

明亚多元配置三个月持有期混合型基金中
基金（FOF）
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：明亚基金管理有限责任公司

基金托管人：第一创业证券股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人第一创业证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 16 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
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	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48

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	48
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	48
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	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 本报告期投资基金情况	48
7.13 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
8.3 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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	55
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	55
10.9 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）	
基金简称	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）	
基金主代码	026628	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 1 月 16 日	
基金管理人	明亚基金管理有限责任公司	
基金托管人	第一创业证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	140,525,235.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF） A	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF） C
下属分级基金的交易代码	026628	026629
报告期末下属分级基金的份额总额	139,580,095.28 份	945,140.13 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在严格控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。
投资策略	1、资产配置策略；2、基金投资策略：（1）ETF 投资策略；（2）其他基金投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*50%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*15%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率*10%+中债新综合全价(总值)指数收益率*25%
风险收益特征	本基金是混合型基金中基金，预期风险和预期收益高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金若投资港股通标的股票，则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		明亚基金管理有限责任公司	第一创业证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吴建炜	周妍
	联系电话	4008-785-795	0755-23838083
	电子邮箱	compliance@mingyafunds.com	zhouyan@fcsc.com
客户服务电话		4008-785-795	0755-23838083
传真		0755-23626574	-

注册地址	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T1 写字楼 1804B	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 层
办公地址	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T1 写字楼 1804B	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 层
邮政编码	518000	518000
法定代表人	王靖	郭川

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.mingyafunds.com
基金中期报告置备地点	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804B

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	明亚基金管理有限责任公司	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804B

§ 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	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）-2026 年 6 月 30 日	
	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF） A	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF） C
本期已实现收益	623,611.97	1,182.89
本期利润	-67,023.49	-4,089.89
加权平均基金份额本期利润	-0.0003	-0.0068
本期加权平均净值利润率	-0.03%	-0.68%
本期基金份额净值增长率	0.10%	-0.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

期末可供分配利润	140,458.74	-2,623.93
期末可供分配基金份额利润	0.0010	-0.0028
期末基金资产净值	139,720,554.02	942,516.20
期末基金份额净值	1.0010	0.9972
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.10%	-0.28%

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、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）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	1.55%	0.34%	4.16%	0.89%	-2.61%	-0.55%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.44%	-0.63%	0.95%	0.73%	-0.51%

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）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	1.25%	0.34%	4.16%	0.89%	-2.91%	-0.55%
自基金合同生效起至今	-0.28%	0.44%	-0.63%	0.95%	0.35%	-0.51%

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

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金合同于 2026 年 1 月 16 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年。

§ 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

明亚基金管理有限公司于 2019 年 2 月 11 日获得中国证监会核准设立，2019 年 11 月 18 日取得中华人民共和国经营证券期货业务许可证，实缴资本 10980 万元人民币，注册地为深圳前海。明亚基金管理有限公司目前管理的公募基金有：明亚价值长青混合型证券投资基金、明

亚中证 1000 指数增强型证券投资基金、明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金、明亚稳利 3 个月持有期债券型证券投资基金、明亚远臻智选混合型证券投资基金、明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、明亚稳健配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）。明亚基金管理有限公司股东均为资产管理业专业人士，核心管理团队拥有二十多年的管理经验，将“基本面研究”和“量化策略”有效结合，秉持为投资者创造价值的坚定信念，致力于为投资者的长期利益服务。

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		
许智程	基金经理	2026 年 1 月 16 日	—	18 年	英国帝国理工学院金融学硕士。曾任职于彭博有限合伙企业、国泰君安咨询服务有限公司、大华继显（香港）有限公司、前方基金管理有限公司、弘毅远方基金管理有限公司；2024 年 9 月加入明亚基金，现任 FOF 投资部基金经理。
靳大力	基金经理	2026 年 6 月 29 日	—	10 年	兰州财经大学数量经济学硕士，FRM。2015 年 7 月至 2022 年 1 月任职于西部期货有限公司，历任研究员、投资经理；2022 年 1 月至 2023 年 10 月任职于上海鲲洋投资管理有限公司，历任投资总监、基金经理。2023 年 10 月加入明亚基金，现任 FOF 投资部基金经理。

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

报告期内，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，基金管理人严格遵守《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销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》等基金法律文件的约定，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。

报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的情况。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理

公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，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投资组合，未发现违反公平交易原则的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为，未出现基金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，本基金坚持大类资产配置框架，在市场风格快速切换、地缘冲突持续扰动的复杂环境中，严格把控风险收益比，力求组合的稳健运作。上半年市场的核心特征可以概括为：内外宏观分化加剧、资产价格极致分化、波动中枢显著抬升。

从宏观环境看，上半年“外紧内稳”的格局贯穿始终。海外方面，美联储上半年按兵不动，但政策立场经历了明显转向——年初市场仍在博弈降息节奏，随着通胀粘性超预期及新任美联储主席沃什上任后释放“通胀优先”信号，6 月点阵图彻底删除降息指引，半数官员转而支持年内至少加息一次，美元指数维持强势。这一转变直接重塑了全球资产定价逻辑：美股 AI 硬件龙头与传统板块走势严重分化，原油因地缘局势维持高位，黄金在加息预期与避险需求之间宽幅震荡。国内方面，经济延续平稳复苏，一季度开局良好、二季度斜率放缓但结构优化，AI 产业链、高端制造、国产替代等新经济方向保持高景气。财政政策靠前发力、货币政策稳步推进价格型转型，流动性始终维持合理充裕，短端利率走廊机制进一步完善。

大类资产层面，上半年分化行情淋漓尽致。权益市场方面，A 股科技成长主线贯穿始终，AI 算力、半导体设备、高端制造等板块领涨，消费与金融持续承压，宽基指数涨跌互现但成交额中枢逐步抬升，资金加速向业绩确定性高的核心赛道集中；港股震荡调整，高股息与硬科技龙头相对抗跌，南向资金持续布局估值洼地。债券市场呈现典型的“短强长弱”，短端利率债依托流动性支撑表现稳健，长端则在通胀预期、供给放量与权益分流三重压力下上行幅度超年初预期，久期策略承压。大宗商品中，原油受地缘风险与供给约束双支撑维持高位，工业金属需求温和。

投资运作上，上半年我们始终锚定大类资产配置的核心框架，同时根据市场实际运行持续校准策略偏差、优化配置比例。组合构建上采用“核心底仓打底+左侧布局增厚”的双层结构，围绕年初制定的三条主线动态调整各类资产权重：一是对海外政策转向保持警惕，主动控制美元资产敞口与估值敏感品种的仓位；二是权益端聚焦业绩确定性，沿科技成长、周期资源、高股息防御三条主线优化持仓，精准把握高端制造产业链的结构性机会；三是固收端坚持短端打底、严控久期

的思路，借助利率对冲工具缓释长端利率上行带来的净值波动，择机捕捉票息收益与估值修复机会，同时配置平衡型与偏股型转债增厚收益、增强弹性，在结构性行情中力求攻守兼备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A 基金份额净值为 1.0010，本报告期基金份额净值增长率为 0.1%；截至本报告期末，明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C 基金份额净值为 0.9972，本报告期基金份额净值增长率为-0.28%；同期业绩比较基准收益率为-0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望短中期，海外货币政策转向节奏、国内经济复苏强度及地缘局势演变仍是三大核心变量。我们将继续以大类资产配置为核心，依托全品类工具灵活调整组合结构，密切跟踪边际变化，严控回撤风险，力争为持有人创造持续稳健的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证券监督管理委员会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理人采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人根据相关法律法规，制定了健全、有效的估值政策和程序，建立了估值委员会，估值委员会由分管基金运营部的高级管理人员、督察长和投资部、研究部、交易部、基金运营部、合规风控部负责人组成，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	91,763,679.48
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	6.4.7.2	49,185,392.04
其中：股票投资		5,194,951.40
基金投资		43,990,440.64
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
其他投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收清算款		—
应收股利		—
应收申购款		—

递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.8	—
资产总计		140,949,071.52
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 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		1.00
应付管理人报酬		122,695.92
应付托管费		15,336.98
应付销售服务费		299.11
应付投资顾问费		—
应交税费		71,115.53
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.9	76,552.76
负债合计		286,001.30
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	140,525,235.41
未分配利润	6.4.7.12	137,834.81
净资产合计		140,663,070.22
负债和净资产总计		140,949,071.52

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 140,525,235.41 份，其中明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）A 基金份额净值 1.0010 元，份额总额 139,580,095.28 份；明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）C 基金份额净值 0.9972 元，份额总额 945,140.13 份。

6.2 利润表

会计主体：明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同 生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		822,997.85
1. 利息收入		282,046.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	47,213.40

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		234,833.12
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		931,481.03
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,721,749.47
基金投资收益	6.4.7.15	2,216,902.35
债券投资收益	6.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	436,328.15
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-695,908.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	305,378.54
减：二、营业总支出		894,111.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	720,681.54
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	90,085.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,082.58
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	6.4.7.24	-
7. 税金及附加		8,347.15
8. 其他费用	6.4.7.25	73,914.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-71,113.38
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-71,113.38
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-71,113.38

6.3 净资产变动表

会计主体：明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）

本报告期：2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	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	201,067,973.64	-	-	201,067,973.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-60,542,738.23	-	137,834.81	-60,404,903.42
（一）、综合收益总额	-	-	-71,113.38	-71,113.38
（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）	-60,542,738.23	-	208,948.19	-60,333,790.04
其中：1. 基金申购款	739,399.81	-	2,503.80	741,903.61
2. 基金赎回款	-61,282,138.04	-	206,444.39	-61,075,693.65
（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	140,525,235.41	-	137,834.81	140,663,070.22

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：

<u>王靖</u>	<u>杨飞</u>	<u>李晓妹</u>
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

明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）（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[2025]3047 号《关于准予明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》核准，由明亚基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）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人民币 201,060,129.46 元，已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明（2026）验字

第 80033582_G01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》于 2026 年 1 月 16 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 201,067,973.64 份基金份额,其中认购资金利息折合 7,844.18 份基金份额。本基金的基金管理人为明亚基金管理有限责任公司,基金托管人为第一创业证券股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者通过直销机构以外的其他销售机构认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额,投资者通过直销机构认购/申购 A 类基金份额时不收取前端认购/申购费用。在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从直销机构以外的其他销售机构持有的本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额(其中,对于投资者通过直销机构认购/申购的 C 类基金份额,计提的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者;对于投资者通过其他销售机构认购/申购的 C 类基金份额,持有超过一年后计提到的销售服务费将在投资者赎回相应基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者)。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值。计算日某类基金份额净值=计算日该类基金份额的基金资产净值/计算日该类基金份额余额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(以下简称“证券投资基金”,包含公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募 REITs”)、QDII 基金、香港互认基金、商品基金(含商品期货基金和黄金 ETF,下同)及其他经中国证监会依法核准或注册的基金)、国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许上市的股票及存托凭证)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场证券(包括股票和 ETF,简称“港股通标的证券”)、债券(包含国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。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:本基金投资于证券投资基金的资产比例不低于基金资产的 80%,其中本基金投资于权益类资产的比例为 20%-70%,投资于港股通股票的资产不超过股票资产的 50%;保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备

付金、存出保证金和应收申购款等。权益类资产包括股票、股票型基金以及权益类混合型基金。权益类混合型基金指至少满足以下一条标准的混合型基金：（1）基金合同约定投资股票资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）基金最近 4 期季度报告中披露的股票资产占基金资产的比例均不低于 60%。如法律法规或监管机构以后对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

本基金业绩比较基准：中证 A500 指数收益率*50%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)*15%+上海黄金交易所 Au99.99 现货实盘合约收盘价收益率*10%+中债新综合全价(总值)指数收益率*25%。

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、应用指南、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》、《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 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日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 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的编制期间系 2026 年 1 月 16 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

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，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的相关过去事项、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）本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对各类基金份额选择不同的分红方式。选择采取红利再投资形式的，红利再投资的份额免收申购费；

（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（3）同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 分部报告

无。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动

性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国证券投资基金业协会[2022]566号《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金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

根据财政部、国家税务总局公告2025年第4号，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。上述金融债券，是指依法在中华人民共和国境内设立的金融机构法人在全国银行间和交易所债券市场发行的、按约定还本付息并由金融机构持有的有价证券。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

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》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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。本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《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[2016]127 号文《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	316,529.56
等于：本金	313,348.41
加：应计利息	3,181.15
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	91,447,149.92
等于：本金	91,445,763.95
加：应计利息	1,385.97
减：坏账准备	—
合计	91,763,679.48

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	5,952,175.02	—	5,194,951.40	-757,223.62
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	43,929,125.26	—	43,990,440.64	61,315.38
其他	—	—	—	—
合计	49,881,300.28	—	49,185,392.04	-695,908.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	-
其他	3,038.00
预提审计费	16,600.00
预提信息披露费	56,914.76
合计	76,552.76

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	200,596,146.13	200,596,146.13
本期申购	192,968.63	192,968.63

本期赎回（以“-”号填列）	-61,209,019.48	-61,209,019.48
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	139,580,095.28	139,580,095.28

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	471,827.51	471,827.51
本期申购	546,431.18	546,431.18
本期赎回（以“-”号填列）	-73,118.56	-73,118.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	945,140.13	945,140.13

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	623,611.97	-690,635.46	-67,023.49
本期基金份额交易产生的变动数	446,578.87	-239,096.64	207,482.23
其中：基金申购款	497.14	85.57	582.71
基金赎回款	446,081.73	-239,182.21	206,899.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,070,190.84	-929,732.10	140,458.74

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C

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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,182.89	-5,272.78	-4,089.89
本期基金份额交易产生的变动数	196.19	1,269.77	1,465.96

其中：基金申购款	266.79	1,654.30	1,921.09
基金赎回款	-70.60	-384.53	-455.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,379.08	-4,003.01	-2,623.93

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	36,257.97
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	10,952.89
结算备付金利息收入	-
其他	2.54
合计	47,213.40

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,721,749.47
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,721,749.47

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	162,188,893.14
减：卖出股票成本总额	163,745,119.36
减：交易费用	165,523.25
买卖股票差价收入	-1,721,749.47

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
----	---

卖出/赎回基金成交总额	304,855,838.63
减：卖出/赎回基金成本总额	302,467,628.17
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	69,559.52
减：交易费用	101,748.59
基金投资收益	2,216,902.35

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	387,156.75
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	49,171.40
合计	436,328.15

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-695,908.24
股票投资	-757,223.62
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	61,315.38
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	-695,908.24

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	305,378.54

合计	305,378.54
----	------------

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	2,722.95
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	149,451.17
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	36,251.28

6.4.7.24 信用减值损失

无。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	16,600.00
信息披露费	56,914.76
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	73,914.76

6.4.7.26 分部报告

无。

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

截至本财务报表批准报出日，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

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

无

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
明亚基金管理有限公司（“明亚基金”）	基金管理人
第一创业证券股份有限公司（“第一创业证券”）	基金托管人
王靖	基金管理人股东

注：以下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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
第一创业证券	331,886,187.52	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
第一创业证券	4,003,122,000.00	100.00

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期基金 成交总额的比例（%）
第一创业证券	651,229,492.06	100.00

6.4.10.1.5 权证交易

无。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月16日（基金合同生效日）至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
第一创业证券	167,147.65	100.00	-	-

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	720,681.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	289,580.75
应支付基金管理人的净管理费	431,100.79

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有本基金管理人管理的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.80% 的年费率计提，本基金投资于本基金管理人所管理的公开募集的基金份额的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

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扣除前一日所持有的基金管理人管理的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	90,085.20

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除前一日所持有基金托管人托管的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.10% 的年费率计提，本基金投资于本基金托管人所托管的公开募集的基金份额的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下：

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值扣除前一日所持有的基金托管人托管的公开募集的基金份额所对应资产净值后的余额，若为负数，则 E 取 0

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期无应支付关联方的销售服务费。

支付给基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给明亚基金管理有限责任公司，再由明亚基金管理有限责任公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

（1）基金管理人直销渠道：对于基金份额收取的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。基金销售子公司销售母公司所管理基金的，按照本条要求执行。

（2）代销渠道：对于投资者持续持有期限未超过一年（即 365 天，下同）的基金份额收取的销售服务费，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休假或不可抗力等致使无法按时支付的顺延至最近可支付日支付。对于持续持有期限超过一年的基金份额继续收取的销售服务费，在投资者赎回基金份额或基金合同终止时，随赎回款（或清算款）一并返还给投资者。其中，持续持有期限为合同生效日（针对募集期内认购的基金份额）或该笔份额申购、转入确认日与赎回、转出确认日或基金合同终止情形发生日下一工作日的间隔天数。

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
王靖	50,003.89	0.0358

注：王靖为公司股东，其投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者使用的费率标准相一致。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
第一创业证券	316,529.56	36,257.97

注：本基金的活期存款由基金托管人第一创业证券保管，按银行约定利率计息。

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

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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
002729	好利科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	17.80	2026 年 7 月 6 日	19.58	1,700	32,253.00	30,260.00	-

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

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是混合型基金中基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，但低于股票型基金、股票型基金中基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。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股票，除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，公司风险管理架构由风控合规委员会、督察长、合规风控部、以及各个业务部门组成。各业务部门负责人为其所在部门的风险管理第一责任人，对本部门业务范围内的风险负有管控和及时报告的义务。员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人配备的风险管理人员对投资风险进行独立的监控并及时向管理层汇报。

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同责任，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。

于本报告期末，本基金未持有债券或资产支持证券。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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。

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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金主要投资于公开募集的证券投资基金、股票及信用状况良好的固定收益类资产，报告期末本基金所持的证券均能及时变现，资产变现能力强。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

本报告期内，未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	91,763,679.48	-	-	-	-	-	91,763,679.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-49,185,392.04	49,185,392.04
资产总计	91,763,679.48	-	-	-	-	-49,185,392.04	140,949,071.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1.00	1.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	122,695.92	122,695.92
应付托管费	-	-	-	-	-	15,336.98	15,336.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	299.11	299.11
应交税费	-	-	-	-	-	71,115.53	71,115.53
其他负债	-	-	-	-	-	76,552.76	76,552.76
负债总计	-	-	-	-	-	286,001.30	286,001.30

利率敏感度缺口	91,763,679.48	-	-	-	-48,899,390.74	140,663,070.22
---------	---------------	---	---	---	----------------	----------------

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对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。本基金因投资港股通标的而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 外汇风险的敏感性分析

本基金未持有不以记账本位币计价的资产，因此不存在相应的外汇风险。

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。本基金主要投资于公开募集的证券投资基金及证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的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。本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 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	5,194,951.40	3.69
交易性金融资产—基金投资	43,990,440.64	31.27
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	49,185,392.04	34.97

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2026 年 6 月 30 日）

业绩比较基准上升 5%	30,248.28
业绩比较基准下降 5%	-30,248.28

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 6 月 30 日
第一层次	49,155,132.04
第二层次	30,260.00
第三层次	—
合计	49,185,392.04

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

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	5,194,951.40	3.69
	其中：股票	5,194,951.40	3.69
2	基金投资	43,990,440.64	31.21
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	91,763,679.48	65.10
8	其他各项资产	—	—
9	合计	140,949,071.52	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	3,605,523.90	2.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	310,701.00	0.22
E	建筑业	134,816.00	0.10
F	批发和零售业	344,163.50	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	102,680.00	0.07
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	172,433.00	0.12

J	金融业	130,366.00	0.09
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	125,441.00	0.09
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	129,709.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	34,100.00	0.02
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	105,018.00	0.07
S	综合	—	—
	合计	5,194,951.40	3.69

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002612	朗姿股份	7,400	82,954.00	0.06
2	601717	中创智领	4,800	66,768.00	0.05
3	603165	荣晟环保	5,100	66,453.00	0.05
4	601216	君正集团	14,300	63,778.00	0.05
5	600398	海澜之家	10,700	55,961.00	0.04
6	002884	凌霄泵业	3,600	54,864.00	0.04
7	600496	精工钢构	17,600	54,560.00	0.04
8	600694	大商股份	4,050	53,581.50	0.04
9	600329	达仁堂	1,400	52,108.00	0.04
10	603855	华荣股份	3,000	51,990.00	0.04
11	603551	奥普科技	5,700	51,243.00	0.04
12	300406	九强生物	4,600	50,278.00	0.04
13	002327	富安娜	8,400	49,896.00	0.04
14	601668	中国建筑	11,400	49,476.00	0.04
15	000719	中原传媒	4,200	48,006.00	0.03
16	001323	慕思股份	3,000	47,400.00	0.03
17	603788	宁波高发	3,400	46,920.00	0.03
18	300270	中威电子	3,600	46,836.00	0.03
19	600011	华能国际	6,000	45,540.00	0.03
20	002628	成都路桥	8,500	45,475.00	0.03
21	601107	四川成渝	9,300	45,384.00	0.03
22	605599	菜百股份	3,300	45,210.00	0.03
23	002557	洽洽食品	2,500	44,900.00	0.03
24	600285	羚锐制药	2,300	44,574.00	0.03
25	000899	赣能股份	4,600	44,436.00	0.03

26	600023	浙能电力	8,200	43,132.00	0.03
27	603866	桃李面包	11,600	42,688.00	0.03
28	601997	贵阳银行	8,300	42,579.00	0.03
29	600210	紫江企业	6,800	42,160.00	0.03
30	603139	康惠股份	1,000	42,110.00	0.03
31	600642	申能股份	4,800	41,904.00	0.03
32	603111	康尼机电	7,400	41,884.00	0.03
33	600415	小商品城	4,100	41,656.00	0.03
34	002690	美亚光电	2,900	41,557.00	0.03
35	002170	芭田股份	3,800	41,268.00	0.03
35	601900	南方传媒	3,800	41,268.00	0.03
36	601000	唐山港	9,900	41,085.00	0.03
37	301207	华兰疫苗	2,500	40,725.00	0.03
38	601566	九牧王	5,000	40,650.00	0.03
39	603611	诺力股份	2,500	40,475.00	0.03
40	301109	军信股份	3,200	39,872.00	0.03
41	601186	中国铁建	6,700	39,865.00	0.03
42	000543	皖能电力	5,200	39,364.00	0.03
43	603879	永悦科技	8,700	39,324.00	0.03
44	603937	丽岛新材	2,800	39,256.00	0.03
45	603515	欧普照明	2,400	39,216.00	0.03
46	002216	三全食品	3,400	39,202.00	0.03
47	603899	晨光股份	1,900	39,197.00	0.03
48	603195	公牛集团	1,000	39,150.00	0.03
49	300534	陇神戎发	5,500	38,940.00	0.03
50	300247	融捷健康	10,600	38,902.00	0.03
51	002425	凯撒文化	14,900	38,889.00	0.03
52	300112	万讯自控	6,200	38,378.00	0.03
53	300575	中旗股份	7,800	38,376.00	0.03
54	001231	农心科技	2,100	38,304.00	0.03
55	603900	莱绅通灵	6,800	38,284.00	0.03
56	300610	晨化股份	3,900	38,025.00	0.03
57	000683	博源化工	6,600	38,016.00	0.03
58	300405	科隆股份	7,300	37,814.00	0.03
59	002748	世龙实业	3,600	37,728.00	0.03
60	600778	友好集团	7,700	37,653.00	0.03
61	002566	益盛药业	6,200	37,448.00	0.03
62	002942	新农股份	2,600	37,258.00	0.03
63	002319	乐通股份	3,600	37,152.00	0.03
64	002259	升达林业	9,800	37,142.00	0.03
65	600015	华夏银行	5,800	37,062.00	0.03
66	603685	晨丰科技	1,300	37,050.00	0.03
67	002802	洪汇新材	3,500	36,820.00	0.03

68	000590	古汉医药	4,500	36,765.00	0.03
69	002054	德美化工	5,500	36,575.00	0.03
70	300823	建科智能	2,500	36,450.00	0.03
71	603356	华菱精工	2,200	36,344.00	0.03
72	300647	超频三	6,100	36,295.00	0.03
73	601169	北京银行	7,400	36,260.00	0.03
74	300599	雄塑科技	3,600	36,252.00	0.03
75	603190	亚通精工	1,600	36,192.00	0.03
76	603172	万丰股份	2,200	36,146.00	0.03
77	600768	宁波富邦	2,400	35,952.00	0.03
78	603329	上海雅仕	4,000	35,920.00	0.03
79	301019	宁波色母	2,000	35,660.00	0.03
80	600333	长春燃气	7,100	35,642.00	0.03
81	603970	中农立华	3,700	35,631.00	0.03
82	605122	四方新材	3,300	35,574.00	0.03
83	600272	开开实业	3,500	35,490.00	0.03
84	300030	阳普医疗	6,100	35,441.00	0.03
85	600215	派斯林	6,100	35,380.00	0.03
86	002722	物产金轮	3,000	35,370.00	0.03
87	300025	华星创业	8,400	35,280.00	0.03
88	002780	三夫户外	2,900	35,206.00	0.03
89	002451	摩恩电气	5,000	35,200.00	0.03
90	002660	茂硕电源	5,400	35,100.00	0.02
91	300743	天地数码	2,400	35,016.00	0.02
92	300865	大宏立	1,600	34,960.00	0.02
93	603188	亚邦股份	8,800	34,848.00	0.02
94	600356	恒丰纸业	4,700	34,827.00	0.02
95	600148	长春一东	2,400	34,824.00	0.02
96	002633	申科股份	2,300	34,799.00	0.02
97	002795	永和智控	5,200	34,788.00	0.02
98	002863	今飞凯达	8,200	34,768.00	0.02
99	300074	华平股份	10,200	34,680.00	0.02
100	600232	金鹰股份	5,500	34,650.00	0.02
101	000565	渝三峡 A	6,100	34,648.00	0.02
102	301567	贝隆精密	1,000	34,610.00	0.02
103	002712	思美传媒	8,300	34,445.00	0.02
104	300736	百邦科技	1,100	34,100.00	0.02
105	300597	吉大通信	4,800	33,984.00	0.02
106	002295	精艺股份	4,000	33,920.00	0.02
107	300422	博世科	8,000	33,680.00	0.02
108	603889	新澳股份	6,590	33,674.90	0.02
109	001373	翔腾新材	1,100	33,165.00	0.02
110	603617	君禾股份	4,400	31,328.00	0.02

111	600712	南宁百货	6,700	30,820.00	0.02
112	300387	富邦科技	4,500	30,555.00	0.02
113	002729	好利科技	1,700	30,260.00	0.02
114	002578	闽发铝业	9,600	30,240.00	0.02
115	300050	世纪鼎利	5,000	29,600.00	0.02
116	301321	翰博高新	600	26,490.00	0.02
117	003017	大洋生物	1,100	25,300.00	0.02
118	002715	登云股份	1,800	23,850.00	0.02
119	300172	中电环保	5,700	23,541.00	0.02
120	600697	欧亚集团	2,400	23,328.00	0.02
121	601033	永兴股份	1,700	22,780.00	0.02
122	300187	永清环保	4,500	22,725.00	0.02
123	002205	国统股份	2,200	22,198.00	0.02
124	301020	密封科技	1,000	21,840.00	0.02
125	300813	泰林生物	900	17,181.00	0.01
126	301295	美硕科技	400	16,872.00	0.01
127	300807	天迈科技	400	16,276.00	0.01
128	603819	神力股份	1,400	16,030.00	0.01
129	601098	中南传媒	1,600	15,744.00	0.01
130	002952	亚世光电	700	15,421.00	0.01
131	603808	歌力思	2,000	15,140.00	0.01
132	600241	时代万恒	2,300	14,927.00	0.01
133	002591	恒大高新	2,400	14,688.00	0.01
134	601916	浙商银行	5,500	14,465.00	0.01
135	600861	北京人力	1,100	13,420.00	0.01
136	300948	冠中生态	400	10,652.00	0.01
137	603167	渤海轮渡	1,100	9,427.00	0.01
138	002416	爱施德	1,000	8,960.00	0.01
139	300701	森霸传感	900	8,613.00	0.01
140	600405	动力源	1,900	8,588.00	0.01
141	301290	东星医疗	300	8,175.00	0.01
142	002333	罗普斯金	1,700	7,922.00	0.01
143	603518	锦泓集团	1,100	7,865.00	0.01
144	300281	金明精机	1,300	7,839.00	0.01
145	601311	骆驼股份	1,000	7,790.00	0.01
146	000790	华神科技	2,200	7,678.00	0.01
147	300103	达刚控股	1,000	7,670.00	0.01
148	301053	远信工业	200	7,380.00	0.01
149	300771	智莱科技	700	7,224.00	0.01
150	603022	新通联	900	7,191.00	0.01
151	300565	科信技术	700	7,126.00	0.01
152	603028	赛福天	1,100	7,117.00	0.01
153	000755	山西高速	1,600	6,784.00	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	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	603519	立霸股份	1,184,832.00	0.84
2	002327	富安娜	1,107,266.00	0.79
3	000719	中原传媒	1,042,512.00	0.74
4	002404	嘉欣丝绸	1,039,793.00	0.74
5	600256	广汇能源	985,542.00	0.70
6	002572	索菲亚	970,383.00	0.69
7	600757	长江传媒	954,256.00	0.68
8	002271	东方雨虹	941,679.00	0.67
9	002884	凌霄泵业	933,608.00	0.66
10	600863	华能蒙电	926,663.00	0.66
11	603833	欧派家居	924,395.00	0.66
12	600398	海澜之家	894,818.00	0.64
13	601717	中创智领	862,030.00	0.61
14	603855	华荣股份	851,602.00	0.61
15	300826	测绘股份	835,813.00	0.59
16	600015	华夏银行	831,043.00	0.59
17	002612	朗姿股份	827,658.00	0.59
18	600285	羚锐制药	823,958.94	0.59
19	601668	中国建筑	819,174.00	0.58
20	601225	陕西煤业	806,080.00	0.57

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	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	603519	立霸股份	1,157,146.00	0.82
2	002404	嘉欣丝绸	1,048,980.00	0.75
3	002327	富安娜	1,029,324.00	0.73
4	600863	华能蒙电	1,000,631.00	0.71
5	000719	中原传媒	974,872.15	0.69
6	002572	索菲亚	961,188.00	0.68
7	002271	东方雨虹	945,502.00	0.67
8	600256	广汇能源	940,368.94	0.67
9	600757	长江传媒	926,814.00	0.66
10	603833	欧派家居	883,708.00	0.63
11	300826	测绘股份	847,975.00	0.60
12	601225	陕西煤业	842,101.00	0.60
13	002884	凌霄泵业	829,621.00	0.59
14	601916	浙商银行	800,295.00	0.57

15	600285	羚锐制药	789,963.00	0.56
16	600015	华夏银行	779,930.00	0.55
17	603855	华荣股份	778,439.00	0.55
18	600741	华域汽车	759,967.00	0.54
19	600398	海澜之家	755,109.00	0.54
20	601668	中国建筑	738,731.00	0.53

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	169,697,294.38
卖出股票收入（成交）总额	162,188,893.14

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同规定，本基金不参与股指期货交易。

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

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.11.2 本期国债期货投资评价

根据基金合同规定，本基金不参与国债期货交易。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本基金为混合型基金中基金（FOF），基金投资于证券投资基金的资产比例不低于基金资产的80%。以积极的投资风格进行长期资产配置，通过构建与收益风险水平相匹配的基金组合，在严格控制投资风险并保持良好流动性的前提下，追求基金资产的长期增值。本基金属于混合型基金中

基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、股票型基金中基金，高于货币市场基金、债券型基金、债券型基金中基金、货币型基金中基金，基金的投资符合基金合同约定的投资政策、投资限制要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	511380	博时中证可转债及可交换债券 ETF	交易型开放式 (ETF)	425,800.00	5,941,613.20	4.22	否
2	512100	南方中证 1000ETF	交易型开放式 (ETF)	1,187,100.00	4,246,256.70	3.02	否
3	159845	华夏中证 1000ETF	交易型开放式 (ETF)	1,157,200.00	4,224,937.20	3.00	否
4	159985	华夏饲料豆粕期货 ETF	交易型开放式 (ETF)	1,670,600.00	3,316,141.00	2.36	否
5	510500	南方中证 500ETF	交易型开放式 (ETF)	323,900.00	2,977,936.60	2.12	否
6	560010	广发中证 1000ETF	交易型开放式 (ETF)	663,000.00	2,419,950.00	1.72	否

7	563300	华泰柏瑞中证2000ETF	交易型开放式(ETF)	1,488,100.00	2,394,352.90	1.70	否
8	511090	鹏扬中债-30年期国债交易型开放式指数证券投资基金	交易型开放式(ETF)	17,100.00	1,997,570.70	1.42	否
9	588230	华泰柏瑞上证科创板200ETF	交易型开放式(ETF)	781,600.00	1,807,840.80	1.29	否
10	511130	博时上证30年期国债ETF	交易型开放式(ETF)	12,500.00	1,329,762.50	0.95	否
11	513500	博时标普500ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	523,500.00	1,299,850.50	0.92	否
12	159633	易方达中证1000ETF	交易型开放式(ETF)	321,700.00	1,206,375.00	0.86	否
13	159629	富国中证1000ETF	交易型开放式(ETF)	329,500.00	1,204,322.50	0.86	否
14	588030	博时上证科创板100ETF	交易型开放式(ETF)	534,900.00	1,196,571.30	0.85	否
15	159941	广发纳斯达克100ETF(QDII)	交易型开放式(ETF)	624,500.00	1,029,176.00	0.73	否

16	518880	华安易富黄金 ETF	交易型开放式 (ETF)	114,700.00	960,956.60	0.68	否
17	159980	大成有色金属期货 ETF	交易型开放式 (ETF)	315,500.00	648,668.00	0.46	否
18	159937	博时黄金 ETF	交易型开放式 (ETF)	76,600.00	639,686.60	0.45	否
19	512890	华泰柏瑞中证红利低波动 ETF	交易型开放式 (ETF)	596,700.00	636,678.90	0.45	否
20	159628	万家国证 2000ETF	交易型开放式 (ETF)	388,000.00	601,012.00	0.43	否
21	159531	南方中证 2000ETF	交易型开放式 (ETF)	384,100.00	599,196.00	0.43	否
22	159532	易方达中证 2000ETF	交易型开放式 (ETF)	332,700.00	597,196.50	0.42	否
23	562660	华夏中证 2000ETF	交易型开放式 (ETF)	305,600.00	595,920.00	0.42	否
24	159934	易方达黄金 ETF	交易型开放式 (ETF)	54,900.00	480,375.00	0.34	否

25	518800	国泰黄金 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	54,453.00	478,097.34	0.34	否
26	513100	国泰纳斯达克 100ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	154,700.00	340,958.80	0.24	否
27	159655	华夏标普 500ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	175,100.00	330,063.50	0.23	否
28	513650	南方标普 500ETF(QDII)	交易 型开 放式 (ETF)	175,600.00	328,020.80	0.23	否
29	159207	广发中证智选 高股息策略 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	151,700.00	160,953.70	0.11	否

7.13 投资组合报告附注

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

本报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

7.13.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算结果四舍五入，分项之和与合计可能存在尾差。

§ 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 (%)
明亚多元 配置三个 月持有期 混 合 (FOF) A	82	1,702,196.28	39,002,711.66	27.94	100,577,383.62	72.06
明亚多元 配置三个 月持有期 混 合 (FOF) C	211	4,479.34	0.00	0.00	945,140.13	100.00
合计	293	479,608.31	39,002,711.66	27.75	101,522,523.75	72.25

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，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），
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 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	明亚多元配置三个月持有期混 合（FOF）A	50,003.89	0.0358
	明亚多元配置三个月持有期混 合（FOF）C	—	—
	合计	50,003.89	0.0356

注：（1）前述“明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A”项下，占基金总份额比例，系基金管
理人所有从业人员持有明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A 的份额占明亚多元配置三个月持
有期混合（FOF）A 总份额比例；

（2）前述“明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C”项下，占基金总份额比例，系基金管

理人所有从业人员持有明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C 的份额占明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C 总份额比例；

（3）前述“合计”项下，占基金总份额比例=（基金管理人所有从业人员持有明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A 的总份额数+基金管理人所有从业人员持有明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C 的总份额数）/（明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A 总份额数+明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C 总份额数）。

8.3 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	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A	0~10
	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A	0
	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）A	明亚多元配置三个月持有期混合（FOF）C
基金合同生效日（2026 年 1 月 16 日）基金份额总额	200,596,146.13	471,827.51
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	192,968.63	546,431.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	61,209,019.48	73,118.56
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	139,580,095.28	945,140.13

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

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

报告期内，基金管理人、基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、公募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，基金的投资策略未发生重大改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，基金持有的基金未发生重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.7.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，管理人无受调查或处罚等情况。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

			(%)		(%)	
第一创业 证券	3	331,886,187.52	100.00	167,147.65	100.00	-

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)
第一创业证券	-	-	4,003,122,000.00	100.00	-	-	651,229,492.06	100.00

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同及招募说明书提示性公告	规定报刊	2026 年 1 月 9 日
2	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要	证监会指定网站、公司官网	2026 年 1 月 9 日
3	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书	证监会指定网站、公司官网	2026 年 1 月 9 日
4	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	证监会指定网站、公司官网	2026 年 1 月 9 日
5	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	证监会指定网站、公司官网	2026 年 1 月 9 日
6	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 1 月 9 日
7	关于明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 1 月 14 日
8	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 1 月 17 日
9	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 3 月 16 日

10	明亚基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 3 月 30 日
11	明亚基金管理有限责任公司公开募集证券投资基金风险等级评价体系	公司官网	2026 年 4 月 2 日
12	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026 年 4 月 21 日
13	明亚基金管理有限责任公司关于旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 4 月 21 日
14	2025 年度明亚基金管理有限责任公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司官网	2026 年 4 月 27 日
15	明亚基金管理有限责任公司关于明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）新增多家公司为代销机构的公告	公司官网	2026 年 6 月 2 日
16	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 6 月 26 日
17	明亚基金管理有限责任公司关于明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）新增多家公司为代销机构的公告	公司官网	2026 年 6 月 26 日
18	明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金经理变更公告	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 6 月 30 日

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260116-20260622	50,001,844.44	-	35,000,000.00	15,001,844.44	10.68
个人	2	20260116-20260630	50,001,844.44	-	0.00	50,001,844.44	35.58
	3	20260623-20260630	39,501,436.11	-	0.00	39,501,436.11	28.11
产品特有风险							
1、大额赎回风险 本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回							

回的情况，可能导致：

（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20% 的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；

（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；

（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。

2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金的业绩比较基准调整为：中债-新综合全价（总值）指数收益率*40%+中证 800 指数收益率*30%+南华商品指数收益率*20%+标普 500 指数（S&P 500 Index）收益率*10%，自 2026 年 7 月 26 日起生效。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集注册的文件；
- 2、《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》；
- 3、《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》；
- 4、《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金产品资料概要》；
- 5、《明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心 T1 写字楼 1804B

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人办公场所或登录基金管理人网站：www.mingyafunds.com 免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可致电基金管理人全国统一客户服务电话：4008-785-795。

明亚基金管理有限责任公司

2026 年 8 月 27 日