻找高收益资产；在 2024 年 9 月增量资金进入股票市场之后，股票市场开始出现赚钱效应，由此引发资金持续流入股票市场，并形成资金流入股市—>市场上涨带来赚钱效应—>资金进一步流入股市的正反馈。我们认为只要低利率环境以及资金流入股票市场的趋势不出现实质性改变，那么本轮 A 股市场的投资逻辑就将延续。从结构上而言，由于宏观经济及企业盈利依然不及预期，市场暂缺少可持续的盈利投资主线，预计市场仍有可能呈现主题投资的特征。

#### 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。日常估值的账务处理、基金份额净值的计算由基金管理人独立完成，并与基金托管人进行账务核对，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术。本基金管理人建立估值决策委员会，负责建立健全估值决策体系，配备有投资、研究、交易、会计、风控和合规等岗位的资深人员。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。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。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

本报告期内，上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、《基金合同》的约定以及本基金的实际运作情况，本报告期内本基金未进行收益分配。本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

#### 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

无。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在托管苏新韵启混合型证券投资基金过程中，严格遵守了《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、基金合同、托管协议约定，对本基金的投资运作进行了监督，为本基金独立建账、独立核算、独立估值，按照托管协议约定的频率与管理人进行账务核对，本报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在能够知悉和掌握的信息范围内，按照国家法律法规规定、基金合同和托管协议约定，复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“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”、“关联方报酬-应支付销售机构的客户维护费”、“关联方报酬-销售服务费”、“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告相关内容，复核内容真实、准确和完整。

### § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：苏新韵启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<br>2026 年 06 月 30 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|
| <b>资 产:</b>   |            |                                 |
| 货币资金          | 6.4.7.1    | 14,535,604.61                   |
| 结算备付金         |            | -                               |
| 存出保证金         |            | -                               |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 146,098,241.95                  |
| 其中：股票投资       |            | 146,098,241.95                  |
| 基金投资          |            | -                               |
| 债券投资          |            | -                               |
| 资产支持证券投资      |            | -                               |
| 贵金属投资         |            | -                               |
| 其他投资          |            | -                               |
| 衍生金融资产        | 6.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产      | 6.4.7.4    | 60,004,959.70                   |
| 应收清算款         |            | -                               |
| 应收股利          |            | -                               |
| 应收申购款         |            | 133,132.58                      |
| 递延所得税资产       |            | -                               |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                               |
| 资产总计          |            | 220,771,938.84                  |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2026 年 06 月 30 日</b> |
| <b>负 债:</b>   |            |                                 |
| 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         |            | 1,783,713.55                    |
| 应付管理人报酬       |            | 247,550.35                      |
| 应付托管费         |            | 41,258.39                       |
| 应付销售服务费       |            | 6,355.20                        |
| 应付投资顾问费       |            | -                               |
| 应交税费          |            | 2,288.41                        |
| 应付利润          |            | -                               |
| 递延所得税负债       |            | -                               |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 45,557.48                       |
| 负债合计          |            | 2,126,723.38                    |
| <b>净资产:</b>   |            |                                 |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 208,742,052.66                  |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 9,903,162.80                    |
| 净资产合计         |            | 218,645,215.46                  |

|          |  |                |
|----------|--|----------------|
| 负债和净资产总计 |  | 220,771,938.84 |
|----------|--|----------------|

注：1、报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 208,742,052.66 份。其中苏新韵启混合 A 基金份额净值 1.0475 元，基金份额总额 193,826,808.78 份；苏新韵启混合 C 基金份额净值 1.0463 元，基金份额总额 14,915,243.88 份。

2、本基金合同于 2026 年 03 月 24 日生效，暂无可披露的对比数据。

6.2 利润表

会计主体：苏新韵启混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同<br>生效日）至 2026 年 06 月 30<br>日 |
|------------------------|------------|----------------------------------------------------------|
| 一、营业总收入                |            | 15,612,990.47                                            |
| 1. 利息收入                |            | 253,950.45                                               |
| 其中：存款利息收入              | 6.4.7.9    | 19,924.66                                                |
| 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             |            | 234,025.79                                               |
| 其他利息收入                 |            | -                                                        |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | 11,212,167.67                                            |
| 其中：股票投资收益              | 6.4.7.10   | 10,047,955.21                                            |
| 基金投资收益                 |            | -                                                        |
| 债券投资收益                 | 6.4.7.11   | -                                                        |
| 资产支持证券投资收益             | 6.4.7.12   | -                                                        |
| 贵金属投资收益                | 6.4.7.13   | -                                                        |
| 衍生工具收益                 | 6.4.7.14   | -                                                        |
| 股利收益                   | 6.4.7.15   | 1,164,212.46                                             |
| 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   | 3,379,604.56                                             |
| 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   | 767,267.79                                               |
| 减：二、营业总支出              |            | 1,218,084.17                                             |
| 1. 管理人报酬               | 6.4.10.2.1 | 979,068.31                                               |
| 2. 托管费                 | 6.4.10.2.2 | 163,178.06                                               |
| 3. 销售服务费               |            | 40,087.79                                                |
| 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            |             | 842. 53          |
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 19 | 34, 907. 48      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |             | 14, 394, 906. 30 |
| 减：所得税费用             |             | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |             | 14, 394, 906. 30 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |             | -                |
| 六、综合收益总额            |             | 14, 394, 906. 30 |

6.3 净资产变动表

会计主体：苏新韵启混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目                                      | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）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                                | -                                                 | -                | -                  |
| 二、本期期初净资产                                | 350, 122, 389. 69                                 | -                | 350, 122, 389. 69  |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | -141, 380, 337. 03                                | 9, 903, 162. 80  | -131, 477, 174. 23 |
| （一）、综合收益总额                               | -                                                 | 14, 394, 906. 30 | 14, 394, 906. 30   |
| （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）      | -141, 380, 337. 03                                | -4, 491, 743. 50 | -145, 872, 080. 53 |
| 其中：1. 基金申购款                              | 6, 975, 629. 94                                   | 229, 335. 97     | 7, 204, 965. 91    |
| 2. 基金赎回款                                 | -148, 355, 966. 97                                | -4, 721, 079. 47 | -153, 077, 046. 44 |
| （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                                | 208, 742, 052. 66                                 | 9, 903, 162. 80  | 218, 645, 215. 46  |

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：

卢凯

曹秋荣

陶浩然

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

苏新韵启混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）系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（2026）259 号文《关于准予苏新韵启混合型证券投资基金注册的批

复》准予注册，由基金管理人苏新基金管理有限公司向社会公开募集。基金合同于 2026 年 3 月 24 日生效。首次设立时募集规模为 350,122,389.69 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为苏新基金管理有限公司，基金托管人为北京银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、中期票据、政府支持债券、政府支持机构债券、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、货币市场工具、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等）、资产支持证券、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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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。

本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*75%+中证港股通综合指数（人民币）收益率\*5%+中债-综合全价（总值）指数收益率\*20%

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 3 月 24 日（基金合同生效日）起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 3 月 24 日（基金合同生效日）起至 2026 年 6 月 30 日止。



#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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、以摊余成本计量的金融资产；

##### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

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处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违

约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的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按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；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大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支

持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的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当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

2、在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况每半年对本基金进行一次或多次收益分配，分配时间、分配方案及收益分配数额等内容，基金管理人可以根据实际情况确定并按照规定公告，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

3、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若基金份额持有人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；

4、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人在与基金托管人协商一致后经履行适当程序，可调整基金收益的分配原则和支付方式，但应于变更实施前在规定媒介上公告。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 6.4.6.2、增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号文《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，对公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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，继续免征增值税直至债券到期。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号文《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的

规定，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下称资管产品运营业务）和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。

6.4.6.3、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

6.4.6.4、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.5、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

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<br>2026 年 06 月 30 日 |
|------|-------------------------|
| 活期存款 | 980,470.27              |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 等于：本金          | 980,076.03    |
| 加：应计利息         | 394.24        |
| 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           | 13,555,134.34 |
| 等于：本金          | 13,554,848.84 |
| 加：应计利息         | 285.50        |
| 减：坏账准备         | -             |
| 合计             | 14,535,604.61 |

注：其他存款本期末余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。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |      |                |              |
|---------------|-------|-------------------------|------|----------------|--------------|
|               |       | 成本                      | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动       |
| 股票            |       | 142,718,637.39          | -    | 146,098,241.95 | 3,379,604.56 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 |       | -                       | -    | -              | -            |
| 债券            | 交易所市场 | -                       | -    | -              | -            |
|               | 银行间市场 | -                       | -    | -              | -            |
|               | 合计    | -                       | -    | -              | -            |
| 资产支持证券        |       | -                       | -    | -              | -            |
| 基金            |       | -                       | -    | -              | -            |
| 其他            |       | -                       | -    | -              | -            |
| 合计            |       | 142,718,637.39          | -    | 146,098,241.95 | 3,379,604.56 |

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

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2026 年 06 月 30 日 |
|----|----------------------|
|----|----------------------|

|       | 账面余额          | 其中：买断式逆回购 |
|-------|---------------|-----------|
| 交易所市场 | 60,004,959.70 | -         |
| 银行间市场 | -             | -         |
| 合计    | 60,004,959.70 | -         |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.5 其他资产

注：无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 |
|-------------|-------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                       |
| 应付赎回费       | -                       |
| 应付证券出借违约金   | -                       |
| 应付交易费用      | -                       |
| 其中：交易所市场    | -                       |
| 银行间市场       | -                       |
| 应付利息        | -                       |
| 预提费用        | 34,107.48               |
| 其他应付        | 11,450.00               |
| 合计          | 45,557.48               |

6.4.7.7 实收基金

苏新韵启混合 A

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                           | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 289,615,088.40                                    | 289,615,088.40  |
| 本期申购          | 5,868,440.09                                      | 5,868,440.09    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -101,656,719.71                                   | -101,656,719.71 |
| 本期末           | 193,826,808.78                                    | 193,826,808.78  |

苏新韵启混合 C

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |      |
|----|---------------------------------------------------|------|
|    | 基金份额（份）                                           | 账面金额 |



|               | 基金份额（份）        | 账面金额           |
|---------------|----------------|----------------|
| 基金合同生效日       | 60,507,301.29  | 60,507,301.29  |
| 本期申购          | 1,107,189.85   | 1,107,189.85   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -46,699,247.26 | -46,699,247.26 |
| 本期末           | 14,915,243.88  | 14,915,243.88  |

注：1、申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金合同于 2026 年 3 月 24 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 349,938,079.98 元，其中 A 类基金份额净认购金额为人民币 289,451,418.30 元，C 类基金份额净认购金额为人民币 60,486,661.68 元。在募集期间产生活期存款利息 184,309.71 元，其中 A 类基金份额利息为 163,670.10 元，C 类基金份额利息为 20,639.61 元。以上实收基金（本息）合计为人民币 350,122,389.69 元，折合 350,122,389.69 份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

苏新韵启混合 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       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -             | -             | -             |
| 本期利润           | 9,958,803.30  | 2,684,859.79  | 12,643,663.09 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,008,187.62 | -1,423,419.33 | -3,431,606.95 |
| 其中：基金申购款       | 126,412.52    | 71,900.72     | 198,313.24    |
| 基金赎回款          | -2,134,600.14 | -1,495,320.05 | -3,629,920.19 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 7,950,615.68  | 1,261,440.46  | 9,212,056.14  |

苏新韵启混合 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       |
|----------------|--------------|-------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -            | -           | -             |
| 本期利润           | 1,056,498.44 | 694,744.77  | 1,751,243.21  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -462,494.24  | -597,642.31 | -1,060,136.55 |
| 其中：基金申购款       | 19,491.10    | 11,531.63   | 31,022.73     |
| 基金赎回款          | -481,985.34  | -609,173.94 | -1,091,159.28 |
| 本期已分配利润        | -            | -           | -             |
| 本期末            | 594,004.20   | 97,102.46   | 691,106.66    |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |
|----|---------------------------------------------------|
|----|---------------------------------------------------|

|           |           |
|-----------|-----------|
| 活期存款利息收入  | 5,857.61  |
| 定期存款利息收入  | —         |
| 其他存款利息收入  | 14,067.05 |
| 结算备付金利息收入 | —         |
| 其他        | —         |
| 合计        | 19,924.66 |

注：其他存款利息收入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产生的利息。

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 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------|------------------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 536,958,496.06                                 |
| 减：卖出股票成本总额 | 526,349,416.51                                 |
| 减：交易费用     | 561,124.34                                     |
| 买卖股票差价收入   | 10,047,955.21                                  |

6.4.7.11 债券投资收益

注：无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

注：无。

6.4.7.13 贵金属投资收益

注：无。

6.4.7.14 衍生工具收益

注：无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,164,212.46                                      |
| 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            | 1,164,212.46                                      |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |
|------------------------|---------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 3,379,604.56                                      |
| ——股票投资                 | 3,379,604.56                                      |
| ——债券投资                 | —                                                 |
| ——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                     | 3,379,604.56                                      |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 767,267.79                                        |
| 合计      | 767,267.79                                        |

6.4.7.18 信用减值损失

注：无。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------------------|
| 审计费用    | 16,616.16                                         |
| 信息披露费   | 17,491.32                                         |
| 证券出借违约金 | —                                                 |
| 证券账户开户费 | 800.00                                            |
| 合计      | 34,907.48                                         |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本基金本报告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             |
|--------------------------------------------------|---------------------|
| 苏新基金管理有限公司（以下简称“苏新基金”）                           | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 北京银行股份有限公司（以下简称“北京银行”）                           | 基金托管人               |
| 苏州银行股份有限公司（以下简称“苏州银行”）                           | 基金管理人的股东、基金销售机构     |
| CapitaLand Fund Management Pte. Ltd.（凯德基金管理有限公司） | 基金管理人的股东            |
| 苏州工业园区经济发展有限公司                                   | 基金管理人的股东            |
| 东吴证券股份有限公司（以下简称“东吴证券”）                           | 其他关联方、基金销售机构        |

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

注：无。

6.4.10.1.2 权证交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券交易

注：无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：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 03 月 24 日（基金合同生效日）至<br>2026 年 06 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 979,068.31                                     |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 398,828.96                                     |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 580,239.35                                     |

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20%的年费率计提。  
计算方法如下：

$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$   
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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                                             |
|----------------|------------------------------------------------|
|                | 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026<br>年 06 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 163,178.06                                     |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。  
计算方法如下：

$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$   
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

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<br>名称 | 本期 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30<br>日 |           |           |
|--------------------|---------------------------------------------------|-----------|-----------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费                                  |           |           |
|                    | 苏新韵启混合 A                                          | 苏新韵启混合 C  | 合计        |
| 苏州银行               | -                                                 | 19,318.81 | 19,318.81 |
| 东吴证券               | -                                                 | 20,181.53 | 20,181.53 |
| 合计                 | -                                                 | 39,500.34 | 39,500.34 |

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40%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。计算方法如下

$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$   
H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费  
E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期                                          |          |
|-------|---------------------------------------------|----------|
|       | 2026 年 03 月 24 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日 |          |
|       | 期末余额                                        | 当期利息收入   |
| 北京银行  | 980,470.27                                  | 5,857.61 |

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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

注：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

注：无。

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 | 重大事项筹划 | 832.00 | 2026-07-13 | 890.99 | 500   | 323,545.26 | 416,000.00 | -  |

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

注：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

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要有信用风险、流动性风险及市场风险等。本基金的基金管理人制定了相应的政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理职能部门以及各个部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为本部门风险控制的第一责任人，投资组合经理是相应投资组合风险控制的第一责任人。公司全体员工是本岗位风险控制的直接责任人，负责具体风险控制职责的实施。本基金的基金管理人设立风险控制职能部门，负责执行公司风险管理战略和决策，对投资组合的风险进行独立地监控、评估及报告。

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于信用良好的银行。本基金对现券交易对手方采用黑名单方式管理，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，违约可能性较小；在银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，同时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严格的债券库制度以有效地控制信用风险，对债券发行人自身偿债能力及增信条款进行了充分的考虑并同时采取分散化投资方式防范信用风险。于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险主要来自于基金份额持有人要求赎回其持有的基金份额，因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。

##### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采取了一系列管理措施，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金进行流动性风险管理。本基金的基金管理人采用监控投资组合资产持仓集中度、流动性受限资产比例、7 个工作日可变现资产与净资产比例等方式防范流动性风险。此外，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。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。

本基金持有的资产主要为银行存款、股票等，其中银行存款主要为活期存款，股票主要为在交易所公开发行上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，本基金未持有有重大流动性风险的投资品种。

#### 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现金流在很大程度上独立于市场利率变化。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2026<br>年 06 月 30<br>日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计             |
|----------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产                         |               |       |       |                |                |
| 货币资金                       | 14,535,604.61 | -     | -     | -              | 14,535,604.61  |
| 交易性金融资产                    | -             | -     | -     | 146,098,241.95 | 146,098,241.95 |
| 买入返售金融资产                   | 60,004,959.70 | -     | -     | -              | 60,004,959.70  |
| 应收申购款                      | -             | -     | -     | 133,132.58     | 133,132.58     |
| 资产总计                       | 74,540,564.31 | -     | -     | 146,231,374.53 | 220,771,938.84 |
| 负债                         |               |       |       |                |                |
| 应付赎回款                      | -             | -     | -     | 1,783,713.55   | 1,783,713.55   |
| 应付管理人报酬                    | -             | -     | -     | 247,550.35     | 247,550.35     |
| 应付托管费                      | -             | -     | -     | 41,258.39      | 41,258.39      |
| 应付销售服务费                    | -             | -     | -     | 6,355.20       | 6,355.20       |
| 应交税费                       | -             | -     | -     | 2,288.41       | 2,288.41       |
| 其他负债                       | -             | -     | -     | 45,557.48      | 45,557.48      |
| 负债总计                       | -             | -     | -     | 2,126,723.38   | 2,126,723.38   |
| 利率敏感度缺口                    | 74,540,564.31 | -     | -     | 144,104,651.15 | 218,645,215.46 |

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

注：本基金本报告期末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，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。

##### 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 |               |
|---------------|----------------------|---------------|
|               | 公允价值                 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 146,098,241.95       | 66.82         |
| 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            | 146,098,241.95       | 66.82         |

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变 |                                 |
|----|-------------------------|---------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动               | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额<br>(单位：人民币元) |
|    |                         | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日         |
|    | 下降 5%                   | -5,136,357.92                   |
|    | 上升 5%                   | 5,136,357.92                    |

#### 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<br>2026 年 06 月 30 日 |
|---------------|-------------------------|
| 第一层次          | 145,682,241.95          |

|      |                |
|------|----------------|
| 第二层次 | 416,000.00     |
| 第三层次 | —              |
| 合计   | 146,098,241.95 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，其账面价值与公允价值差异较小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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   | 146,098,241.95 | 66.18        |
|    | 其中：股票  | 146,098,241.95 | 66.18        |
| 2  | 基金投资   | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资 | —              | —            |
|    | 其中：债券  | —              | —            |
|    | 资产支持证券 | —              | —            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 4 | 贵金属投资             | -              | -      |
| 5 | 金融衍生品投资           | -              | -      |
| 6 | 买入返售金融资产          | 60,004,959.70  | 27.18  |
|   | 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      | 14,535,604.61  | 6.58   |
| 8 | 其他各项资产            | 133,132.58     | 0.06   |
| 9 | 合计                | 220,771,938.84 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 979,720.00     | 0.45         |
| B  | 采矿业              | 8,575,172.00   | 3.92         |
| C  | 制造业              | 86,934,365.60  | 39.76        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 4,857,667.00   | 2.22         |
| E  | 建筑业              | 1,586,175.00   | 0.73         |
| F  | 批发和零售业           | 439,936.00     | 0.20         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 5,106,930.00   | 2.34         |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 4,634,419.35   | 2.12         |
| J  | 金融业              | 28,998,446.00  | 13.26        |
| K  | 房地产业             | 590,274.00     | 0.27         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 419,210.00     | 0.19         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,780,493.00   | 0.81         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 765,610.00     | 0.35         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -              | -            |
| P  | 教育               | -              | -            |
| Q  | 卫生和社会工作          | -              | -            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | -              | -            |
| S  | 综合               | 429,824.00     | 0.20         |
|    | 合计               | 146,098,241.95 | 66.82        |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

|    |        |        |         |              |      |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 1  | 300308 | 中际旭创   | 5,600   | 7,112,000.00 | 3.25 |
| 2  | 300750 | 宁德时代   | 16,200  | 6,366,762.00 | 2.91 |
| 3  | 600519 | 贵州茅台   | 4,200   | 4,979,058.00 | 2.28 |
| 4  | 300502 | 新易盛    | 7,640   | 4,637,480.00 | 2.12 |
| 5  | 601899 | 紫金矿业   | 123,400 | 3,102,276.00 | 1.42 |
| 6  | 688256 | 寒武纪    | 1,737   | 2,771,470.35 | 1.27 |
| 7  | 601318 | 中国平安   | 55,300  | 2,640,022.00 | 1.21 |
| 8  | 688008 | 澜起科技   | 6,900   | 2,138,310.00 | 0.98 |
| 9  | 600036 | 招商银行   | 58,500  | 2,076,750.00 | 0.95 |
| 10 | 688041 | 海光信息   | 5,400   | 1,999,620.00 | 0.91 |
| 11 | 002371 | 北方华创   | 2,200   | 1,946,032.00 | 0.89 |
| 12 | 300274 | 阳光电源   | 11,900  | 1,892,338.00 | 0.87 |
| 13 | 002384 | 东山精密   | 7,100   | 1,862,685.00 | 0.85 |
| 14 | 600030 | 中信证券   | 64,000  | 1,838,720.00 | 0.84 |
| 15 | 300476 | 胜宏科技   | 5,200   | 1,801,436.00 | 0.82 |
| 16 | 603259 | 药明康德   | 14,300  | 1,780,493.00 | 0.81 |
| 17 | 002475 | 立讯精密   | 24,600  | 1,731,840.00 | 0.79 |
| 18 | 300059 | 东方财富   | 84,900  | 1,730,262.00 | 0.79 |
| 19 | 000333 | 美的集团   | 22,500  | 1,699,425.00 | 0.78 |
| 20 | 601398 | 工商银行   | 238,500 | 1,686,195.00 | 0.77 |
| 21 | 600276 | 恒瑞医药   | 31,400  | 1,634,056.00 | 0.75 |
| 22 | 688012 | 中微公司   | 3,272   | 1,532,932.00 | 0.70 |
| 23 | 601288 | 农业银行   | 229,200 | 1,391,244.00 | 0.64 |
| 24 | 300408 | 三环集团   | 8,300   | 1,385,270.00 | 0.63 |
| 25 | 601328 | 交通银行   | 213,200 | 1,370,876.00 | 0.63 |
| 26 | 603986 | 兆易创新   | 1,600   | 1,304,000.00 | 0.60 |
| 27 | 601166 | 兴业银行   | 77,000  | 1,275,120.00 | 0.58 |
| 28 | 601816 | 京沪高铁   | 269,100 | 1,219,023.00 | 0.56 |
| 29 | 601138 | 工业富联   | 16,600  | 1,197,690.00 | 0.55 |
| 30 | 688981 | 中芯国际   | 7,200   | 1,143,504.00 | 0.52 |
| 31 | 600000 | 浦发银行   | 128,700 | 1,108,107.00 | 0.51 |
| 32 | 601857 | 中国石油   | 122,700 | 1,065,036.00 | 0.49 |
| 33 | 002916 | 深南电路   | 2,300   | 1,053,170.00 | 0.48 |
| 34 | 603993 | 洛阳钼业   | 58,400  | 1,024,920.00 | 0.47 |
| 35 | 601688 | 华泰证券   | 49,000  | 1,010,380.00 | 0.46 |
| 36 | 601601 | 中国太保   | 35,300  | 1,006,756.00 | 0.46 |
| 37 | 000001 | 平安银行   | 99,600  | 1,000,980.00 | 0.46 |
| 38 | 000792 | 盐湖股份   | 33,000  | 996,270.00   | 0.46 |
| 39 | 002594 | 比亚迪    | 12,500  | 996,250.00   | 0.46 |
| 40 | 600031 | 三一重工   | 56,700  | 979,776.00   | 0.45 |
| 41 | 002714 | 牧原股份   | 28,000  | 979,720.00   | 0.45 |
| 42 | 000100 | TCL 科技 | 168,300 | 979,506.00   | 0.45 |
| 43 | 601225 | 陕西煤业   | 46,600  | 948,310.00   | 0.43 |

|    |        |       |         |            |      |
|----|--------|-------|---------|------------|------|
| 44 | 300760 | 迈瑞医疗  | 6,800   | 923,644.00 | 0.42 |
| 45 | 601919 | 中远海控  | 68,600  | 909,636.00 | 0.42 |
| 46 | 601600 | 中国铝业  | 109,400 | 899,268.00 | 0.41 |
| 47 | 000425 | 徐工机械  | 110,400 | 893,136.00 | 0.41 |
| 48 | 601988 | 中国银行  | 153,700 | 879,164.00 | 0.40 |
| 49 | 600690 | 海尔智家  | 42,200  | 861,302.00 | 0.39 |
| 50 | 600926 | 杭州银行  | 58,600  | 846,770.00 | 0.39 |
| 51 | 601985 | 中国核电  | 93,400  | 843,402.00 | 0.39 |
| 52 | 000977 | 浪潮信息  | 11,800  | 826,000.00 | 0.38 |
| 53 | 300033 | 同花顺   | 3,400   | 819,400.00 | 0.37 |
| 54 | 601766 | 中国中车  | 154,800 | 804,960.00 | 0.37 |
| 55 | 601009 | 南京银行  | 78,000  | 771,420.00 | 0.35 |
| 56 | 000408 | 藏格矿业  | 11,000  | 762,520.00 | 0.35 |
| 57 | 000776 | 广发证券  | 32,000  | 748,800.00 | 0.34 |
| 58 | 688111 | 金山办公  | 3,500   | 745,675.00 | 0.34 |
| 59 | 601658 | 邮储银行  | 150,200 | 740,486.00 | 0.34 |
| 60 | 300394 | 天孚通信  | 2,420   | 732,485.60 | 0.34 |
| 61 | 600489 | 中金黄金  | 40,400  | 729,220.00 | 0.33 |
| 62 | 002179 | 中航光电  | 15,600  | 720,720.00 | 0.33 |
| 63 | 600019 | 宝钢股份  | 131,700 | 715,131.00 | 0.33 |
| 64 | 601872 | 招商轮船  | 39,200  | 688,744.00 | 0.32 |
| 65 | 600066 | 宇通客车  | 24,900  | 667,569.00 | 0.31 |
| 66 | 600362 | 江西铜业  | 15,400  | 666,820.00 | 0.30 |
| 67 | 002311 | 海大集团  | 14,800  | 660,228.00 | 0.30 |
| 68 | 601998 | 中信银行  | 92,100  | 638,253.00 | 0.29 |
| 69 | 000338 | 潍柴动力  | 23,400  | 637,650.00 | 0.29 |
| 70 | 000725 | 京东方 A | 73,400  | 637,112.00 | 0.29 |
| 71 | 000166 | 申万宏源  | 144,000 | 633,600.00 | 0.29 |
| 72 | 601211 | 国泰海通  | 34,600  | 629,720.00 | 0.29 |
| 73 | 003816 | 中国广核  | 160,900 | 629,119.00 | 0.29 |
| 74 | 600886 | 国投电力  | 47,000  | 625,570.00 | 0.29 |
| 75 | 600115 | 中国东航  | 162,600 | 619,506.00 | 0.28 |
| 76 | 601077 | 渝农商行  | 98,500  | 601,835.00 | 0.28 |
| 77 | 600674 | 川投能源  | 42,300  | 599,391.00 | 0.27 |
| 78 | 001979 | 招商蛇口  | 91,800  | 590,274.00 | 0.27 |
| 79 | 002463 | 沪电股份  | 3,800   | 580,640.00 | 0.27 |
| 80 | 600029 | 南方航空  | 110,000 | 569,800.00 | 0.26 |
| 81 | 601336 | 新华保险  | 9,400   | 560,804.00 | 0.26 |
| 82 | 300124 | 汇川技术  | 8,300   | 550,539.00 | 0.25 |
| 83 | 600025 | 华能水电  | 60,300  | 536,067.00 | 0.25 |
| 84 | 600085 | 同仁堂   | 22,900  | 529,219.00 | 0.24 |
| 85 | 300832 | 新产业   | 12,600  | 529,200.00 | 0.24 |
| 86 | 000651 | 格力电器  | 13,900  | 521,250.00 | 0.24 |

|     |        |       |         |            |      |
|-----|--------|-------|---------|------------|------|
| 87  | 601319 | 中国人保  | 77,100  | 521,196.00 | 0.24 |
| 88  | 000999 | 华润三九  | 22,600  | 508,274.00 | 0.23 |
| 89  | 600183 | 生益科技  | 2,900   | 502,860.00 | 0.23 |
| 90  | 600018 | 上港集团  | 105,800 | 499,376.00 | 0.23 |
| 91  | 603195 | 公牛集团  | 12,700  | 497,205.00 | 0.23 |
| 92  | 600150 | 中国船舶  | 14,400  | 486,576.00 | 0.22 |
| 93  | 600887 | 伊利股份  | 20,200  | 483,992.00 | 0.22 |
| 94  | 603067 | 振华股份  | 10,400  | 481,416.00 | 0.22 |
| 95  | 601136 | 首创证券  | 34,300  | 478,485.00 | 0.22 |
| 96  | 688019 | 安集科技  | 1,400   | 475,244.00 | 0.22 |
| 97  | 000858 | 五 粮 液 | 6,400   | 473,600.00 | 0.22 |
| 98  | 601088 | 中国神华  | 12,100  | 472,384.00 | 0.22 |
| 99  | 001309 | 德明利   | 500     | 471,450.00 | 0.22 |
| 100 | 002156 | 通富微电  | 6,100   | 462,807.00 | 0.21 |
| 101 | 002518 | 科士达   | 8,600   | 460,874.00 | 0.21 |
| 102 | 000032 | 深桑达 A | 18,200  | 454,090.00 | 0.21 |
| 103 | 688027 | 国盾量子  | 900     | 453,609.00 | 0.21 |
| 104 | 600919 | 江苏银行  | 42,000  | 452,760.00 | 0.21 |
| 105 | 002266 | 浙富控股  | 89,300  | 451,858.00 | 0.21 |
| 106 | 002851 | 麦格米特  | 2,700   | 451,386.00 | 0.21 |
| 107 | 300223 | 北京君正  | 1,800   | 448,020.00 | 0.20 |
| 108 | 688521 | 芯原股份  | 1,200   | 445,368.00 | 0.20 |
| 109 | 002534 | 西子洁能  | 24,000  | 445,200.00 | 0.20 |
| 110 | 000831 | 中国稀土  | 8,000   | 443,920.00 | 0.20 |
| 111 | 300604 | 长川科技  | 1,300   | 443,846.00 | 0.20 |
| 112 | 300672 | 国科微   | 1,500   | 442,500.00 | 0.20 |
| 113 | 600109 | 国金证券  | 50,200  | 440,756.00 | 0.20 |
| 114 | 002416 | 爱施德   | 49,100  | 439,936.00 | 0.20 |
| 115 | 600872 | 中炬高新  | 25,200  | 437,472.00 | 0.20 |
| 116 | 000686 | 东北证券  | 51,800  | 435,120.00 | 0.20 |
| 117 | 600298 | 安琪酵母  | 12,000  | 434,400.00 | 0.20 |
| 118 | 002595 | 豪迈科技  | 9,300   | 433,380.00 | 0.20 |
| 119 | 002080 | 中材科技  | 4,800   | 432,000.00 | 0.20 |
| 120 | 002465 | 海格通信  | 33,800  | 431,626.00 | 0.20 |
| 121 | 000729 | 燕京啤酒  | 42,600  | 431,538.00 | 0.20 |
| 122 | 600418 | 江淮汽车  | 16,700  | 431,361.00 | 0.20 |
| 123 | 603899 | 晨光股份  | 20,900  | 431,167.00 | 0.20 |
| 124 | 300765 | 石药创新  | 15,800  | 430,234.00 | 0.20 |
| 125 | 600673 | 东阳光   | 12,800  | 429,824.00 | 0.20 |
| 126 | 000623 | 吉林敖东  | 24,200  | 429,066.00 | 0.20 |
| 127 | 600970 | 中材国际  | 60,100  | 428,513.00 | 0.20 |
| 128 | 000758 | 中色股份  | 65,100  | 427,707.00 | 0.20 |
| 129 | 000027 | 深圳能源  | 68,900  | 427,180.00 | 0.20 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 130 | 601665 | 齐鲁银行 | 73,800  | 425,826.00 | 0.19 |
| 131 | 002716 | 湖南白银 | 52,600  | 425,534.00 | 0.19 |
| 132 | 000060 | 中金岭南 | 56,000  | 423,920.00 | 0.19 |
| 133 | 301308 | 江波龙  | 600     | 422,280.00 | 0.19 |
| 134 | 000922 | 佳电股份 | 30,200  | 421,592.00 | 0.19 |
| 135 | 000415 | 渤海租赁 | 103,000 | 419,210.00 | 0.19 |
| 136 | 688072 | 拓荆科技 | 500     | 416,000.00 | 0.19 |
| 137 | 000883 | 湖北能源 | 93,700  | 404,784.00 | 0.19 |
| 138 | 002155 | 湖南黄金 | 16,800  | 401,016.00 | 0.18 |
| 139 | 002895 | 川恒股份 | 13,700  | 400,040.00 | 0.18 |
| 140 | 603885 | 吉祥航空 | 38,700  | 398,223.00 | 0.18 |
| 141 | 002270 | 华明装备 | 20,800  | 392,080.00 | 0.18 |
| 142 | 002128 | 电投能源 | 16,900  | 390,728.00 | 0.18 |
| 143 | 600008 | 首创环保 | 142,100 | 386,512.00 | 0.18 |
| 144 | 002706 | 良信股份 | 35,400  | 386,214.00 | 0.18 |
| 145 | 002375 | 亚厦股份 | 110,700 | 374,166.00 | 0.17 |
| 146 | 002429 | 兆驰股份 | 34,300  | 356,377.00 | 0.16 |
| 147 | 600104 | 上汽集团 | 35,700  | 348,432.00 | 0.16 |
| 148 | 601668 | 中国建筑 | 75,900  | 329,406.00 | 0.15 |
| 149 | 603568 | 伟明环保 | 20,400  | 313,752.00 | 0.14 |
| 150 | 600309 | 万华化学 | 4,500   | 307,845.00 | 0.14 |
| 151 | 301238 | 瑞泰新材 | 12,500  | 305,000.00 | 0.14 |
| 152 | 000739 | 普洛药业 | 18,000  | 299,880.00 | 0.14 |
| 153 | 603019 | 中科曙光 | 2,700   | 289,521.00 | 0.13 |
| 154 | 002396 | 星网锐捷 | 15,000  | 287,550.00 | 0.13 |
| 155 | 002577 | 雷柏科技 | 15,000  | 275,400.00 | 0.13 |
| 156 | 600089 | 特变电工 | 11,700  | 263,250.00 | 0.12 |
| 157 | 002028 | 思源电气 | 1,400   | 242,200.00 | 0.11 |
| 158 | 600111 | 北方稀土 | 5,000   | 240,250.00 | 0.11 |
| 159 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,200   | 231,836.00 | 0.11 |
| 160 | 001286 | 陕西能源 | 21,200  | 214,968.00 | 0.10 |
| 161 | 000063 | 中兴通讯 | 5,800   | 209,902.00 | 0.10 |
| 162 | 600584 | 长电科技 | 2,000   | 207,100.00 | 0.09 |
| 163 | 600050 | 中国联通 | 50,900  | 203,600.00 | 0.09 |
| 164 | 600522 | 中天科技 | 3,200   | 194,176.00 | 0.09 |
| 165 | 000598 | 兴蓉环境 | 29,700  | 190,674.00 | 0.09 |
| 166 | 601156 | 东航物流 | 11,600  | 186,992.00 | 0.09 |
| 167 | 002415 | 海康威视 | 5,300   | 181,260.00 | 0.08 |
| 168 | 002516 | 旷达科技 | 32,100  | 179,118.00 | 0.08 |
| 169 | 002230 | 科大讯飞 | 4,100   | 167,444.00 | 0.08 |
| 170 | 601728 | 中国电信 | 30,300  | 157,257.00 | 0.07 |
| 171 | 603306 | 华懋科技 | 1,500   | 155,535.00 | 0.07 |
| 172 | 603083 | 剑桥科技 | 600     | 152,922.00 | 0.07 |



|     |        |      |        |            |      |
|-----|--------|------|--------|------------|------|
| 173 | 002050 | 三花智控 | 3,100  | 135,873.00 | 0.06 |
| 174 | 600176 | 中国巨石 | 1,700  | 123,896.00 | 0.06 |
| 175 | 600295 | 鄂尔多斯 | 10,900 | 116,848.00 | 0.05 |
| 176 | 002142 | 宁波银行 | 3,700  | 109,853.00 | 0.05 |
| 177 | 002317 | 众生药业 | 4,100  | 100,737.00 | 0.05 |
| 178 | 600406 | 国电南瑞 | 4,400  | 100,540.00 | 0.05 |
| 179 | 002335 | 科华数据 | 1,400  | 59,430.00  | 0.03 |
| 180 | 601229 | 上海银行 | 6,500  | 56,420.00  | 0.03 |
| 181 | 600016 | 民生银行 | 14,100 | 45,402.00  | 0.02 |
| 182 | 600941 | 中国移动 | 500    | 43,065.00  | 0.02 |
| 183 | 002484 | 江海股份 | 300    | 31,500.00  | 0.01 |
| 184 | 601012 | 隆基绿能 | 2,300  | 30,176.00  | 0.01 |
| 185 | 601939 | 建设银行 | 2,800  | 26,964.00  | 0.01 |
| 186 | 002648 | 卫星化学 | 1,100  | 25,839.00  | 0.01 |
| 187 | 600660 | 福耀玻璃 | 500    | 25,220.00  | 0.01 |
| 188 | 002352 | 顺丰控股 | 500    | 15,630.00  | 0.01 |
| 189 | 603799 | 华友钴业 | 300    | 14,478.00  | 0.01 |
| 190 | 600938 | 中国海油 | 500    | 13,575.00  | 0.01 |
| 191 | 000733 | 振华科技 | 200    | 11,328.00  | 0.01 |

## 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末基金资产净值 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<br>金额  | 占期末基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1  | 300750 | 宁德时代 | 11,127,228.00 | 5.09               |
| 2  | 300308 | 中际旭创 | 9,069,131.00  | 4.15               |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 8,787,359.00  | 4.02               |
| 4  | 300502 | 新易盛  | 8,612,704.80  | 3.94               |
| 5  | 601899 | 紫金矿业 | 7,824,582.00  | 3.58               |
| 6  | 600030 | 中信证券 | 6,327,839.00  | 2.89               |
| 7  | 600183 | 生益科技 | 5,822,310.00  | 2.66               |
| 8  | 603993 | 洛阳钼业 | 5,754,142.00  | 2.63               |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 5,749,893.00  | 2.63               |
| 10 | 000338 | 潍柴动力 | 5,692,110.00  | 2.60               |
| 11 | 002475 | 立讯精密 | 5,523,790.00  | 2.53               |
| 12 | 300059 | 东方财富 | 5,386,306.00  | 2.46               |
| 13 | 601211 | 国泰海通 | 4,924,331.00  | 2.25               |
| 14 | 600919 | 江苏银行 | 4,915,784.00  | 2.25               |
| 15 | 688981 | 中芯国际 | 4,856,775.15  | 2.22               |
| 16 | 603259 | 药明康德 | 4,851,756.00  | 2.22               |
| 17 | 688008 | 澜起科技 | 4,841,053.90  | 2.21               |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 603986 | 兆易创新 | 4,728,860.00 | 2.16 |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 4,499,918.00 | 2.06 |
| 20 | 600036 | 招商银行 | 4,429,771.00 | 2.03 |

注：“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末基金资产净值 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<br>金额 | 占期末基金资产净值比例<br>(%) |
|----|--------|-------|--------------|--------------------|
| 1  | 300502 | 新易盛   | 6,059,944.00 | 2.77               |
| 2  | 600183 | 生益科技  | 5,900,632.68 | 2.70               |
| 3  | 300308 | 中际旭创  | 5,485,963.00 | 2.51               |
| 4  | 603986 | 兆易创新  | 5,234,386.00 | 2.39               |
| 5  | 000338 | 潍柴动力  | 4,926,766.00 | 2.25               |
| 6  | 300750 | 宁德时代  | 4,731,602.60 | 2.16               |
| 7  | 603993 | 洛阳钼业  | 4,722,891.00 | 2.16               |
| 8  | 600030 | 中信证券  | 4,710,222.00 | 2.15               |
| 9  | 600919 | 江苏银行  | 4,456,721.00 | 2.04               |
| 10 | 601211 | 国泰海通  | 4,427,487.00 | 2.02               |
| 11 | 002475 | 立讯精密  | 4,401,012.00 | 2.01               |
| 12 | 688981 | 中芯国际  | 4,317,999.23 | 1.97               |
| 13 | 600176 | 中国巨石  | 3,936,704.00 | 1.80               |
| 14 | 688008 | 澜起科技  | 3,857,931.99 | 1.76               |
| 15 | 002050 | 三花智控  | 3,830,115.00 | 1.75               |
| 16 | 300059 | 东方财富  | 3,801,469.00 | 1.74               |
| 17 | 601899 | 紫金矿业  | 3,782,715.00 | 1.73               |
| 18 | 600875 | 东方电气  | 3,565,433.00 | 1.63               |
| 19 | 000725 | 京东方 A | 3,500,676.00 | 1.60               |
| 20 | 603259 | 药明康德  | 3,347,741.00 | 1.53               |

注：“卖出金额”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 | 669,068,053.90 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 536,958,496.06 |

注：“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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：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

注：本基金本报告期内未投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：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 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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行（600036.SH）在报告编制日前一年内曾受到监管机构的处罚或警示。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司投资制度的要求。

### 7.12.2 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中，没有投资于超出基金合同约定备选库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额         |
|----|-------|------------|
| 1  | 存出保证金 | —          |
| 2  | 应收清算款 | —          |
| 3  | 应收股利  | —          |
| 4  | 应收利息  | —          |
| 5  | 应收申购款 | 133,132.58 |
| 6  | 其他应收款 | —          |
| 7  | 待摊费用  | —          |
| 8  | 其他    | —          |
| 9  | 合计    | 133,132.58 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别     | 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额  | 持有人结构   |        |                |        |
|----------|----------|------------|---------|--------|----------------|--------|
|          |          |            | 机构投资者   |        | 个人投资者          |        |
|          |          |            | 持有份额    | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 苏新韵启混合 A | 1,449    | 133,765.91 | 0       | 0%     | 193,826,808.78 | 100%   |
| 苏新韵启混合 C | 289      | 51,609.84  | 100,000 | 0.67%  | 14,815,243.88  | 99.33% |
| 合计       | 1,738    | 120,104.75 | 100,000 | 0.05%  | 208,642,052.66 | 99.95% |

注：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）。

8.2 盈利投资者数量占比

注：本基金成立未满一年。

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<br>(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 | 苏新韵启混合 A | 54,651.86     | 0.03%    |
|                  | 苏新韵启混合 C | 10,009.72     | 0.07%    |
|                  | 合计       | 64,661.58     | 0.03%    |

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<br>(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 | 苏新韵启混合 A | 0                     |
|                                | 苏新韵启混合 C | 0                     |
|                                | 合计       | 0                     |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 苏新韵启混合 A | 0                     |
|                                | 苏新韵启混合 C | 0                     |
|                                | 合计       | 0                     |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                 | 苏新韵启混合 A       | 苏新韵启混合 C      |
|---------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2026 年 03 月 24 日）基金份额总额 | 289,615,088.40 | 60,507,301.29 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额           | 5,868,440.09   | 1,107,189.85  |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额         | 101,656,719.71 | 46,699,247.26 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额          | -              | -             |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 193,826,808.78 | 14,915,243.88 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，本基金管理人未发生高管变动。
- 2、报告期内，未发生基金托管人专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

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未发生改变。

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

注：本报告期内，本基金管理人未受到调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，未发生托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门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 |    |
| 中金财富证券 | 3      | 1,206,026,549.96 | 100.00%      | 274,698.93 | 100.00%    | -  |

|          |   |   |   |   |   |   |
|----------|---|---|---|---|---|---|
| 开源证<br>券 | 3 | - | - | - | - | - |
|----------|---|---|---|---|---|---|

注：1、本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

2、本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

3、本表中所列券商交易单元均为本报告期新增。

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 |
| 中金财富证券 | -    | -            | 2,402,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            | -    | -            |
| 开源证券   | -    | -            | -                | -              | -    | -            | -    | -            |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                       | 法定披露方式    | 法定披露日期     |
|----|--------------------------------------------|-----------|------------|
| 1  | 苏新韵启混合型证券投资基金基金合同生效公告                      | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-25 |
| 2  | 苏新基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告(2025 年度) | 中国证监会规定媒介 | 2026-03-30 |
| 3  | 《苏新基金管理有限公司对外行使表决权(2025 年度)情况信息披露》         | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-22 |
| 4  | 苏新韵启混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告      | 中国证监会规定媒介 | 2026-04-23 |

§ 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

注：无。

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、苏新韵启混合型证券投资基金基金合同
- 2、苏新韵启混合型证券投资基金托管协议
- 3、苏新韵启混合型证券投资基金招募说明书
- 4、关于准予苏新韵启混合型证券投资基金注册的批复
- 5、报告期内披露的各项公告
- 6、法律法规要求备查的其他文件

### 12.2 存放地点

苏新基金管理有限公司办公地点：上海市虹口区公平路 18 号 1 栋 6 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.susingfund.com](http://www.susingfund.com)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

咨询电话：400-622-8862

苏新基金管理有限公司  
二〇二六年八月三十一日